

【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】	2020年1月28日提出
【計算期間】	第20期(自 2018年10月27日至 2019年10月28日)
【ファンド名】	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)
【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

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 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 北米		
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)	欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

ファンドの仕組み

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



- (主な投資制限)
- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
 - ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- (分配方針)
- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
 - ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

- 主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。
- 国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

- 各資産の運用は資産全体の値動きを表す代表的な指数に連動することをめざすインデックス運用で行ないます。

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)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めざして運用を行ないます。

「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

※MSCI-KOKUSAIインデックス：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。

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

※FTSE世界国債インデックス(除く日本)：同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数は、FTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるよう調整を行ないます。

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

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】

1999年10月29日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

2001年6月1日

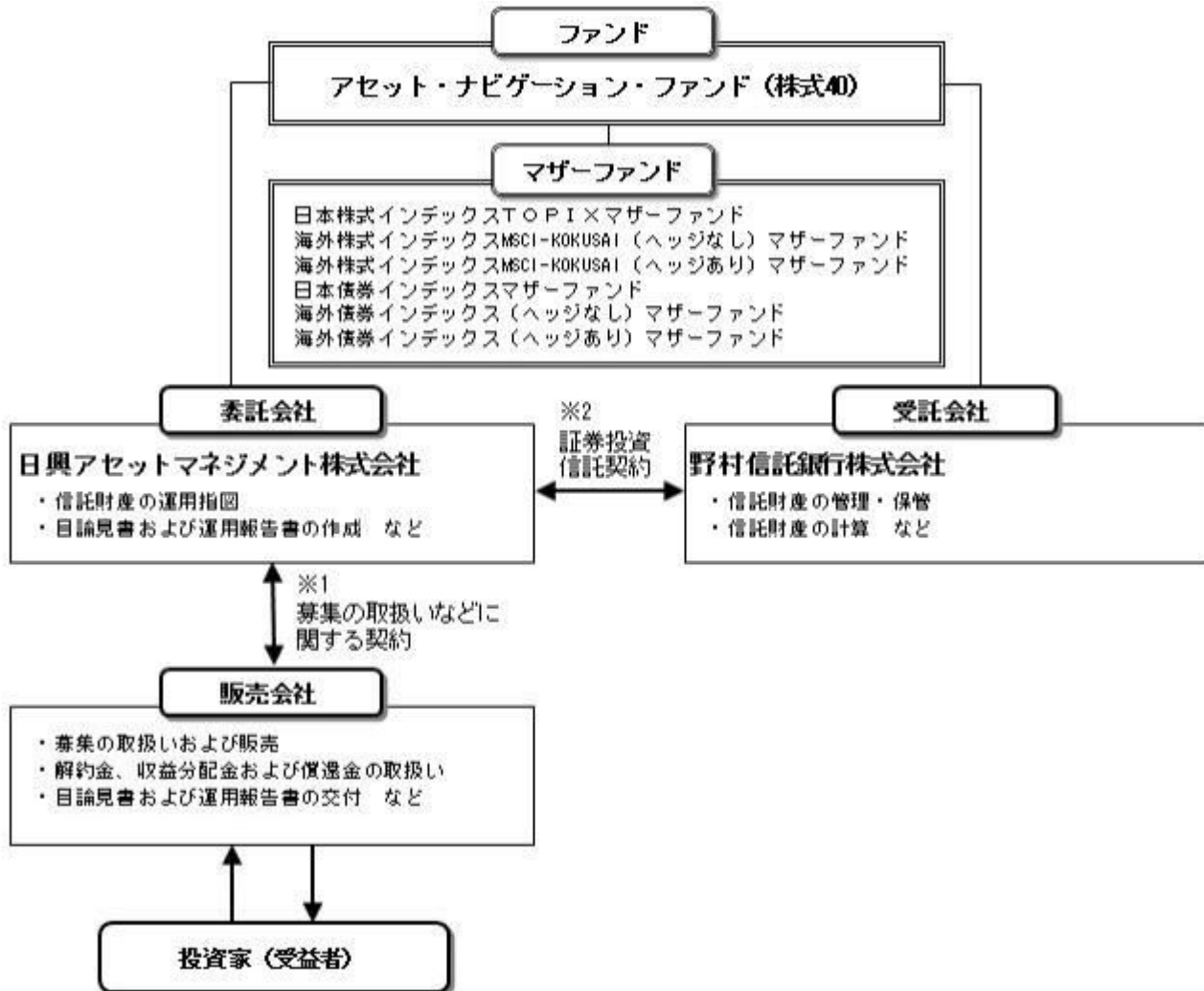
・ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ3）

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2019年10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、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
 - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
 - 株式の標準実質組入比率.....40%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 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」受益証券
- 3) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 5) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 6) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」受益証券
- 7) 株券または新株引受権証書

- 8) 国債証券
 - 9) 地方債証券
 - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 11) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 12) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 13) コマーシャル・ペーパー
 - 14) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)~14)の証券または証書の性質を有するもの
 - 16) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
 - 17) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 18) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 19) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 21) 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。)
 - 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックストップIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に

掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。)には投資しません。

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ます。)を除きます。)には投資しません。

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド >
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限りま。
 - 3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7) コマーシャル・ペーパー

8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの

10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの

12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

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

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

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

16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 信用取引

2) 先物取引等

3) スワップ取引

4) 金利先渡取引

5) 為替先渡取引

6) 有価証券の貸付

7) 公社債の空売

8) 公社債の借入

9) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 公社債の空売
- 6) 公社債の借入

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

5) 為替手形

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

1) 国債証券

2) 地方債証券

3) 特別の法律により法人の発行する債券

4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。))に限ります。)

5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

6) コマーシャル・ペーパー

7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの

8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券

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

10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 先物取引等

2) スワップ取引

3) 金利先渡取引

4) 為替先渡取引

5) 有価証券の貸付

6) 公社債の空売

7) 公社債の借入

8) 外国為替予約取引

< 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)

2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。))に限ります。)
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 為替先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
 - 8) 外国為替予約取引

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<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。 ・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、 ・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（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）* 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）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 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。

< 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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(円ヘッジあり・円ベース) [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	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)およびカンツリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス(円ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
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。(円ヘッジあり・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、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。

< 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式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	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)>

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（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

を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについ

てはこの限りではありません。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

図をすることができます。

- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
 - 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指

図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績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。

当ファンド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。

流動性リスク

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

信用リスク

- ・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。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・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。
- ・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

<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

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

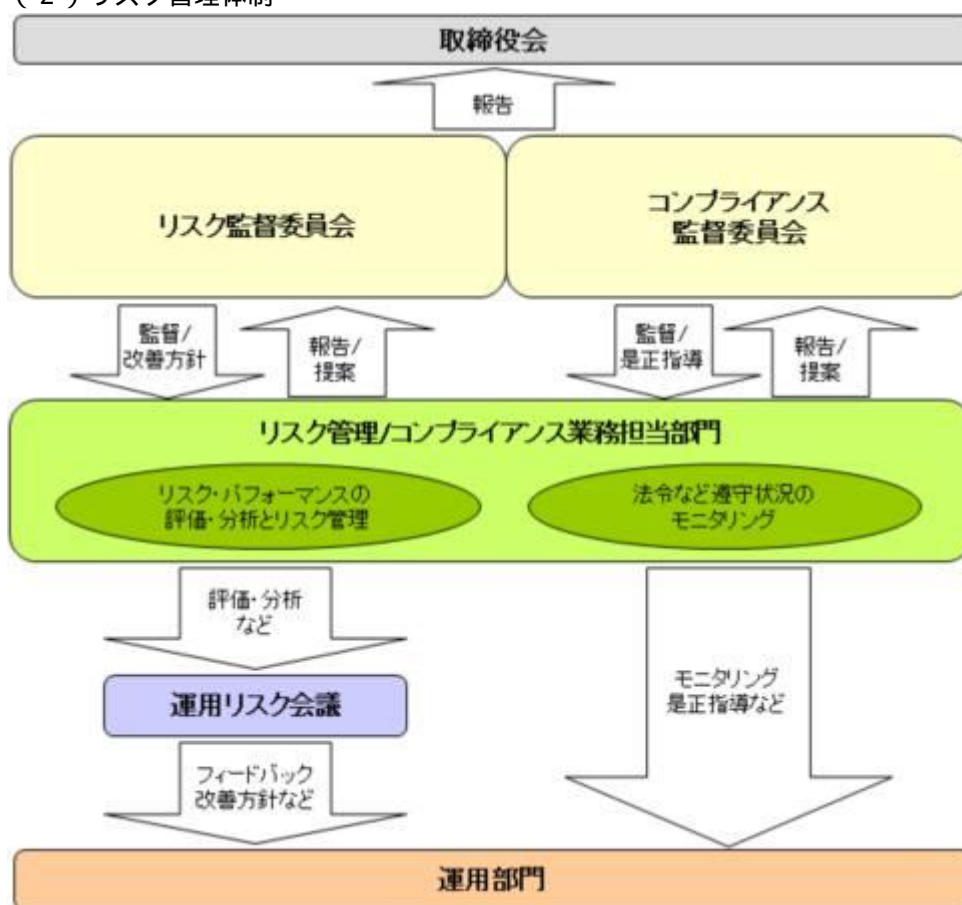
・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量

に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



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10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	3.8%	8.2%	9.3%	5.8%	2.1%	2.1%	1.2%
最大値	15.2%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-6.1%	-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11月から2019年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。な

お、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.1%(税抜1%)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。
- ・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

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

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

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.671%(税抜0.61%)の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.61%	0.22%	0.35%	0.04%

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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

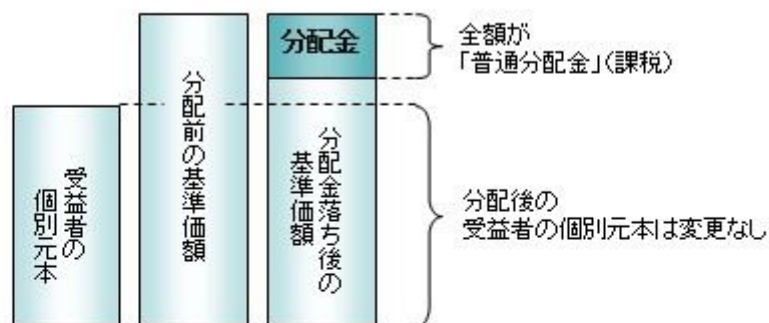
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

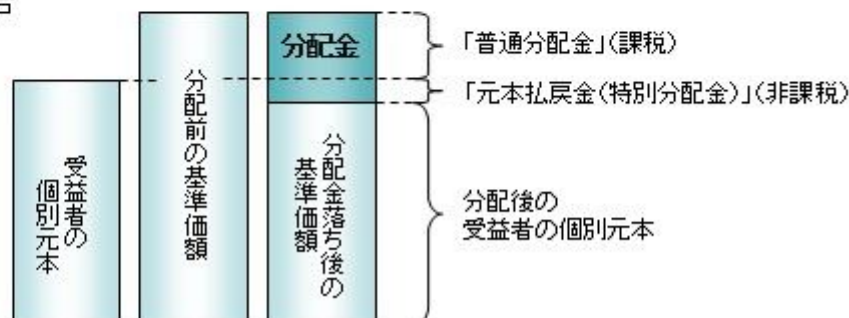
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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2020年1月28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】

【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)】

以下の運用状況は2019年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	311,936,795	95.08
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		16,142,677	4.92
合計(純資産総額)		328,079,472	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	103,120,055	1.4314	147,606,047	1.4337	147,843,222	45.06
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	63,721,419	1.5279	97,359,957	1.5454	98,475,080	30.02
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	6,985,542	2.3454	16,383,891	2.3519	16,429,296	5.01
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	10,391,504	1.5811	16,430,007	1.5797	16,415,458	5.00
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	9,218,138	1.7668	16,286,607	1.7781	16,390,771	5.00
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	6,184,119	2.6268	16,244,444	2.6492	16,382,968	4.99

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.08
合計	95.08

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（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11計算期間末 (2010年10月26日)	646	646	0.9762	0.9762
第12計算期間末 (2011年10月26日)	560	560	0.9571	0.9571
第13計算期間末 (2012年10月26日)	515	515	0.9913	0.9913
第14計算期間末 (2013年10月28日)	466	466	1.2162	1.2172
第15計算期間末 (2014年10月27日)	360	360	1.2757	1.2767
第16計算期間末 (2015年10月26日)	343	344	1.4047	1.4057
第17計算期間末 (2016年10月26日)	308	308	1.3778	1.3788
第18計算期間末 (2017年10月26日)	314	314	1.5119	1.5129
第19計算期間末 (2018年10月26日)	355	355	1.4719	1.4729
第20計算期間末 (2019年10月28日)	386	387	1.5407	1.5417
2018年10月末日	359		1.4858	
11月末日	370		1.4977	
12月末日	368		1.4425	
2019年 1月末日	376		1.4756	
2月末日	380		1.4966	
3月末日	384		1.5043	
4月末日	383		1.5147	
5月末日	374		1.4805	
6月末日	378		1.5036	
7月末日	380		1.5121	
8月末日	378		1.5024	
9月末日	384		1.5255	
10月末日	328		1.5484	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0000
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0000
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0000
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010

第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第20期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.78
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	1.96
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	3.57
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	22.79
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	4.97
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	10.19
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	1.84
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	9.81
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	2.58
第20期	2018年10月27日～2019年10月28日	4.74

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	44,772,360	71,522,165
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	38,817,760	115,309,278
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	27,776,150	93,719,970
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	18,386,017	154,999,819
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	11,663,810	112,584,086
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	11,849,353	49,640,624
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	8,937,726	29,583,310
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	8,537,068	24,925,795
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	57,906,257	23,995,805
第20期	2018年10月27日～2019年10月28日	27,380,609	17,962,808

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2019年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	32,927,699,570	98.93
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		354,840,102	1.07
合計（純資産総額）		33,282,539,672	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	350,385,000	1.05

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	155,800	7,483.84	1,165,982,800	7,542.00	1,175,043,600	3.53
日本	株式	ソニー	電気機器	88,500	6,370.00	563,745,000	6,625.00	586,312,500	1.76
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	949,700	566.50	538,007,260	569.80	541,139,060	1.63
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	91,700	5,298.00	485,826,600	5,376.00	492,979,200	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	116,400	3,824.00	445,113,600	3,928.00	457,219,200	1.37
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	109,000	3,996.53	435,622,500	4,190.00	456,710,000	1.37
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,300	67,210.00	423,423,000	68,820.00	433,566,000	1.30
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	95,500	3,850.00	367,675,000	3,880.00	370,540,000	1.11
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	95,700	3,535.60	338,357,800	3,611.00	345,572,700	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	8,600	37,140.46	319,408,000	38,620.00	332,132,000	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	110,200	2,950.00	325,090,000	2,942.00	324,208,400	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,874,900	167.33	313,732,330	168.80	316,483,120	0.95
日本	株式	KDDI	情報・通信業	102,300	2,936.50	300,403,950	2,999.00	306,797,700	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	101,500	2,846.70	288,941,000	2,975.00	301,962,500	0.91
日本	株式	信越化学工業	化学	24,200	11,859.19	286,992,400	12,160.00	294,272,000	0.88
日本	株式	花王	化学	33,600	8,342.91	280,322,000	8,744.00	293,798,400	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	49,400	5,588.46	276,070,200	5,868.00	289,879,200	0.87

日本	株式	第一三共	医薬品	40,100	6,901.49	276,749,900	7,140.00	286,314,000	0.86
日本	株式	ファナック	電気機器	13,200	21,638.56	285,629,000	21,600.00	285,120,000	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	67,200	4,200.77	282,291,800	4,069.00	273,436,800	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,900	15,230.00	272,617,000	15,230.00	272,617,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	16,900	15,960.42	269,731,200	16,085.00	271,836,500	0.82
日本	株式	H O Y A	精密機器	28,100	9,139.34	256,815,500	9,603.00	269,844,300	0.81
日本	株式	三菱商事	卸売業	96,700	2,735.67	264,539,350	2,764.00	267,278,800	0.80
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,700	22,735.00	265,999,500	22,295.00	260,851,500	0.78
日本	株式	資生堂	化学	27,800	8,613.61	239,458,500	8,968.00	249,310,400	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,600	9,992.32	245,811,300	9,849.00	242,285,400	0.73
日本	株式	村田製作所	電気機器	41,100	5,908.00	242,818,800	5,863.00	240,969,300	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	123,000	1,771.32	217,873,000	1,858.50	228,595,500	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	121,100	1,819.35	220,323,800	1,867.50	226,154,250	0.68

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.86
		食料品	3.94
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.33
		医薬品	5.75
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.60
		機械	5.10
		電気機器	13.82
		輸送用機器	7.91
		精密機器	2.22
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.60
		陸運業	4.47
		海運業	0.18
		空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	8.33		
卸売業	4.92		
小売業	4.64		

	銀行業	5.80
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.28
	その他金融業	1.13
	不動産業	2.45
	サービス業	5.02
合 計		98.93

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2019年12月	買建	21	日本円	346,020,550	350,385,000	1.05

(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10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
出資金	アメリカ	19,654,531	0.01
株式	アメリカ	119,821,243,130	63.07
	カナダ	7,023,575,088	3.70
	モーリシャス	2,184,273	0.00
	ドイツ	6,061,442,912	3.19
	イタリア	1,334,918,791	0.70
	フランス	7,072,160,419	3.72
	オランダ	3,509,107,773	1.85
	スペイン	2,009,242,907	1.06
	ベルギー	664,700,694	0.35
	オーストリア	155,347,133	0.08
	ルクセンブルク	187,207,068	0.10
	フィンランド	780,026,278	0.41
	アイルランド	3,577,337,022	1.88
ポルトガル	111,344,776	0.06	
イギリス	10,889,811,909	5.73	

	スイス	7,051,308,497	3.71
	スウェーデン	1,659,371,160	0.87
	ノルウェー	434,907,779	0.23
	デンマーク	1,239,477,785	0.65
	ケイマン	439,139,934	0.23
	オーストラリア	4,389,629,302	2.31
	バミューダ	409,024,644	0.22
	ニュージーランド	149,284,686	0.08
	香港	1,861,380,162	0.98
	シンガポール	798,309,874	0.42
	イスラエル	393,269,531	0.21
	ジャージー	530,050,677	0.28
	英ヴァージン諸島	20,297,246	0.01
	アラブ首長国連邦	11,231,234	0.01
	マン島	33,428,072	0.02
	小計	182,619,760,756	96.13
投資証券	アメリカ	4,319,518,543	2.27
	カナダ	29,102,784	0.02
	フランス	214,015,730	0.11
	イギリス	129,266,840	0.07
	オーストラリア	402,384,501	0.21
	香港	111,364,811	0.06
	シンガポール	90,737,660	0.05
	小計	5,296,390,869	2.79
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,042,961,419	1.08
合計(純資産総額)		189,978,767,575	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,239,950,132	1.18
	買建	ドイツ	537,824,880	0.28

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		2,346,838,900	1.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	204,442	26,841.19	5,487,466,629	26,486.14	5,414,881,233	2.85
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	323,314	15,327.10	4,955,468,996	15,745.13	5,090,623,159	2.68
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,585	191,776.69	3,564,169,841	193,805.31	3,601,871,709	1.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	106,850	20,460.48	2,186,202,971	20,496.66	2,190,068,121	1.15
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	143,990	13,722.91	1,975,963,150	13,689.48	1,971,148,571	1.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,942	137,741.87	1,920,397,152	137,329.25	1,914,644,476	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,310	137,650.01	1,832,121,646	137,265.01	1,826,997,363	0.96
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	117,881	13,983.48	1,648,387,018	14,463.61	1,704,985,895	0.90
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	136,263	11,533.78	1,571,628,300	11,663.65	1,589,324,594	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	111,299	13,420.21	1,493,656,436	13,603.46	1,514,052,296	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	77,162	19,363.87	1,494,155,286	19,516.74	1,505,950,692	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	187,741	7,538.47	1,415,281,465	7,373.35	1,384,280,778	0.73
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	400,779	3,454.30	1,384,414,512	3,442.78	1,379,796,170	0.73
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	324,077	4,021.22	1,303,186,137	4,159.21	1,347,906,244	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	57,670	23,063.37	1,330,064,786	23,218.65	1,339,020,122	0.70
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	48,800	25,518.82	1,245,318,682	25,721.81	1,255,224,387	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	198,882	6,147.14	1,222,556,231	6,162.60	1,225,631,804	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	183,847	6,572.67	1,208,367,232	6,622.08	1,217,449,836	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	40,320	29,426.96	1,186,495,169	30,176.09	1,216,700,029	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	42,150	26,681.27	1,124,615,924	27,742.62	1,169,351,602	0.62
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	79,852	14,249.56	1,137,856,181	14,110.84	1,126,779,435	0.59
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	114,533	8,963.34	1,026,598,305	9,387.63	1,075,193,839	0.57
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	189,360	5,615.97	1,063,441,203	5,665.02	1,072,729,399	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	84,491	12,919.67	1,091,596,066	12,669.27	1,070,439,866	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	179,732	5,851.59	1,051,718,173	5,872.98	1,055,563,735	0.56
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	246,750	4,006.29	988,554,400	4,189.70	1,033,809,067	0.54

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	31,288	32,453.67	1,015,410,449	32,684.89	1,022,645,057	0.54
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	190,190	5,107.16	971,331,111	5,178.33	984,867,115	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	201,464	4,969.65	1,001,205,592	4,865.84	980,293,040	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	62,151	14,876.20	924,571,077	14,905.67	926,402,420	0.49

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	5.32
		素材	4.23
		資本財	7.05
		商業・専門サービス	1.25
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.14
		耐久消費財・アパレル	1.92
		消費者サービス	1.81
		メディア・娯楽	5.82
		小売	4.82
		食品・生活必需品小売り	1.54
		食品・飲料・タバコ	4.81
		家庭用品・パーソナル用品	2.14
		ヘルスケア機器・サービス	4.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.07
		銀行	7.84
		各種金融	4.30
		保険	3.84
		不動産	0.51
		ソフトウェア・サービス	9.34
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.45		
電気通信サービス	2.45		
公益事業	3.60		
半導体・半導体製造装置	3.17		
投資証券			2.79
合計			98.92

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1912	買建	135	米ドル	20,481,225	2,229,995,778	20,572,650	2,239,950,132	1.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1912	買建	135	ユーロ	4,424,050	537,345,113	4,428,000	537,824,880	0.28

(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	17,400,000.00	1,890,223,800	1,891,236,000	1.00
	ユーロ	買建	3,150,000.00	380,890,300	382,591,000	0.20
	豪ドル	買建	970,000.00	72,439,600	73,011,900	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2019年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	5,404,542,675	61.37
	カナダ	316,997,702	3.60
	ドイツ	272,059,754	3.09
	イタリア	58,558,823	0.66
	フランス	315,318,057	3.58
	オランダ	159,611,876	1.81
	スペイン	89,330,549	1.01
	ベルギー	29,881,293	0.34
	オーストリア	5,451,132	0.06
	ルクセンブルク	7,236,745	0.08
	フィンランド	35,367,028	0.40
	アイルランド	162,519,437	1.85
	ポルトガル	5,686,536	0.06
	イギリス	494,194,187	5.61
	スイス	322,896,912	3.67
	スウェーデン	74,910,313	0.85

	ノルウェー	18,226,158	0.21
	デンマーク	56,972,111	0.65
	ケイマン	19,316,155	0.22
	オーストラリア	195,556,151	2.22
	バミューダ	17,450,687	0.20
	ニュージーランド	5,003,242	0.06
	香港	85,993,630	0.98
	シンガポール	32,535,845	0.37
	イスラエル	16,341,261	0.19
	ジャージー	25,475,144	0.29
	英ヴァージン諸島	1,095,845	0.01
	小計	8,228,529,248	93.44
投資証券	アメリカ	192,256,381	2.18
	フランス	11,080,956	0.13
	イギリス	8,170,716	0.09
	オーストラリア	21,200,442	0.24
	香港	5,439,605	0.06
	小計	238,148,100	2.70
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		339,863,191	3.86
合計（純資産総額）		8,806,540,539	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	315,252,240	3.58
	買建	ドイツ	75,693,872	0.86

(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	売建		8,624,427,870	97.93

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	9,212	26,847.63	247,320,371	26,486.14	243,990,403	2.77

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	14,543	15,322.68	222,837,770	15,745.13	228,981,524	2.60
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	841	191,773.61	161,281,607	193,805.31	162,990,267	1.85
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	4,814	20,457.46	98,482,228	20,496.65	98,670,921	1.12
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	6,461	13,722.14	88,658,788	13,689.48	88,447,746	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	634	137,747.35	87,331,823	137,329.25	87,066,748	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	594	137,656.98	81,768,248	137,265.01	81,535,419	0.93
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	5,301	13,974.74	74,080,139	14,463.61	76,671,645	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	6,070	11,533.64	70,009,210	11,663.65	70,798,385	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	4,980	13,419.46	66,828,911	13,603.46	67,745,267	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	3,443	19,364.30	66,671,313	19,516.74	67,196,136	0.76
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	18,019	3,453.67	62,231,745	3,442.78	62,035,554	0.70
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	8,385	7,539.94	63,222,397	7,373.35	61,825,570	0.70
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	14,575	4,018.76	58,573,438	4,159.21	60,620,573	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	2,579	23,060.78	59,473,762	23,218.65	59,880,924	0.68
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	2,190	25,519.29	55,887,255	25,721.81	56,330,767	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	8,933	6,147.36	54,914,409	6,162.60	55,050,577	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	8,234	6,573.08	54,122,787	6,622.08	54,526,220	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	1,801	29,418.28	52,982,336	30,176.09	54,347,142	0.62
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,900	26,665.80	50,665,022	27,742.62	52,710,986	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	3,581	14,252.39	51,037,816	14,110.84	50,530,947	0.57
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	8,528	5,614.94	47,884,222	5,665.02	48,311,345	0.55
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,144	8,956.46	46,072,075	9,387.63	48,289,987	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	3,780	12,920.78	48,840,584	12,669.27	47,889,866	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	7,998	5,852.30	46,806,696	5,872.98	46,972,152	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	11,124	4,003.51	44,535,129	4,189.70	46,606,249	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	1,407	32,453.51	45,662,101	32,684.89	45,987,650	0.52
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	8,578	5,106.47	43,803,317	5,178.33	44,419,739	0.50

アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	9,000	4,970.37	44,733,348	4,865.84	43,792,625	0.50
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,313	9,574.64	41,295,431	9,562.52	41,243,158	0.47

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	5.19
		素材	4.12
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.13
		耐久消費財・アパレル	1.91
		消費者サービス	1.77
		メディア・娯楽	5.67
		小売	4.68
		食品・生活必需品小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	4.68
		家庭用品・パーソナル用品	2.10
		ヘルスケア機器・サービス	4.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.85
		銀行	7.70
		各種金融	4.16
		保険	3.68
		不動産	0.51
		ソフトウェア・サービス	9.02
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.31		
電気通信サービス	2.34		
公益事業	3.48		
半導体・半導体製造装置	3.10		
投資証券			2.70
合計			96.14

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	19米ドル	2,869,285	312,407,750	2,895,410	315,252,240	3.58
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1912	買建	19ユーロ	622,250	75,578,485	623,200	75,693,872	0.86

(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	売建	54,798,000.00	5,942,821,278	5,946,987,420	67.53
	加ドル	売建	3,785,000.00	314,244,912	311,996,100	3.54
	ユーロ	売建	8,422,000.00	1,015,556,235	1,022,871,650	11.61
	英ポンド	売建	3,680,000.00	512,691,120	516,399,020	5.86
	スイスフラン	売建	2,654,000.00	290,566,165	292,548,680	3.32
	スウェーデンクローナ	売建	7,267,000.00	81,607,903	81,971,760	0.93
	ノルウェークローネ	売建	1,682,000.00	19,833,295	19,893,400	0.23
	デンマーククローネ	売建	3,511,000.00	56,683,958	57,082,360	0.65
	豪ドル	売建	2,965,000.00	219,616,680	222,731,570	2.53
	ニュージーランドドル	売建	79,000.00	5,445,400	5,499,250	0.06
	香港ドル	売建	7,551,000.00	104,397,366	104,443,790	1.19
	シンガポールドドル	売建	426,000.00	33,889,348	33,958,650	0.39
	イスラエルシェケル	売建	261,000.00	8,025,764	8,044,220	0.09

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2019年10月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	32,158,204,088	77.19
地方債証券	日本	3,170,849,000	7.61
特殊債券	日本	3,471,680,000	8.33
社債券	日本	2,655,702,000	6.37
	オーストラリア	100,226,000	0.24
	小計	2,755,928,000	6.61
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		105,787,661	0.25
合計(純資産総額)		41,662,448,749	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	700,000,000	103.52	724,689,000	103.58	725,109,000	0.300	2025/12/20	1.74
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	102.61	625,975,900	102.69	626,415,100	0.100	2026/12/20	1.50
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	508,000,000	121.91	619,343,440	122.06	620,069,880	1.700	2032/9/20	1.49
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.19	561,105,314	100.19	561,105,314	0.100	2020/6/20	1.35
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	430,000,000	119.76	514,976,600	119.91	515,613,000	1.500	2033/3/20	1.24
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.74	508,330,900	103.78	508,546,500	0.500	2024/9/20	1.22
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	490,000,000	102.86	504,043,400	102.94	504,445,200	0.100	2027/12/20	1.21
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	102.75	503,475,000	102.78	503,651,400	0.100	2027/3/20	1.21
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	480,000,000	102.82	493,545,600	102.90	493,953,600	0.100	2028/3/20	1.19
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	102.77	447,062,550	102.86	447,445,350	0.100	2028/6/20	1.07
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.95	436,590,000	104.03	436,955,400	0.400	2025/9/20	1.05
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	355,000,000	122.68	435,538,850	122.84	436,082,000	1.700	2033/6/20	1.05
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	103.60	404,067,300	103.68	404,375,400	0.400	2025/3/20	0.97
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	390,000,000	102.71	400,592,400	102.80	400,943,400	0.100	2028/9/20	0.96
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	140.30	387,244,560	140.67	388,260,240	2.400	2038/9/20	0.93
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	103.77	383,978,600	103.86	384,289,400	0.400	2025/6/20	0.92
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	102.10	377,781,100	102.11	377,814,400	1.300	2021/3/20	0.91
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	293,000,000	123.09	360,668,350	123.20	360,993,580	2.100	2030/3/20	0.87
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.28	354,632,300	122.39	354,933,900	2.100	2029/9/20	0.85
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.18	351,543,000	117.23	351,714,000	2.300	2026/6/20	0.84
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.33	326,103,166	100.33	326,103,166	0.100	2020/9/20	0.78
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	105.19	310,316,400	105.22	310,422,600	1.400	2022/12/20	0.75
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	105.32	300,164,850	105.69	301,225,050	0.500	2038/3/20	0.72
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	117.88	294,712,500	117.94	294,865,000	2.300	2026/9/20	0.71
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	139.87	279,750,000	140.43	280,864,000	2.200	2041/3/20	0.67
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	133.38	277,434,560	133.64	277,989,920	2.400	2034/3/20	0.67
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	120.29	276,669,500	120.51	277,189,100	1.600	2032/6/20	0.67

日本	国債証券	第43回利付国債 (30年)	205,000,000	132.57	271,786,950	133.18	273,023,100	1.700	2044/6/20	0.66
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	245,000,000	102.43	250,958,400	102.49	251,120,100	0.100	2026/6/20	0.60
日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	102.95	243,993,870	102.95	244,003,350	1.900	2021/3/22	0.59

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.19
地方債証券	7.61
特殊債券	8.33
社債券	6.61
合計	99.75

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2019年10月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	73,658,677,889	47.36
	カナダ	2,835,031,659	1.82
	メキシコ	1,291,255,098	0.83
	ドイツ	9,588,950,425	6.16
	イタリア	14,093,201,813	9.06
	フランス	15,411,452,898	9.91
	オランダ	2,844,968,787	1.83
	スペイン	8,784,930,136	5.65
	ベルギー	3,668,871,053	2.36
	オーストリア	2,143,613,080	1.38
	フィンランド	859,483,118	0.55
	アイルランド	1,135,678,256	0.73
	イギリス	9,791,364,014	6.30
	スウェーデン	517,629,363	0.33

	ノルウェー	350,480,159	0.23
	デンマーク	795,270,836	0.51
	ポーランド	926,893,878	0.60
	オーストラリア	3,103,789,915	2.00
	シンガポール	614,656,701	0.40
	マレーシア	711,209,001	0.46
	南アフリカ	846,384,302	0.54
	小計	153,973,792,381	98.99
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,566,927,199	1.01
合計(純資産総額)		155,540,719,580	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		82,572,180	0.05
	売建		69,495,254	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,860,000	10,974.97	1,301,632,097	10,973.91	1,301,506,064	2.125	2021/8/15	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	10,738.07	1,181,188,510	10,736.37	1,181,001,372	1.250	2023/7/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,270.26	1,134,999,544	12,264.09	1,134,429,100	8.000	2021/11/15	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,960.08	1,063,128,677	10,957.11	1,062,839,929	1.875	2022/7/31	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,840,000	10,855.46	959,622,982	10,853.97	959,491,390	1.500	2022/1/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,650,000	10,931.59	836,266,976	10,929.25	836,087,979	1.750	2023/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	11,110.22	833,266,888	11,107.67	833,075,477	2.750	2021/9/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	13,630.83	697,898,989	13,659.54	699,368,858	3.625	2043/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	11,302.67	689,463,436	11,304.80	689,593,148	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,239.09	667,602,211	11,234.62	667,336,979	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	10,969.66	663,664,430	10,969.44	663,651,519	2.125	2021/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,920.96	655,257,675	10,921.38	655,283,218	2.000	2020/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,296.08	655,173,022	11,293.74	655,037,375	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,271.41	653,742,287	11,267.80	653,532,628	2.500	2024/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,147.13	643,798,278	12,186.47	645,883,383	2.875	2045/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	13,902.18	625,598,517	13,933.87	627,024,350	3.750	2043/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,839.72	617,864,442	10,836.74	617,694,741	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	12,107.58	611,432,961	12,135.22	612,829,015	2.875	2043/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,450,000	11,200.81	610,444,505	11,194.86	610,119,976	2.250	2024/11/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,745,000	22,291.69	611,907,153	22,212.82	609,742,003	4.500	2041/4/25	0.39

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,235.05	595,457,915	11,231.01	595,243,767	2.500	2023/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	10,780.40	592,922,036	10,775.29	592,641,329	1.375	2023/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,693.11	584,655,821	11,687.16	584,358,089	3.000	2025/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,019.84	584,051,841	11,014.74	583,781,371	2.000	2023/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,996.88	582,834,640	10,995.81	582,778,261	2.250	2021/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	11,081.09	578,432,953	11,073.00	578,011,121	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	11,298.85	575,111,518	11,301.61	575,252,229	2.250	2027/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,250,000	10,889.06	571,675,790	10,884.59	571,441,368	1.625	2022/8/31	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	14,517.43	570,535,142	14,501.04	569,891,213	4.250	2023/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,861.75	569,364,094	11,862.81	569,415,154	2.875	2028/8/15	0.37

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.99
合 計	98.99

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	320,000.00	34,832,000	34,838,400	0.02
	ユーロ	買建	393,000.00	47,731,638	47,733,780	0.03
	米ドル	売建	638,387.57	69,499,638	69,495,254	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

以下の運用状況は2019年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	11,514,238,414	47.72
	カナダ	453,921,436	1.88
	メキシコ	190,281,589	0.79
	ドイツ	1,432,140,850	5.94
	イタリア	2,200,074,450	9.12
	フランス	2,361,435,865	9.79

	オランダ	438,844,929	1.82
	スペイン	1,378,622,305	5.71
	ベルギー	569,386,795	2.36
	オーストリア	374,499,748	1.55
	フィンランド	107,766,443	0.45
	アイルランド	187,377,204	0.78
	イギリス	1,502,650,040	6.23
	スウェーデン	134,994,878	0.56
	ノルウェー	64,127,208	0.27
	デンマーク	124,641,660	0.52
	ポーランド	109,779,725	0.45
	オーストラリア	488,188,891	2.02
	シンガポール	74,285,672	0.31
	マレーシア	199,170,926	0.83
	南アフリカ	127,645,881	0.53
	小計	24,034,074,909	99.60
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		95,440,791	0.40
合計(純資産総額)		24,129,515,700	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		24,333,195,560	100.84

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,600,000	10,860.35	499,576,316	10,859.07	499,517,622	1.375	2020/9/30	2.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,300,000	11,101.71	477,373,937	11,100.65	477,328,195	2.000	2026/11/15	1.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,230,000	11,252.06	475,962,455	11,247.17	475,755,524	2.375	2024/8/15	1.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,302.67	361,685,737	11,304.80	361,753,783	2.250	2027/11/15	1.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,130,000	14,469.13	308,192,483	14,466.36	308,133,600	6.125	2027/11/15	1.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	10,918.83	294,808,540	10,916.49	294,745,365	1.750	2022/3/31	1.22
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,600,000	10,998.36	285,957,578	10,997.94	285,946,509	2.500	2021/1/31	1.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,550,000	10,892.46	277,757,862	10,887.78	277,638,577	1.625	2022/8/15	1.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,340.74	272,177,875	11,381.14	273,147,578	2.500	2045/2/15	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,450,000	11,127.44	272,622,524	11,125.96	272,586,059	3.125	2021/5/15	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,420,000	10,974.97	265,594,407	10,973.91	265,568,691	2.125	2021/8/15	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,842.49	260,219,797	10,841.00	260,184,070	1.500	2023/3/31	1.08

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,835.26	260,046,270	10,835.47	260,051,373	1.625	2026/5/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	11,200.81	257,618,782	11,194.86	257,481,825	2.250	2024/11/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	10,923.29	256,697,549	10,919.25	256,602,597	1.750	2022/5/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	10,787.62	253,509,216	10,833.98	254,598,654	2.250	2046/8/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	11,296.08	248,513,904	11,293.74	248,462,452	2.500	2024/5/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,080,000	11,389.44	236,900,402	11,385.18	236,811,944	2.750	2024/2/15	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,980.29	225,095,988	10,977.31	225,034,964	2.000	2022/2/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,931.59	224,097,686	10,929.25	224,049,720	1.750	2023/5/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	10,948.81	218,976,386	10,947.96	218,959,379	2.125	2021/1/31	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	11,158.28	212,007,431	11,157.22	211,987,220	3.625	2021/2/15	0.88
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000	12,978.51	205,060,476	12,965.87	204,860,893	3.750	2021/8/1	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,670,000	12,270.26	204,913,431	12,264.09	204,810,442	8.000	2021/11/15	0.85
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,010,000	20,316.26	205,194,270	20,255.27	204,578,297	4.000	2038/10/25	0.85
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000	13,201.00	198,015,023	13,190.95	197,864,352	2.250	2022/10/25	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	10,933.50	196,803,135	10,932.86	196,791,650	2.000	2021/2/28	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,666.95	186,671,346	11,670.99	186,735,994	2.625	2029/2/15	0.77
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000	16,988.34	186,871,773	16,957.90	186,536,956	5.900	2026/7/30	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,969.23	186,476,983	10,964.34	186,393,838	1.875	2022/10/31	0.77

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.60
合計	99.60

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	106,544,000.00	11,564,657,840	11,573,041,800	47.96
	加ドル	売建	5,571,000.00	462,873,050	459,533,770	1.90
	メキシコペソ	売建	34,331,000.00	194,448,227	194,251,310	0.81
	ユーロ	売建	75,709,000.00	9,128,335,240	9,194,860,250	38.11
	英ポンド	売建	10,837,000.00	1,510,403,710	1,521,544,510	6.31
	スウェーデンクローナ	売建	12,170,000.00	136,669,100	137,277,600	0.57
	ノルウェークローネ	売建	5,478,000.00	64,613,250	64,819,320	0.27
	デンマーククローネ	売建	7,854,000.00	126,776,670	127,685,810	0.53
	ポーランドズロチ	売建	3,990,000.00	112,227,958	113,466,320	0.47
	豪ドル	売建	6,596,000.00	488,845,550	495,838,950	2.05
	シンガポールドル	売建	937,000.00	74,585,690	74,742,950	0.31

マレーシアリングット	売建	9,338,000.00	241,947,580	242,507,860	1.01
南アフリカランド	売建	18,534,000.00	136,775,890	133,625,110	0.55

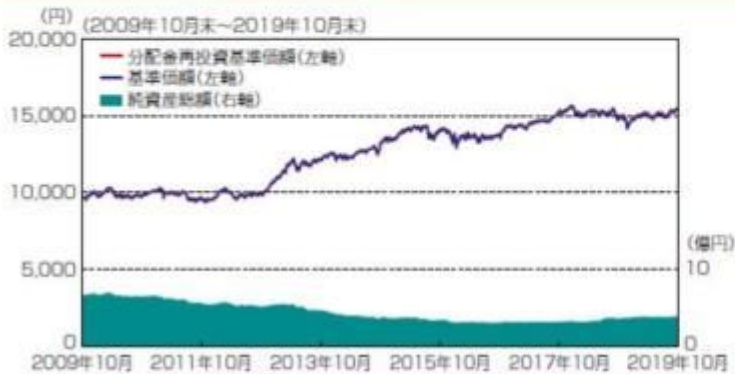
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2019年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額..... 15,484円

純資産総額..... 3.28億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2009年10月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年10月	2016年10月	2017年10月	2018年10月	2019年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	100円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30.02%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	4.99%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5.00%
日本債券インデックスマザーファンド	45.06%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.01%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5.00%
現金その他	4.92%

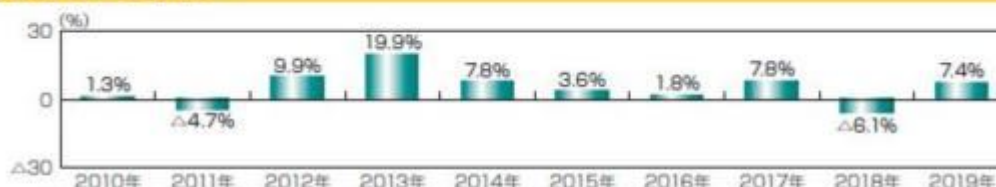
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.53%
	2 ソニー	電気機器	1.76%
	3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.63%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジーハードウェアおよび機器	2.85%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.68%
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.90%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジーハードウェアおよび機器	2.77%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.60%
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.85%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	1.74%
	2 第345回利付国債(10年)	国債証券	1.50%
	3 第140回利付国債(20年)	国債証券	1.49%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.125%)	国債証券	0.84%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.250%)	国債証券	0.76%
	3 US TREASURY N/B(クーポン8.000%)	国債証券	0.73%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン1.375%)	国債証券	2.07%
	2 US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	1.98%
	3 US TREASURY N/B(クーポン2.375%)	国債証券	1.97%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2019年は、2019年10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) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（３）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。

（４）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。

（５）申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（６）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。

（７）受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

（８）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。

（９）乗換優遇

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

２【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

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

（３）解約制限

ファンドの規模および商品性格などにに基づき、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。

（４）解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

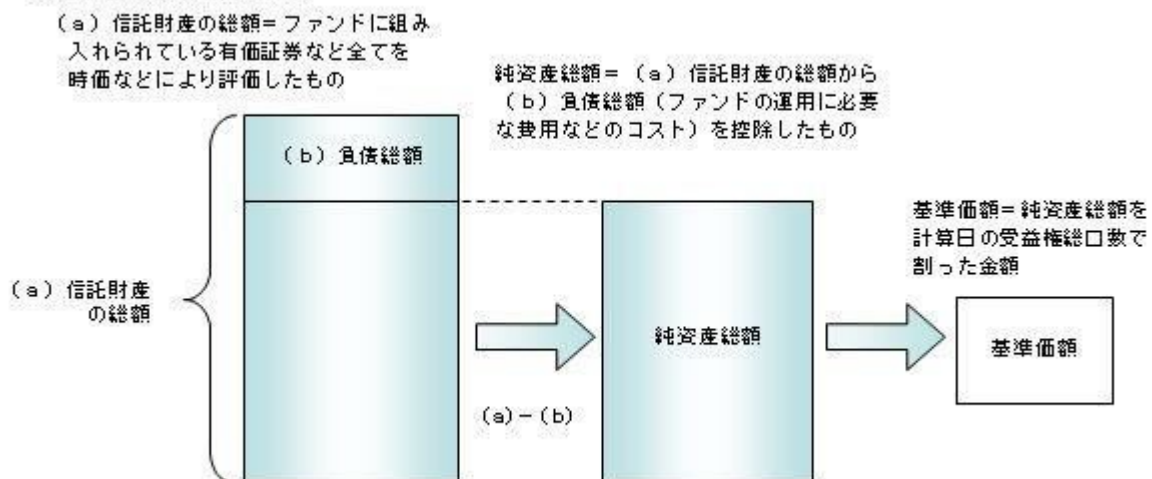
3【資産管理等の概要】

(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（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<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>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

す。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・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】

無期限とします（1999年10月29日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

毎年10月27日から翌年10月26日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

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

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

償還金について

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

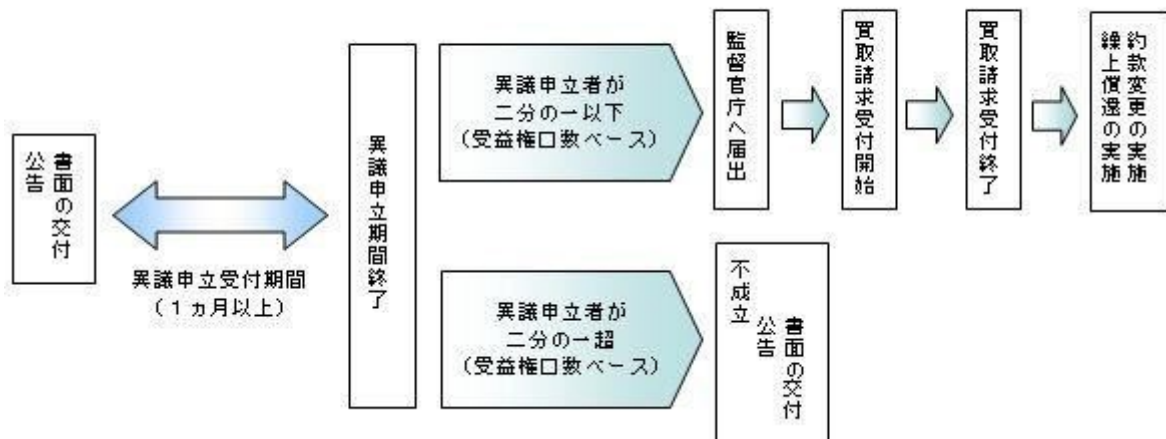
信託約款の変更

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

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満

了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2018年10月27日から2019年10月28日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 2018年10月26日現在	第20期 2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,688,000	-
コール・ローン	15,146,900	21,192,104
親投資信託受益証券	338,193,147	367,498,309
未収入金	-	2,153,162
流動資産合計	357,028,047	390,843,575
資産合計	357,028,047	390,843,575
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	241,607	251,025
未払解約金	-	2,550,316
未払受託者報酬	75,098	83,552
未払委託者報酬	1,071,027	1,191,483
未払利息	23	5
その他未払費用	9,146	8,301
流動負債合計	1,396,901	4,084,682
負債合計	1,396,901	4,084,682
純資産の部		
元本等		
元本	241,607,633	251,025,434
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	114,023,513	135,733,459
(分配準備積立金)	82,657,052	84,496,305
元本等合計	355,631,146	386,758,893
純資産合計	355,631,146	386,758,893
負債純資産合計	357,028,047	390,843,575

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期		第20期	
	自	2017年10月27日	自	2018年10月27日
	至	2018年10月26日	至	2019年10月28日
営業収益				
受取利息		6		10
有価証券売買等損益		7,610,688		20,111,351
営業収益合計		7,610,682		20,111,361
営業費用				
支払利息		7,931		7,543
受託者報酬		144,026		164,054
委託者報酬		2,054,078		2,339,538
その他費用		18,736		17,370
営業費用合計		2,224,771		2,528,505
営業利益又は営業損失()		9,835,453		17,582,856
経常利益又は経常損失()		9,835,453		17,582,856
当期純利益又は当期純損失()		9,835,453		17,582,856
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()		198,959		510,666
期首剰余金又は期首欠損金()		106,313,497		114,023,513
剰余金増加額又は欠損金減少額		30,231,242		13,333,809
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		30,231,242		13,333,809
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,245,207		8,445,028
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,245,207		8,445,028
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		241,607		251,025
期末剰余金又は期末欠損金()		114,023,513		135,733,459

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2018年10月27日から2019年10月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第19期 2018年10月26日現在	第20期 2019年10月28日現在
1.	期首元本額	207,697,181円	241,607,633円
	期中追加設定元本額	57,906,257円	27,380,609円
	期中一部解約元本額	23,995,805円	17,962,808円
2.	受益権の総数	241,607,633口	251,025,434口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2017年10月27日 至 2018年10月26日		第20期 自 2018年10月27日 至 2019年10月28日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	60,744,697円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	82,898,659円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益(A+B+C+D)	143,643,356円	E 分配対象収益(A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	5,945円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	241,607円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第19期 自 2017年10月27日 至 2018年10月26日	第20期 自 2018年10月27日 至 2019年10月28日

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

金融商品の時価等に関する事項

	第19期 2018年10月26日現在	第20期 2019年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第19期(2018年10月26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	8,087,850
合計	8,087,850

第20期（2019年10月28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	18,935,833
合計	18,935,833

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第19期 2018年10月26日現在		第20期 2019年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.4719円	1口当たり純資産額	1.5407円
(1万口当たり純資産額)	(14,719円)	(1万口当たり純資産額)	(15,407円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	7,452,502	19,576,232	
	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	11,011,206	19,454,598	
	日本債券インデックスマザーファンド	120,247,275	172,133,974	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	8,243,513	19,335,159	
	海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド	12,098,418	19,130,018	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	77,144,007	117,868,328	
合計		236,196,921	367,498,309	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	40,005,132	-
コール・ローン	164,304,178	105,155,626
株式	27,555,913,710	32,604,968,140
派生商品評価勘定	-	9,697,520

未収入金	-	117,101
未収配当金	255,425,884	315,854,716
前払金	33,700,000	-
流動資産合計	28,049,348,904	33,035,793,103
資産合計	28,049,348,904	33,035,793,103
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,185,260	-
前受金	-	9,250,000
未払金	149,211,710	-
未払解約金	428,164	51,516,719
未払利息	258	28
流動負債合計	183,825,392	60,766,747
負債合計	183,825,392	60,766,747
純資産の部		
元本等		
元本	19,319,878,842	21,582,031,788
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,545,644,670	11,392,994,568
元本等合計	27,865,523,512	32,975,026,356
純資産合計	27,865,523,512	32,975,026,356
負債純資産合計	28,049,348,904	33,035,793,103

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	18,714,990,799円	19,319,878,842円
	期首からの追加設定元本額	2,763,601,529円	3,992,379,046円

期首からの一部解約元本額	2,158,713,486円	1,730,226,100円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	391,285,298円	574,416,732円
DCインデックスバランス(株式40)	1,131,807,591円	1,483,712,124円
DCインデックスバランス(株式60)	2,170,432,401円	2,874,696,617円
DCインデックスバランス(株式80)	2,306,839,231円	2,939,858,857円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,494,214,984円	1,366,211,327円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,335,407,317円	3,595,775,852円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	3,366,097円	-円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	685,436,046円	739,710,271円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	50,736,936円	51,444,028円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	41,072,726円	42,771,993円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	69,780,983円	77,144,007円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	60,878,867円	61,225,049円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,374,639,542円	4,329,728,922円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	1,164,137円	-円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	1,959,662円	-円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	259,173,263円	285,200,157円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	743,842,894円	817,760,788円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,101,842,051円	1,188,038,465円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,095,998,816円	1,154,336,599円
計	19,319,878,842円	21,582,031,788円
2. 受益権の総数	19,319,878,842口	21,582,031,788口
3. 担保資産		
デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
株式	412,220,000円	424,630,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2017年10月27日 至 2018年10月26日	自 2018年10月27日 至 2019年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年10月26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	2,675,957,690
合計	2,675,957,690

(2019年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,256,428,366
合計	1,256,428,366

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2018年10月26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	338,270,000	-	304,095,000	34,175,000
合計		338,270,000	-	304,095,000	34,175,000

(2019年10月28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	369,100,000	-	378,810,000	9,710,000
合計		369,100,000	-	378,810,000	9,710,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2018年10月26日現在		2019年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.4423円	1口当たり純資産額	1.5279円
(1万口当たり純資産額)	(14,423円)	(1万口当たり純資産額)	(15,279円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	600	2,923.00	1,753,800	
日本水産	18,900	603.00	11,396,700	
マルハニチロ	2,700	2,812.00	7,592,400	
カネコ種苗	600	1,349.00	809,400	
サカタのタネ	2,300	3,485.00	8,015,500	
ホクト	1,600	1,918.00	3,068,800	
ホクリヨウ	300	706.00	211,800	
住石ホールディングス	4,300	140.00	602,000	
日鉄鉱業	400	4,440.00	1,776,000	
三井松島ホールディングス	800	1,265.00	1,012,000	
国際石油開発帝石	75,400	1,006.00	75,852,400	
石油資源開発	2,700	2,792.00	7,538,400	
K&Oエナジーグループ	900	1,526.00	1,373,400	
ヒノキヤグループ	500	2,048.00	1,024,000	

ショーボンドホールディングス	2,700	4,125.00	11,137,500	
ミライト・ホールディングス	5,300	1,708.00	9,052,400	
サンヨーホームズ	300	675.00	202,500	
日本アクア	800	658.00	526,400	
ファーストコーポレーション	600	670.00	402,000	
ベステラ	400	1,247.00	498,800	
スペースバリューホールディングス	2,400	530.00	1,272,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	854.00	341,600	
第一カッター興業	300	1,802.00	540,600	
安藤・間	12,100	831.00	10,055,100	
東急建設	5,500	858.00	4,719,000	
コムシスホールディングス	6,700	3,145.00	21,071,500	
ミサワホーム	1,500	1,156.00	1,734,000	
ピーアールホールディングス	2,100	462.00	970,200	
高松コンストラクショングループ	1,200	2,650.00	3,180,000	
東建コーポレーション	600	7,000.00	4,200,000	
ソネック	200	846.00	169,200	
ヤマウラ	800	913.00	730,400	
大成建設	15,400	4,240.00	65,296,000	
大林組	46,400	1,117.00	51,828,800	
清水建設	47,400	1,020.00	48,348,000	
飛鳥建設	1,400	1,318.00	1,845,200	
長谷工コーポレーション	19,400	1,399.00	27,140,600	
松井建設	1,700	816.00	1,387,200	
銭高組	200	3,900.00	780,000	
鹿島建設	36,300	1,497.00	54,341,100	
不動テトラ	1,100	1,435.00	1,578,500	
大末建設	600	941.00	564,600	
鉄建建設	900	2,878.00	2,590,200	
西松建設	3,400	2,227.00	7,571,800	
三井住友建設	11,300	604.00	6,825,200	
大豊建設	1,000	3,060.00	3,060,000	
前田建設工業	10,900	1,009.00	10,998,100	
ナカノフドー建設	1,300	491.00	638,300	
奥村組	2,500	3,055.00	7,637,500	
東鉄工業	1,900	3,385.00	6,431,500	

イチケン	300	1,723.00	516,900	
富士ピー・エス	700	554.00	387,800	
浅沼組	500	3,980.00	1,990,000	
戸田建設	18,000	676.00	12,168,000	
熊谷組	2,200	3,315.00	7,293,000	
北野建設	300	2,733.00	819,900	
植木組	200	2,555.00	511,000	
矢作建設工業	2,100	726.00	1,524,600	
ピーエス三菱	1,700	747.00	1,269,900	
日本ハウスホールディングス	3,100	524.00	1,624,400	
大東建託	5,500	13,705.00	75,377,500	
新日本建設	1,900	836.00	1,588,400	
N I P P O	4,100	2,184.00	8,954,400	
東亜道路工業	300	3,470.00	1,041,000	
前田道路	4,600	2,332.00	10,727,200	
日本道路	400	6,570.00	2,628,000	
東亜建設工業	1,400	1,468.00	2,055,200	
日本国土開発	2,600	629.00	1,635,400	
若築建設	800	1,627.00	1,301,600	
東洋建設	5,700	481.00	2,741,700	
五洋建設	18,500	661.00	12,228,500	
福田組	500	4,460.00	2,230,000	
住友林業	11,000	1,566.00	17,226,000	
日本基礎技術	1,700	382.00	649,400	
巴コーポレーション	2,000	406.00	812,000	
大和ハウス工業	42,900	3,705.00	158,944,500	
ライト工業	3,000	1,699.00	5,097,000	
積水ハウス	47,400	2,346.50	111,224,100	
日特建設	1,400	695.00	973,000	
北陸電気工事	800	970.00	776,000	
ユアテック	2,500	689.00	1,722,500	
四電工	300	2,779.00	833,700	
中電工	2,000	2,481.00	4,962,000	
関電工	7,100	1,031.00	7,320,100	
きんでん	10,300	1,623.00	16,716,900	
東京エネシス	1,600	919.00	1,470,400	

トーエネック	400	3,490.00	1,396,000	
住友電設	1,100	2,215.00	2,436,500	
日本電設工業	2,600	2,321.00	6,034,600	
協和エクシオ	6,100	2,744.00	16,738,400	
新日本空調	1,200	1,984.00	2,380,800	
九電工	3,000	3,645.00	10,935,000	
三機工業	3,400	1,301.00	4,423,400	
日揮ホールディングス	13,400	1,610.00	21,574,000	
中外炉工業	500	1,661.00	830,500	
ヤマト	1,400	763.00	1,068,200	
太平電業	1,000	2,450.00	2,450,000	
高砂熱学工業	3,800	1,934.00	7,349,200	
三晃金属工業	200	2,523.00	504,600	
朝日工業社	300	3,015.00	904,500	
明星工業	2,800	851.00	2,382,800	
大気社	2,100	3,480.00	7,308,000	
ダイダン	1,000	2,411.00	2,411,000	
日比谷総合設備	1,400	1,943.00	2,720,200	
東芝プラントシステム	3,300	2,120.00	6,996,000	
OSJBホールディングス	7,000	258.00	1,806,000	
東洋エンジニアリング	1,900	704.00	1,337,600	
レイズネクスト	2,800	1,082.00	3,029,600	
日本製粉	4,400	1,721.00	7,572,400	
日清製粉グループ本社	15,700	2,057.00	32,294,900	
日東富士製粉	100	6,320.00	632,000	
昭和産業	1,300	3,170.00	4,121,000	
鳥越製粉	1,200	916.00	1,099,200	
中部飼料	1,700	1,238.00	2,104,600	
フィード・ワン	9,200	165.00	1,518,000	
東洋精糖	200	1,083.00	216,600	
日本甜菜製糖	800	1,987.00	1,589,600	
三井製糖	1,100	2,327.00	2,559,700	
塩水港精糖	1,700	209.00	355,300	
日新製糖	600	1,943.00	1,165,800	
森永製菓	3,500	5,210.00	18,235,000	
中村屋	400	4,640.00	1,856,000	

江崎グリコ	4,100	4,910.00	20,131,000	
名糖産業	700	1,277.00	893,900	
井村屋グループ	600	2,033.00	1,219,800	
不二家	800	2,100.00	1,680,000	
山崎製パン	10,400	1,909.00	19,853,600	
第一屋製パン	300	975.00	292,500	
モロゾフ	200	5,040.00	1,008,000	
亀田製菓	900	4,795.00	4,315,500	
寿スピリッツ	1,500	7,240.00	10,860,000	
カルビー	6,300	3,360.00	21,168,000	
森永乳業	2,800	4,230.00	11,844,000	
六甲バター	900	1,806.00	1,625,400	
ヤクルト本社	10,300	6,050.00	62,315,000	
明治ホールディングス	9,800	7,800.00	76,440,000	
雪印メグミルク	3,300	2,548.00	8,408,400	
プリマハム	1,900	2,568.00	4,879,200	
日本ハム	5,700	4,605.00	26,248,500	
林兼産業	500	619.00	309,500	
丸大食品	1,500	2,313.00	3,469,500	
S Foods	1,200	2,905.00	3,486,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,800	695.00	6,116,000	
サッポロホールディングス	4,800	2,733.00	13,118,400	
アサヒグループホールディングス	29,100	5,400.00	157,140,000	
キリンホールディングス	58,900	2,286.00	134,645,400	
宝ホールディングス	10,400	1,075.00	11,180,000	
オエノンホールディングス	3,700	406.00	1,502,200	
養命酒製造	400	1,954.00	781,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,800	2,494.00	24,441,200	
サントリー食品インターナショナル	9,300	4,675.00	43,477,500	
ダイドーグループホールディングス	800	4,490.00	3,592,000	
伊藤園	4,200	5,290.00	22,218,000	
キーコーヒー	1,400	2,292.00	3,208,800	
ユニカフェ	400	1,016.00	406,400	
ジャパンフーズ	200	1,200.00	240,000	
日清オイリオグループ	1,800	3,635.00	6,543,000	

不二製油グループ本社	3,400	3,205.00	10,897,000	
J - オイルミルズ	700	4,310.00	3,017,000	
キッコーマン	9,100	5,070.00	46,137,000	
味の素	30,600	2,019.50	61,796,700	
キュービー	7,700	2,409.00	18,549,300	
ハウス食品グループ本社	5,200	4,060.00	21,112,000	
カゴメ	5,300	2,711.00	14,368,300	
焼津水産化学工業	700	1,047.00	732,900	
アリアケジャパン	1,300	8,210.00	10,673,000	
ピエトロ	200	1,609.00	321,800	
エバラ食品工業	300	2,138.00	641,400	
やまみ	100	2,013.00	201,300	
ニチレイ	7,200	2,435.00	17,532,000	
東洋水産	7,200	4,405.00	31,716,000	
イトアンド	500	1,740.00	870,000	
大冷	200	2,024.00	404,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	1,007.00	402,800	
日清食品ホールディングス	5,900	8,130.00	47,967,000	
永谷園ホールディングス	700	2,120.00	1,484,000	
一正蒲鉾	500	1,072.00	536,000	
フジッコ	1,500	1,941.00	2,911,500	
ロック・フィールド	1,500	1,466.00	2,199,000	
日本たばこ産業	80,100	2,441.00	195,524,100	
ケンコーマヨネーズ	800	2,501.00	2,000,800	
わらべや日洋ホールディングス	900	1,882.00	1,693,800	
なとり	800	1,644.00	1,315,200	
イフジ産業	200	752.00	150,400	
ピックルスコーポレーション	300	2,559.00	767,700	
北の達人コーポレーション	5,500	643.00	3,536,500	
ユーグレナ	6,000	891.00	5,346,000	
ミヨシ油脂	500	1,206.00	603,000	
理研ビタミン	600	3,715.00	2,229,000	
片倉工業	2,000	1,363.00	2,726,000	
ゲンゼ	900	4,630.00	4,167,000	
東洋紡	5,800	1,464.00	8,491,200	
ユニチカ	4,100	343.00	1,406,300	

富士紡ホールディングス	700	3,175.00	2,222,500
倉敷紡績	1,300	2,477.00	3,220,100
シキボウ	700	919.00	643,300
日本毛織	4,400	1,066.00	4,690,400
ダイトウボウ	3,100	84.00	260,400
トーア紡コーポレーション	600	546.00	327,600
ダイドーリミテッド	1,700	282.00	479,400
帝国繊維	1,500	1,974.00	2,961,000
帝人	11,000	2,182.00	24,002,000
東レ	105,000	796.60	83,643,000
サカイオーベックス	300	1,843.00	552,900
住江織物	400	2,793.00	1,117,200
日本フェルト	800	486.00	388,800
イチカワ	200	1,537.00	307,400
日東製網	200	1,602.00	320,400
アツギ	1,100	821.00	903,100
ダイニック	500	768.00	384,000
セーレン	3,400	1,310.00	4,454,000
ソトー	500	975.00	487,500
東海染工	200	1,139.00	227,800
小松マテーレ	2,200	841.00	1,850,200
ワコールホールディングス	3,800	2,814.00	10,693,200
ホギメディカル	1,700	3,500.00	5,950,000
レナウン	4,400	115.00	506,000
クラウドディアホールディングス	400	491.00	196,400
T S Iホールディングス	5,000	559.00	2,795,000
マツオカコーポレーション	400	2,004.00	801,600
ワールド	1,800	2,481.00	4,465,800
三陽商会	700	1,526.00	1,068,200
ナイガイ	500	471.00	235,500
オンワードホールディングス	8,100	624.00	5,054,400
ルックホールディングス	500	1,141.00	570,500
キムラタン	7,600	34.00	258,400
ゴールドウイン	2,400	8,080.00	19,392,000
デサント	3,300	1,422.00	4,692,600
キング	700	529.00	370,300

ヤマトインターナショナル	900	390.00	351,000	
特種東海製紙	900	3,960.00	3,564,000	
王子ホールディングス	60,900	571.00	34,773,900	
日本製紙	6,500	1,860.00	12,090,000	
三菱製紙	2,200	470.00	1,034,000	
北越コーポレーション	8,900	554.00	4,930,600	
中越パルプ工業	600	1,651.00	990,600	
巴川製紙所	500	959.00	479,500	
大王製紙	6,600	1,447.00	9,550,200	
阿波製紙	400	403.00	161,200	
レンゴー	14,000	780.00	10,920,000	
トモク	800	1,610.00	1,288,000	
ザ・バック	1,000	3,875.00	3,875,000	
クラレ	21,300	1,326.00	28,243,800	
旭化成	96,300	1,196.00	115,174,800	
共和レザー	900	742.00	667,800	
昭和電工	9,700	3,065.00	29,730,500	
住友化学	106,500	497.00	52,930,500	
住友精化	700	3,295.00	2,306,500	
日産化学	8,200	4,370.00	35,834,000	
ラサ工業	500	1,464.00	732,000	
クレハ	1,300	6,860.00	8,918,000	
多木化学	400	4,440.00	1,776,000	
テイカ	1,100	2,109.00	2,319,900	
石原産業	2,600	1,137.00	2,956,200	
片倉コープアグリ	400	1,183.00	473,200	
日本曹達	2,100	2,852.00	5,989,200	
東ソー	20,900	1,526.00	31,893,400	
トクヤマ	3,900	2,944.00	11,481,600	
セントラル硝子	3,000	2,533.00	7,599,000	
東亜合成	8,500	1,227.00	10,429,500	
大阪ソーダ	1,500	2,976.00	4,464,000	
関東電化工業	3,300	970.00	3,201,000	
デンカ	5,300	3,135.00	16,615,500	
信越化学工業	23,900	11,855.00	283,334,500	
日本カーバイド工業	500	1,440.00	720,000	

堺化学工業	900	2,640.00	2,376,000
第一稀元素化学工業	1,500	837.00	1,255,500
エア・ウォーター	11,100	2,010.00	22,311,000
大陽日酸	11,200	2,462.00	27,574,400
日本化学工業	500	3,320.00	1,660,000
東邦アセチレン	200	1,347.00	269,400
日本パーカラライジング	7,400	1,234.00	9,131,600
高压ガス工業	2,100	836.00	1,755,600
四国化成工業	2,300	1,212.00	2,787,600
戸田工業	300	2,253.00	675,900
ステラ ケミファ	800	3,195.00	2,556,000
保土谷化学工業	500	4,090.00	2,045,000
日本触媒	2,300	6,700.00	15,410,000
大日精化工業	1,100	3,355.00	3,690,500
カネカ	3,500	3,610.00	12,635,000
三菱瓦斯化学	13,800	1,516.00	20,920,800
三井化学	12,300	2,581.00	31,746,300
J S R	13,600	1,893.00	25,744,800
東京応化工業	2,300	4,315.00	9,924,500
大阪有機化学工業	1,200	1,146.00	1,375,200
三菱ケミカルホールディングス	90,400	823.90	74,480,560
K Hネオケム	2,400	2,662.00	6,388,800
ダイセル	20,000	960.00	19,200,000
住友ベークライト	2,300	4,480.00	10,304,000
積水化学工業	29,100	1,772.00	51,565,200
日本ゼオン	12,200	1,370.00	16,714,000
アイカ工業	4,100	3,500.00	14,350,000
宇部興産	6,800	2,308.00	15,694,400
積水樹脂	2,200	2,250.00	4,950,000
タキロンシーアイ	2,900	637.00	1,847,300
旭有機材	900	1,463.00	1,316,700
日立化成	6,300	3,515.00	22,144,500
ニチバン	700	1,807.00	1,264,900
リケンテクノス	3,700	484.00	1,790,800
大倉工業	600	1,913.00	1,147,800
積水化成成品工業	2,000	769.00	1,538,000

群栄化学工業	300	2,393.00	717,900	
タイガースポリマー	700	621.00	434,700	
ミライアル	400	1,560.00	624,000	
ダイキアクシス	500	920.00	460,000	
ダイキョーニシカワ	2,900	811.00	2,351,900	
竹本容器	500	999.00	499,500	
森六ホールディングス	700	2,370.00	1,659,000	
日本化薬	8,400	1,335.00	11,214,000	
カーリットホールディングス	1,500	658.00	987,000	
日本精化	1,100	1,200.00	1,320,000	
扶桑化学工業	1,400	2,837.00	3,971,800	
トリケミカル研究所	300	7,240.00	2,172,000	
A D E K A	6,700	1,532.00	10,264,400	
日油	5,100	3,645.00	18,589,500	
新日本理化	2,600	200.00	520,000	
ハリマ化成グループ	1,100	1,244.00	1,368,400	
花王	33,100	8,340.00	276,054,000	
第一工業製薬	500	3,570.00	1,785,000	
石原ケミカル	300	1,662.00	498,600	
日華化学	500	870.00	435,000	
ニイタカ	200	1,677.00	335,400	
三洋化成工業	900	5,220.00	4,698,000	
有機合成薬品工業	1,200	242.00	290,400	
大日本塗料	1,500	1,089.00	1,633,500	
日本ペイントホールディングス	11,200	6,000.00	67,200,000	
関西ペイント	15,200	2,629.00	39,960,800	
神東塗料	1,200	192.00	230,400	
中国塗料	4,500	962.00	4,329,000	
日本特殊塗料	1,000	1,166.00	1,166,000	
藤倉化成	1,800	540.00	972,000	
太陽ホールディングス	1,100	3,840.00	4,224,000	
D I C	5,700	3,145.00	17,926,500	
サカタインクス	3,000	1,244.00	3,732,000	
東洋インキ S C ホールディングス	2,900	2,668.00	7,737,200	
T & K T O K A	1,000	1,010.00	1,010,000	
富士フイルムホールディングス	28,700	4,787.00	137,386,900	

資生堂	27,500	8,610.00	236,775,000
ライオン	18,000	2,198.00	39,564,000
高砂香料工業	1,000	2,633.00	2,633,000
マンダム	3,100	2,802.00	8,686,200
ミルボン	1,800	5,500.00	9,900,000
ファンケル	6,200	2,812.00	17,434,400
コーセー	2,300	18,380.00	42,274,000
コタ	700	1,309.00	916,300
ポーラ・オルビスホールディングス	5,900	2,595.00	15,310,500
ノエビアホールディングス	1,300	5,730.00	7,449,000
アジュバンコスメジャパン	300	944.00	283,200
エステー	1,000	1,540.00	1,540,000
アグロ カネショウ	400	1,499.00	599,600
コニシ	2,400	1,503.00	3,607,200
長谷川香料	1,800	2,019.00	3,634,200
星光PMC	800	824.00	659,200
小林製薬	3,900	8,660.00	33,774,000
荒川化学工業	1,200	1,562.00	1,874,400
メック	1,000	1,832.00	1,832,000
日本高純度化学	400	2,589.00	1,035,600
タカラバイオ	3,600	2,204.00	7,934,400
JCU	1,800	2,622.00	4,719,600
新田ゼラチン	900	696.00	626,400
OATアグリオ	300	1,655.00	496,500
デクセリアルズ	3,600	841.00	3,027,600
アース製薬	1,000	5,670.00	5,670,000
北興化学工業	1,400	577.00	807,800
大成ラミック	400	2,914.00	1,165,600
クミアイ化学工業	5,700	985.00	5,614,500
日本農薬	2,500	564.00	1,410,000
アキレス	900	1,771.00	1,593,900
有沢製作所	2,200	1,113.00	2,448,600
日東電工	9,500	5,744.00	54,568,000
レック	1,500	1,071.00	1,606,500
三光合成	1,600	404.00	646,400
きもと	2,900	175.00	507,500

藤森工業	1,300	3,710.00	4,823,000	
前澤化成工業	1,000	1,137.00	1,137,000	
未来工業	700	2,135.00	1,494,500	
ウェーブロックホールディングス	400	850.00	340,000	
J S P	800	1,868.00	1,494,400	
エフピコ	1,500	6,610.00	9,915,000	
天馬	900	1,965.00	1,768,500	
信越ポリマー	2,500	959.00	2,397,500	
東リ	3,500	295.00	1,032,500	
ニフコ	5,500	2,691.00	14,800,500	
バルカー	1,100	2,494.00	2,743,400	
ユニ・チャーム	26,600	3,608.00	95,972,800	
ショーエイコーポレーション	100	739.00	73,900	
協和キリン	13,900	2,055.00	28,564,500	
武田薬品工業	120,700	3,824.00	461,556,800	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	121,600	1,770.50	215,292,800	
大日本住友製薬	10,200	1,812.00	18,482,400	
塩野義製薬	17,700	6,297.00	111,456,900	
田辺三菱製薬	14,500	1,295.00	18,777,500	
わかもと製薬	1,800	279.00	502,200	
あすか製薬	1,700	1,217.00	2,068,900	
日本新薬	3,600	9,460.00	34,056,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,228.00	445,600	
中外製薬	14,400	8,970.00	129,168,000	
科研製薬	2,400	5,310.00	12,744,000	
エーザイ	16,500	8,164.00	134,706,000	
ロート製薬	7,100	3,235.00	22,968,500	
小野薬品工業	32,600	1,990.00	64,874,000	
久光製薬	4,100	5,030.00	20,623,000	
持田製薬	2,100	4,225.00	8,872,500	
参天製薬	25,700	1,884.00	48,418,800	
扶桑薬品工業	500	2,120.00	1,060,000	
日本ケミファ	200	3,200.00	640,000	
ツムラ	4,300	3,005.00	12,921,500	
日医工	3,600	1,272.00	4,579,200	

キッセイ薬品工業	2,400	2,804.00	6,729,600
生化学工業	2,700	1,228.00	3,315,600
栄研化学	2,500	1,729.00	4,322,500
日水製薬	600	1,310.00	786,000
鳥居薬品	900	2,818.00	2,536,200
J C R ファーマ	1,000	8,470.00	8,470,000
東和薬品	2,000	2,663.00	5,326,000
富士製薬工業	900	1,395.00	1,255,500
沢井製薬	2,800	6,020.00	16,856,000
ゼリア新薬工業	2,800	1,991.00	5,574,800
第一三共	39,600	6,899.00	273,200,400
キョーリン製薬ホールディングス	3,100	1,897.00	5,880,700
大幸薬品	600	2,846.00	1,707,600
ダイト	800	3,310.00	2,648,000
大塚ホールディングス	26,300	4,563.00	120,006,900
大正製薬ホールディングス	2,900	7,820.00	22,678,000
ペプチドリーム	7,000	5,320.00	37,240,000
日本コークス工業	11,500	84.00	966,000
ニチレキ	1,800	1,182.00	2,127,600
ユシロ化学工業	700	1,446.00	1,012,200
ビーピー・カストロール	500	1,466.00	733,000
富士石油	3,500	260.00	910,000
MORESCO	500	1,331.00	665,500
出光興産	16,000	3,205.00	51,280,000
J X T Gホールディングス	228,700	511.80	117,048,660
コスモエネルギーホールディングス	4,000	2,356.00	9,424,000
横浜ゴム	8,000	2,411.00	19,288,000
TOYO TIRE	8,000	1,512.00	12,096,000
ブリヂストン	42,500	4,521.00	192,142,500
住友ゴム工業	12,500	1,431.00	17,887,500
藤倉コンポジット	1,300	432.00	561,600
オカモト	900	3,965.00	3,568,500
フコク	700	709.00	496,300
ニッタ	1,500	3,045.00	4,567,500
住友理工	2,700	944.00	2,548,800
三ツ星ベルト	1,800	2,055.00	3,699,000

バンドー化学	2,600	906.00	2,355,600	
日東紡績	2,100	3,230.00	6,783,000	
A G C	13,700	3,610.00	49,457,000	
日本板硝子	6,700	683.00	4,576,100	
石塚硝子	200	2,043.00	408,600	
日本山村硝子	600	1,265.00	759,000	
日本電気硝子	5,600	2,442.00	13,675,200	
オハラ	500	1,521.00	760,500	
住友大阪セメント	2,800	4,845.00	13,566,000	
太平洋セメント	8,700	3,120.00	27,144,000	
日本ヒューム	1,400	818.00	1,145,200	
日本コンクリート工業	3,000	312.00	936,000	
三谷セキサン	600	3,390.00	2,034,000	
アジアパイルホールディングス	2,000	560.00	1,120,000	
東海カーボン	14,500	1,119.00	16,225,500	
日本カーボン	700	4,260.00	2,982,000	
東洋炭素	800	2,548.00	2,038,400	
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,770.00	3,816,000	
T O T O	10,600	4,365.00	46,269,000	
日本碍子	16,900	1,632.00	27,580,800	
日本特殊陶業	11,700	2,118.00	24,780,600	
ダントーホールディングス	1,400	112.00	156,800	
M A R U W A	500	7,510.00	3,755,000	
品川リフラクトリーズ	300	2,863.00	858,900	
黒崎播磨	300	5,870.00	1,761,000	
ヨータイ	1,200	733.00	879,600	
イソライト工業	700	549.00	384,300	
東京窯業	1,700	308.00	523,600	
ニッカトー	600	802.00	481,200	
フジミインコーポレーテッド	1,200	2,839.00	3,406,800	
クニミネ工業	600	949.00	569,400	
エーアンドエーマテリアル	300	1,087.00	326,100	
ニチアス	3,800	2,265.00	8,607,000	
ニチハ	1,900	3,105.00	5,899,500	
日本製鉄	63,500	1,566.00	99,441,000	
神戸製鋼所	25,200	592.00	14,918,400	

合同製鐵	700	2,361.00	1,652,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	36,900	1,362.50	50,276,250
東京製鐵	7,400	876.00	6,482,400
共英製鋼	1,500	2,050.00	3,075,000
大和工業	2,900	2,847.00	8,256,300
東京鐵鋼	600	1,580.00	948,000
大阪製鐵	900	1,418.00	1,276,200
淀川製鋼所	1,900	2,087.00	3,965,300
丸一鋼管	4,900	2,958.00	14,494,200
モリ工業	400	2,139.00	855,600
大同特殊鋼	2,200	4,740.00	10,428,000
日本高周波鋼業	600	416.00	249,600
日本冶金工業	1,100	2,449.00	2,693,900
山陽特殊製鋼	1,700	1,505.00	2,558,500
愛知製鋼	800	3,445.00	2,756,000
日立金属	14,700	1,265.00	18,595,500
日本金属	300	911.00	273,300
大平洋金属	900	2,659.00	2,393,100
新日本電工	9,000	192.00	1,728,000
栗本鐵工所	700	1,710.00	1,197,000
虹技	200	1,479.00	295,800
日本鑄鉄管	200	1,297.00	259,400
三菱製鋼	1,000	1,165.00	1,165,000
日亜鋼業	2,100	326.00	684,600
日本精線	200	2,700.00	540,000
エンビプロ・ホールディングス	600	680.00	408,000
シンニッタン	2,100	422.00	886,200
新家工業	300	1,555.00	466,500
大紀アルミニウム工業所	2,300	730.00	1,679,000
日本軽金属ホールディングス	37,200	213.00	7,923,600
三井金属鉱業	3,700	3,090.00	11,433,000
東邦亜鉛	800	2,183.00	1,746,400
三菱マテリアル	9,000	3,105.00	27,945,000
住友金属鉱山	18,700	3,606.00	67,432,200
DOWAホールディングス	3,200	3,785.00	12,112,000
古河機械金属	2,300	1,567.00	3,604,100

エス・サイエンス	7,100	52.00	369,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	1,732.00	2,771,200
東邦チタニウム	2,500	903.00	2,257,500
U A C J	2,100	1,981.00	4,160,100
C Kサンエツ	200	2,966.00	593,200
古河電気工業	4,000	3,025.00	12,100,000
住友電気工業	51,100	1,479.50	75,602,450
フジクラ	16,600	490.00	8,134,000
昭和電線ホールディングス	1,600	942.00	1,507,200
タツタ電線	2,700	529.00	1,428,300
カナレ電気	200	1,882.00	376,400
平河ヒューテック	500	1,131.00	565,500
リョービ	1,700	1,959.00	3,330,300
アーレスティ	1,700	537.00	912,900
アサヒホールディングス	2,600	2,321.00	6,034,600
稲葉製作所	800	1,434.00	1,147,200
宮地エンジニアリンググループ	400	1,955.00	782,000
トーカロ	3,600	1,090.00	3,924,000
アルファC o	500	1,281.00	640,500
S U M C O	16,400	1,917.00	31,438,800
川田テクノロジーズ	300	6,760.00	2,028,000
R S Technologies	400	4,560.00	1,824,000
信和	700	961.00	672,700
東洋製罐グループホールディングス	8,700	1,750.00	15,225,000
ホッカンホールディングス	700	1,810.00	1,267,000
コロナ	700	1,153.00	807,100
横河ブリッジホールディングス	2,600	1,896.00	4,929,600
駒井ハルテック	300	1,689.00	506,700
高田機工	100	2,570.00	257,000
三和ホールディングス	14,200	1,269.00	18,019,800
文化シャッター	4,000	935.00	3,740,000
三協立山	1,900	1,192.00	2,264,800
アルインコ	1,100	1,166.00	1,282,600
東洋シャッター	400	790.00	316,000
L I X I Lグループ	20,200	2,039.00	41,187,800
日本ファイルコン	1,000	509.00	509,000

ノーリツ	2,900	1,344.00	3,897,600	
長府製作所	1,400	2,493.00	3,490,200	
リンナイ	2,400	7,790.00	18,696,000	
ダイニチ工業	700	677.00	473,900	
日東精工	1,900	593.00	1,126,700	
三洋工業	200	1,990.00	398,000	
岡部	2,800	897.00	2,511,600	
ジーテクト	1,500	1,795.00	2,692,500	
東ブレ	2,600	1,831.00	4,760,600	
高周波熱錬	2,600	955.00	2,483,000	
東京製綱	900	1,118.00	1,006,200	
サンコール	700	472.00	330,400	
モリテック スチール	1,100	370.00	407,000	
パイオラックス	2,200	2,031.00	4,468,200	
エイチワン	1,300	694.00	902,200	
日本発條	13,600	885.00	12,036,000	
中央発條	100	2,838.00	283,800	
アドバネクス	200	1,622.00	324,400	
立川ブラインド工業	600	1,385.00	831,000	
三益半導体工業	1,200	2,164.00	2,596,800	
日本ドライケミカル	300	1,211.00	363,300	
日本製鋼所	4,200	2,363.00	9,924,600	
三浦工業	5,900	3,280.00	19,352,000	
タクマ	5,000	1,256.00	6,280,000	
ツガミ	3,100	1,020.00	3,162,000	
オークマ	1,700	6,480.00	11,016,000	
東芝機械	1,600	2,397.00	3,835,200	
アマダホールディングス	20,600	1,228.00	25,296,800	
アイダエンジニアリング	3,700	920.00	3,404,000	
滝澤鉄工所	400	1,311.00	524,400	
F U J I	5,500	1,790.00	9,845,000	
牧野フライス製作所	1,600	5,340.00	8,544,000	
オーエスジー	6,300	2,293.00	14,445,900	
ダイジェット工業	100	1,584.00	158,400	
旭ダイヤモンド工業	3,700	684.00	2,530,800	
D M G 森精機	8,700	1,806.00	15,712,200	

ソディック	3,200	913.00	2,921,600
ディスコ	1,800	25,140.00	45,252,000
日東工器	700	2,277.00	1,593,900
日進工具	400	2,092.00	836,800
パンチ工業	1,000	552.00	552,000
富士ダイス	600	655.00	393,000
豊和工業	800	747.00	597,600
OKK	600	719.00	431,400
東洋機械金属	1,000	574.00	574,000
津田駒工業	300	1,267.00	380,100
島精機製作所	1,900	2,692.00	5,114,800
オプトラン	1,500	3,315.00	4,972,500
NCホールディングス	500	491.00	245,500
イワキポンプ	600	1,049.00	629,400
フリュー	1,100	973.00	1,070,300
ヤマシンフィルタ	2,400	879.00	2,109,600
日阪製作所	1,700	932.00	1,584,400
やまびこ	2,700	1,214.00	3,277,800
平田機工	600	7,980.00	4,788,000
ペガサスマシン製造	1,300	541.00	703,300
マルマエ	500	1,135.00	567,500
タツモ	600	1,396.00	837,600
ナブテスコ	8,100	3,550.00	28,755,000
三井海洋開発	1,500	2,873.00	4,309,500
レオン自動機	1,300	1,633.00	2,122,900
SMC	4,000	46,210.00	184,840,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,100	618.00	679,800
ホソカワミクロン	500	3,950.00	1,975,000
ユニオンツール	500	3,490.00	1,745,000
オイレス工業	1,900	1,632.00	3,100,800
日精エー・エス・ビー機械	500	3,880.00	1,940,000
サトーホールディングス	1,700	3,060.00	5,202,000
技研製作所	1,200	3,915.00	4,698,000
日本エアータック	400	645.00	258,000
カワタ	400	1,134.00	453,600

日精樹脂工業	1,100	1,081.00	1,189,100	
オカダアイヨン	500	1,314.00	657,000	
ワイエイシイホールディングス	500	893.00	446,500	
小松製作所	62,600	2,586.00	161,883,600	
住友重機械工業	7,900	3,435.00	27,136,500	
日立建機	5,500	2,709.00	14,899,500	
日工	1,900	660.00	1,254,000	
巴工業	600	2,363.00	1,417,800	
井関農機	1,400	1,610.00	2,254,000	
TOWA	1,200	1,097.00	1,316,400	
丸山製作所	300	1,241.00	372,300	
北川鉄工所	600	2,056.00	1,233,600	
ローツェ	600	3,830.00	2,298,000	
タカキタ	500	552.00	276,000	
クボタ	74,000	1,769.50	130,943,000	
荏原実業	300	2,140.00	642,000	
三菱化工機	500	1,835.00	917,500	
月島機械	2,700	1,616.00	4,363,200	
帝国電機製作所	1,000	1,286.00	1,286,000	
新東工業	3,300	1,030.00	3,399,000	
澁谷工業	1,200	2,872.00	3,446,400	
アイチ コーポレーション	2,300	729.00	1,676,700	
小森コーポレーション	3,500	1,244.00	4,354,000	
鶴見製作所	1,100	2,070.00	2,277,000	
住友精密工業	200	3,215.00	643,000	
酒井重工業	200	2,876.00	575,200	
荏原製作所	6,100	3,325.00	20,282,500	
石井鐵工所	200	2,515.00	503,000	
西島製作所	1,400	1,030.00	1,442,000	
北越工業	1,400	1,253.00	1,754,200	
ダイキン工業	18,900	15,230.00	287,847,000	
オルガノ	500	5,970.00	2,985,000	
トーヨーカネツ	500	2,038.00	1,019,000	
栗田工業	7,500	3,070.00	23,025,000	
椿本チエイン	1,800	3,660.00	6,588,000	
大同工業	600	859.00	515,400	

木村化工機	1,100	394.00	433,400
アネスト岩田	2,100	1,037.00	2,177,700
ダイフク	7,600	5,870.00	44,612,000
サムコ	400	1,150.00	460,000
加藤製作所	700	2,057.00	1,439,900
油研工業	200	1,698.00	339,600
タダノ	6,700	1,131.00	7,577,700
フジテック	5,000	1,536.00	7,680,000
C K D	3,900	1,615.00	6,298,500
キトー	1,100	1,662.00	1,828,200
平和	3,900	2,241.00	8,739,900
理想科学工業	1,300	1,707.00	2,219,100
S A N K Y O	3,500	3,795.00	13,282,500
日本金銭機械	1,600	947.00	1,515,200
マースグループホールディングス	900	1,984.00	1,785,600
福島工業	800	3,340.00	2,672,000
オーイズミ	600	512.00	307,200
ダイコク電機	600	1,496.00	897,600
竹内製作所	2,300	1,723.00	3,962,900
アマノ	4,000	3,120.00	12,480,000
J U K I	1,900	978.00	1,858,200
サンデンホールディングス	1,800	703.00	1,265,400
蛇の目ミシン工業	1,200	418.00	501,600
マックス	2,100	1,966.00	4,128,600
グローリー	3,900	3,195.00	12,460,500
新晃工業	1,300	1,804.00	2,345,200
大和冷機工業	2,000	1,215.00	2,430,000
セガサミーホールディングス	13,700	1,572.00	21,536,400
日本ピストンリング	500	1,342.00	671,000
リケン	600	3,995.00	2,397,000
T P R	1,900	1,879.00	3,570,100
ツバキ・ナカシマ	2,800	1,829.00	5,121,200
ホシザキ	4,000	9,040.00	36,160,000
大豊工業	1,100	817.00	898,700
日本精工	28,400	1,019.00	28,939,600
N T N	30,000	340.00	10,200,000

ジェイテクト	13,300	1,333.00	17,728,900	
不二越	1,300	5,280.00	6,864,000	
日本トムソン	4,200	482.00	2,024,400	
T H K	8,100	3,155.00	25,555,500	
ユーシン精機	1,100	1,022.00	1,124,200	
前澤給装工業	500	2,070.00	1,035,000	
イーグル工業	1,700	1,056.00	1,795,200	
前澤工業	900	381.00	342,900	
日本ピラー工業	1,400	1,468.00	2,055,200	
キッツ	5,600	736.00	4,121,600	
マキタ	16,800	3,520.00	59,136,000	
日立造船	11,100	356.00	3,951,600	
三菱重工業	23,200	4,416.00	102,451,200	
I H I	10,700	2,741.00	29,328,700	
スター精密	2,200	1,667.00	3,667,400	
日清紡ホールディングス	9,300	900.00	8,370,000	
イビデン	8,500	2,479.00	21,071,500	
コニカミノルタ	30,300	807.00	24,452,100	
ブラザー工業	18,000	2,036.00	36,648,000	
ミネベアミツミ	25,700	2,055.00	52,813,500	
日立製作所	62,200	4,194.00	260,866,800	
三菱電機	138,200	1,552.00	214,486,400	
富士電機	9,000	3,435.00	30,915,000	
東洋電機製造	500	1,614.00	807,000	
安川電機	16,000	4,235.00	67,760,000	
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,340.00	2,546,000	
明電舎	2,700	2,136.00	5,767,200	
オリジン	400	1,481.00	592,400	
山洋電気	700	5,300.00	3,710,000	
デンヨー	1,300	1,811.00	2,354,300	
東芝テック	1,800	3,830.00	6,894,000	
芝浦メカトロニクス	200	3,730.00	746,000	
マブチモーター	3,800	4,150.00	15,770,000	
日本電産	16,600	15,960.00	264,936,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	539.00	431,200	
トレックス・セミコンダクター	600	1,470.00	882,000	

東光高岳	700	1,223.00	856,100
ダブル・スコープ	1,900	607.00	1,153,300
ダイヘン	1,500	3,500.00	5,250,000
ヤーマン	2,000	701.00	1,402,000
JVCケンウッド	10,800	311.00	3,358,800
ミマキエンジニアリング	1,300	552.00	717,600
第一精工	500	2,618.00	1,309,000
日新電機	3,200	1,429.00	4,572,800
大崎電気工業	2,800	753.00	2,108,400
オムロン	14,700	6,610.00	97,167,000
日東工業	2,200	2,162.00	4,756,400
I D E C	1,800	2,235.00	4,023,000
正興電機製作所	300	805.00	241,500
不二電機工業	100	1,234.00	123,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,000	1,926.00	9,630,000
サクサホールディングス	300	1,846.00	553,800
メルコホールディングス	600	2,781.00	1,668,600
テクノメディカ	300	2,156.00	646,800
日本電気	17,900	4,555.00	81,534,500
富士通	13,300	8,990.00	119,567,000
沖電気工業	6,000	1,446.00	8,676,000
岩崎通信機	600	782.00	469,200
電気興業	700	3,335.00	2,334,500
サンケン電気	1,600	2,604.00	4,166,400
ナカヨ	200	1,604.00	320,800
アイホン	800	1,800.00	1,440,000
ルネサスエレクトロニクス	65,900	726.00	47,843,400
セイコーエプソン	17,200	1,536.00	26,419,200
ワコム	10,100	412.00	4,161,200
アルバック	2,800	4,915.00	13,762,000
アクセル	600	625.00	375,000
E I Z O	1,300	4,060.00	5,278,000
日本信号	3,500	1,227.00	4,294,500
京三製作所	3,000	507.00	1,521,000
能美防災	1,800	2,093.00	3,767,400
ホーチキ	900	1,469.00	1,322,100

星和電機	800	541.00	432,800
エレコム	1,300	4,095.00	5,323,500
パナソニック	158,000	912.00	144,096,000
シャープ	13,800	1,251.00	17,263,800
アンリツ	8,900	2,196.00	19,544,400
富士通ゼネラル	4,300	1,946.00	8,367,800
ソニー	92,800	6,370.00	591,136,000
T D K	7,200	11,120.00	80,064,000
帝国通信工業	600	1,193.00	715,800
タムラ製作所	5,300	612.00	3,243,600
アルプスアルパイン	14,400	2,172.00	31,276,800
池上通信機	400	1,117.00	446,800
日本電波工業	1,300	475.00	617,500
鈴木	700	729.00	510,300
日本トリム	300	4,780.00	1,434,000
ローランド ディー . ジー .	800	2,112.00	1,689,600
フォスター電機	1,600	2,053.00	3,284,800
S M K	400	2,846.00	1,138,400
ヨコオ	1,000	3,295.00	3,295,000
ホシデン	4,100	1,089.00	4,464,900
ヒロセ電機	2,000	13,740.00	27,480,000
日本航空電子工業	3,200	1,755.00	5,616,000
T O A	1,500	1,204.00	1,806,000
マクセルホールディングス	3,000	1,554.00	4,662,000
古野電気	1,800	1,118.00	2,012,400
ユニデンホールディングス	400	1,983.00	793,200
スミダコーポレーション	1,100	1,110.00	1,221,000
アイコム	800	2,374.00	1,899,200
リオン	600	2,604.00	1,562,400
本多通信工業	1,200	515.00	618,000
船井電機	1,500	623.00	934,500
横河電機	13,900	1,972.00	27,410,800
新電元工業	500	3,715.00	1,857,500
アズビル	8,700	3,010.00	26,187,000
東亜ディーケーケー	700	855.00	598,500
日本光電工業	6,100	3,190.00	19,459,000

チノー	500	1,400.00	700,000
共和電業	1,400	423.00	592,200
日本電子材料	500	727.00	363,500
堀場製作所	2,700	7,440.00	20,088,000
アドバンテスト	9,400	5,740.00	53,956,000
小野測器	600	522.00	313,200
エスベック	1,200	1,956.00	2,347,200
キーエンス	6,800	67,210.00	457,028,000
日置電機	700	3,690.00	2,583,000
シスメックス	10,800	6,948.00	75,038,400
日本マイクロニクス	2,400	1,042.00	2,500,800
メガチップス	1,100	2,122.00	2,334,200
OBARA GROUP	700	4,025.00	2,817,500
澤藤電機	200	1,832.00	366,400
原田工業	600	932.00	559,200
コーセル	1,700	1,201.00	2,041,700
イリソ電子工業	1,300	5,360.00	6,968,000
オブテックスグループ	2,300	1,691.00	3,889,300
千代田インテグレ	600	2,359.00	1,415,400
アイ・オー・データ機器	500	910.00	455,000
レーザーテック	2,800	8,140.00	22,792,000
スタンレー電気	9,800	3,010.00	29,498,000
岩崎電気	500	1,377.00	688,500
ウシオ電機	8,000	1,621.00	12,968,000
岡谷電機産業	1,000	387.00	387,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,300	608.00	790,400
エノモト	400	1,075.00	430,000
日本セラミック	1,400	2,769.00	3,876,600
遠藤照明	700	686.00	480,200
古河電池	1,000	662.00	662,000
双信電機	700	446.00	312,200
山一電機	1,000	1,489.00	1,489,000
図研	900	2,210.00	1,989,000
日本電子	2,700	2,931.00	7,913,700
カシオ計算機	12,300	1,769.00	21,758,700
ファナック	13,100	21,640.00	283,484,000

日本シイエムケイ	3,500	670.00	2,345,000	
エンプラス	600	3,585.00	2,151,000	
大真空	500	1,080.00	540,000	
ローム	6,600	8,770.00	57,882,000	
浜松ホトニクス	9,900	4,170.00	41,283,000	
三井ハイテック	1,500	1,889.00	2,833,500	
新光電気工業	4,700	1,113.00	5,231,100	
京セラ	21,100	7,118.00	150,189,800	
太陽誘電	6,200	2,999.00	18,593,800	
村田製作所	43,500	5,908.00	256,998,000	
双葉電子工業	2,200	1,396.00	3,071,200	
北陸電気工業	500	1,209.00	604,500	
ニチコン	4,400	1,057.00	4,650,800	
日本ケミコン	1,000	1,846.00	1,846,000	
K O A	2,100	1,414.00	2,969,400	
市光工業	2,100	840.00	1,764,000	
小糸製作所	8,300	5,580.00	46,314,000	
ミツバ	2,600	698.00	1,814,800	
S C R E E Nホールディングス	2,400	8,040.00	19,296,000	
キャノン電子	1,400	1,951.00	2,731,400	
キャノン	74,400	2,934.50	218,326,800	代用有価証券 10,000株
リコー	41,700	975.00	40,657,500	
象印マホービン	4,100	1,604.00	6,576,400	
M U T O Hホールディングス	300	1,712.00	513,600	
東京エレクトロン	9,200	22,515.00	207,138,000	
トヨタ紡織	4,800	1,547.00	7,425,600	
芦森工業	300	1,457.00	437,100	
ユニプレス	2,700	1,763.00	4,760,100	
豊田自動織機	11,200	6,350.00	71,120,000	
モリタホールディングス	2,400	1,783.00	4,279,200	
三櫻工業	1,900	1,350.00	2,565,000	
デンソー	30,400	4,898.00	148,899,200	
東海理化電機製作所	3,600	1,929.00	6,944,400	
三井E & Sホールディングス	5,100	1,114.00	5,681,400	
川崎重工業	10,800	2,622.00	28,317,600	

名村造船所	4,300	311.00	1,337,300	
サノヤスホールディングス	2,100	194.00	407,400	
日本車輛製造	500	2,709.00	1,354,500	
三菱ロジスネクスト	2,300	1,112.00	2,557,600	
近畿車輛	200	1,577.00	315,400	
日産自動車	163,000	680.60	110,937,800	
いすゞ自動車	43,700	1,261.50	55,127,550	
トヨタ自動車	154,000	7,483.00	1,152,382,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,200	993.00	17,079,600	
三菱自動車工業	51,200	493.00	25,241,600	
エフテック	1,000	728.00	728,000	
レシップホールディングス	500	669.00	334,500	
G M B	300	838.00	251,400	
ファルテック	300	800.00	240,000	
武蔵精密工業	3,400	1,471.00	5,001,400	
日産車体	2,700	987.00	2,664,900	
新明和工業	5,800	1,314.00	7,621,200	
極東開発工業	2,700	1,428.00	3,855,600	
日信工業	2,600	1,777.00	4,620,200	
トピー工業	1,100	2,184.00	2,402,400	
ティラド	500	2,098.00	1,049,000	
タチエス	2,300	1,457.00	3,351,100	
N O K	7,400	1,712.00	12,668,800	
フタバ産業	3,900	758.00	2,956,200	
K Y B	1,400	3,525.00	4,935,000	
大同メタル工業	2,300	678.00	1,559,400	
プレス工業	6,900	468.00	3,229,200	
ミクニ	1,800	346.00	622,800	
太平洋工業	2,900	1,617.00	4,689,300	
ケーヒン	3,200	1,870.00	5,984,000	
河西工業	1,700	880.00	1,496,000	
アイシン精機	11,400	3,800.00	43,320,000	
マツダ	43,500	1,002.50	43,608,750	
今仙電機製作所	1,300	920.00	1,196,000	
本田技研工業	116,600	2,950.00	343,970,000	

スズキ	25,300	5,053.00	127,840,900
S U B A R U	42,900	3,040.00	130,416,000
安永	700	1,387.00	970,900
ヤマハ発動機	18,000	2,167.00	39,006,000
ショーワ	3,300	1,777.00	5,864,100
T B K	1,700	435.00	739,500
エクセディ	1,900	2,261.00	4,295,900
豊田合成	4,500	2,313.00	10,408,500
愛三工業	2,200	932.00	2,050,400
盟和産業	200	1,115.00	223,000
日本プラスト	1,100	718.00	789,800
ヨロズ	1,300	1,379.00	1,792,700
エフ・シー・シー	2,500	2,191.00	5,477,500
シマノ	5,200	15,780.00	82,056,000
テイ・エス テック	3,200	3,525.00	11,280,000
ジャムコ	700	1,485.00	1,039,500
テルモ	39,100	3,498.00	136,771,800
クリエートメディック	400	1,018.00	407,200
日機装	4,200	1,173.00	4,926,600
日本エム・ディ・エム	800	1,811.00	1,448,800
島津製作所	17,800	2,851.00	50,747,800
J M S	1,300	653.00	848,900
長野計器	1,100	724.00	796,400
ブイ・テクノロジー	600	6,740.00	4,044,000
東京計器	900	929.00	836,100
愛知時計電機	200	4,020.00	804,000
インターアクション	800	2,031.00	1,624,800
オーバル	1,400	244.00	341,600
東京精密	2,500	3,715.00	9,287,500
マニー	5,500	2,551.00	14,030,500
ニコン	24,100	1,392.00	33,547,200
トプコン	7,500	1,499.00	11,242,500
オリンパス	82,400	1,424.00	117,337,600
理研計器	1,200	2,131.00	2,557,200
タムロン	1,100	2,364.00	2,600,400
H O Y A	27,800	9,133.00	253,897,400

シード	600	887.00	532,200
ノーリツ鋼機	1,100	1,545.00	1,699,500
エー・アンド・デイ	1,300	830.00	1,079,000
朝日インテック	11,700	2,888.00	33,789,600
シチズン時計	15,300	563.00	8,613,900
リズム時計工業	500	973.00	486,500
大研医器	1,100	542.00	596,200
メニコン	1,900	3,635.00	6,906,500
シンシア	200	616.00	123,200
松風	700	1,700.00	1,190,000
セイコーホールディングス	2,100	2,589.00	5,436,900
ニプロ	9,600	1,251.00	12,009,600
中本パックス	400	1,448.00	579,200
スノーピーク	600	1,082.00	649,200
パラマウントベッドホールディングス	1,600	4,035.00	6,456,000
トランザクション	900	928.00	835,200
S H O - B I	400	387.00	154,800
ニホンフラッシュ	600	2,638.00	1,582,800
前田工織	1,500	1,819.00	2,728,500
永大産業	2,000	341.00	682,000
アートネイチャー	1,400	656.00	918,400
バンダイナムコホールディングス	14,300	6,950.00	99,385,000
アイフィスジャパン	300	779.00	233,700
共立印刷	2,400	160.00	384,000
S H O E I	700	4,615.00	3,230,500
フランスベッドホールディングス	1,900	1,006.00	1,911,400
パイロットコーポレーション	2,400	4,270.00	10,248,000
萩原工業	700	1,653.00	1,157,100
トッパン・フォームズ	3,000	1,051.00	3,153,000
フジシールインターナショナル	3,100	2,725.00	8,447,500
タカラトミー	5,800	1,177.00	6,826,600
廣済堂	1,300	705.00	916,500
エステールホールディングス	300	644.00	193,200
アーク	5,500	96.00	528,000
タカノ	500	786.00	393,000
プロネクサス	1,200	1,170.00	1,404,000

ホクシン	1,200	180.00	216,000	
ウッドワン	500	1,102.00	551,000	
大建工業	1,000	1,860.00	1,860,000	
凸版印刷	20,500	1,998.00	40,959,000	
大日本印刷	19,500	2,893.00	56,413,500	
共同印刷	400	2,649.00	1,059,600	
N I S S H A	2,900	1,145.00	3,320,500	
光村印刷	100	1,760.00	176,000	
宝印刷	600	1,715.00	1,029,000	
アシックス	11,500	1,900.00	21,850,000	
ツツミ	400	1,957.00	782,800	
小松ウオール工業	400	2,226.00	890,400	
ヤマハ	8,200	5,000.00	41,000,000	
河合楽器製作所	400	3,025.00	1,210,000	
クリナップ	1,300	562.00	730,600	
ピジョン	8,400	5,060.00	42,504,000	
兼松サステック	100	1,751.00	175,100	
キングジム	1,200	876.00	1,051,200	
リンテック	3,300	2,261.00	7,461,300	
イトーキ	2,900	484.00	1,403,600	
任天堂	7,900	37,020.00	292,458,000	
三菱鉛筆	2,300	1,745.00	4,013,500	
タカラスタANDARD	2,800	1,906.00	5,336,800	
コクヨ	6,600	1,586.00	10,467,600	
ナカバヤシ	1,300	533.00	692,900	
グローブライド	700	2,670.00	1,869,000	
オカムラ	4,800	1,087.00	5,217,600	
美津濃	1,400	2,789.00	3,904,600	
東京電力ホールディングス	110,400	526.00	58,070,400	
中部電力	42,300	1,627.00	68,822,100	
関西電力	56,400	1,247.00	70,330,800	
中国電力	19,100	1,459.00	27,866,900	
北陸電力	13,600	783.00	10,648,800	
東北電力	32,400	1,105.00	35,802,000	
四国電力	12,500	1,059.00	13,237,500	
九州電力	28,500	1,088.00	31,008,000	

北海道電力	13,000	595.00	7,735,000
沖縄電力	2,600	1,826.00	4,747,600
電源開発	11,000	2,660.00	29,260,000
エフオン	700	718.00	502,600
イーレックス	2,400	1,413.00	3,391,200
レノバ	2,300	965.00	2,219,500
東京瓦斯	26,600	2,730.50	72,631,300
大阪瓦斯	26,800	2,106.00	56,440,800
東邦瓦斯	6,900	4,275.00	29,497,500
北海道瓦斯	700	1,614.00	1,129,800
広島ガス	2,800	351.00	982,800
西部瓦斯	1,600	2,464.00	3,942,400
静岡ガス	3,900	923.00	3,599,700
メタウォーター	700	3,875.00	2,712,500
SBSホールディングス	1,200	1,711.00	2,053,200
東武鉄道	14,600	3,635.00	53,071,000
相鉄ホールディングス	4,800	2,886.00	13,852,800
東急	37,500	2,070.00	77,625,000
京浜急行電鉄	19,000	2,162.00	41,078,000
小田急電鉄	22,200	2,731.00	60,628,200
京王電鉄	7,700	6,840.00	52,668,000
京成電鉄	10,400	4,500.00	46,800,000
富士急行	1,900	4,335.00	8,236,500
東日本旅客鉄道	24,300	9,993.00	242,829,900
西日本旅客鉄道	12,300	9,297.00	114,353,100
東海旅客鉄道	12,400	22,735.00	281,914,000
西武ホールディングス	17,100	1,902.00	32,524,200
鴻池運輸	2,200	1,631.00	3,588,200
西日本鉄道	3,800	2,513.00	9,549,400
ハマキョウレックス	1,100	3,600.00	3,960,000
サカイ引越センター	700	6,450.00	4,515,000
近鉄グループホールディングス	13,100	5,900.00	77,290,000
阪急阪神ホールディングス	17,500	4,355.00	76,212,500
南海電気鉄道	5,900	2,784.00	16,425,600
京阪ホールディングス	5,800	5,190.00	30,102,000
神戸電鉄	400	3,920.00	1,568,000

名古屋鉄道	10,800	3,410.00	36,828,000
山陽電気鉄道	1,000	2,126.00	2,126,000
日本通運	5,000	5,880.00	29,400,000
ヤマトホールディングス	22,900	1,873.00	42,891,700
山九	3,600	5,890.00	21,204,000
丸運	500	270.00	135,000
丸全昭和運輸	1,000	3,025.00	3,025,000
センコーグループホールディングス	7,200	872.00	6,278,400
トナミホールディングス	300	4,950.00	1,485,000
ニッコンホールディングス	5,000	2,595.00	12,975,000
日本石油輸送	100	2,729.00	272,900
福山通運	1,700	3,945.00	6,706,500
セイノーホールディングス	9,800	1,411.00	13,827,800
エスライン	400	943.00	377,200
神奈川中央交通	300	3,915.00	1,174,500
日立物流	2,900	3,115.00	9,033,500
丸和運輸機関	1,400	2,307.00	3,229,800
C & F ロジホールディングス	1,300	1,377.00	1,790,100
九州旅客鉄道	11,000	3,555.00	39,105,000
S Gホールディングス	12,300	2,618.00	32,201,400
日本郵船	11,000	2,008.00	22,088,000
商船三井	7,800	3,110.00	24,258,000
川崎汽船	4,100	1,632.00	6,691,200
N S ユナイテッド海運	700	2,471.00	1,729,700
明治海運	1,400	352.00	492,800
飯野海運	6,300	369.00	2,324,700
共栄タンカー	100	1,503.00	150,300
乾汽船	1,200	1,083.00	1,299,600
日本航空	24,000	3,352.00	80,448,000
A N Aホールディングス	23,900	3,714.00	88,764,600
パスコ	300	1,180.00	354,000
トランコム	400	7,550.00	3,020,000
日新	1,100	1,662.00	1,828,200
三菱倉庫	4,500	2,800.00	12,600,000
三井倉庫ホールディングス	1,600	1,675.00	2,680,000
住友倉庫	4,800	1,475.00	7,080,000

澁澤倉庫	700	2,036.00	1,425,200
東陽倉庫	2,400	334.00	801,600
日本トランスシティ	2,900	532.00	1,542,800
ケイヒン	300	1,286.00	385,800
中央倉庫	800	1,152.00	921,600
川西倉庫	300	1,113.00	333,900
安田倉庫	1,100	947.00	1,041,700
ファイズホールディングス	200	678.00	135,600
東洋埠頭	400	1,384.00	553,600
宇徳	1,100	534.00	587,400
上組	8,100	2,460.00	19,926,000
サンリツ	300	670.00	201,000
キムラユニティー	300	1,086.00	325,800
キューソー流通システム	300	1,911.00	573,300
近鉄エクスプレス	2,500	1,761.00	4,402,500
東海運	900	292.00	262,800
エーアイティー	800	940.00	752,000
内外トランスライン	400	1,389.00	555,600
日本コンセプト	400	1,450.00	580,000
N E C ネットズエスアイ	1,500	3,115.00	4,672,500
クロスキャット	400	997.00	398,800
システナ	4,800	1,559.00	7,483,200
デジタルアーツ	700	6,530.00	4,571,000
日鉄ソリューションズ	2,000	3,485.00	6,970,000
キューブシステム	700	781.00	546,700
エイジア	300	1,246.00	373,800
コア	600	1,410.00	846,000
ソリトンシステムズ	600	972.00	583,200
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,844.00	1,106,400
T I S	4,500	6,540.00	29,430,000
ネオス	600	749.00	449,400
電算システム	500	2,971.00	1,485,500
グリー	9,400	499.00	4,690,600
コーエーテックモホールディングス	2,800	2,441.00	6,834,800
三菱総合研究所	600	3,780.00	2,268,000
ボルテージ	300	535.00	160,500

電算	200	2,094.00	418,800
A G S	800	727.00	581,600
ファインデックス	1,200	999.00	1,198,800
ブレインパッド	300	5,680.00	1,704,000
K L a b	2,600	982.00	2,553,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	1,013.00	1,823,400
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,742.00	348,400
ネクソン	38,500	1,235.00	47,547,500
アイスタイル	3,500	750.00	2,625,000
エムアップ	500	1,946.00	973,000
エイチーム	1,000	1,080.00	1,080,000
エニグモ	1,000	995.00	995,000
テクノスジャパン	1,200	534.00	640,800
e n i s h	600	756.00	453,600
コロプラ	4,500	1,500.00	6,750,000
ブロードリーフ	6,700	598.00	4,006,600
クロス・マーケティンググループ	700	366.00	256,200
デジタルハーツホールディングス	600	907.00	544,200
システム情報	700	1,011.00	707,700
メディアドゥホールディングス	500	3,325.00	1,662,500
じげん	1,900	579.00	1,100,100
バイキューブ	900	435.00	391,500
エンカレッジ・テクノロジー	200	751.00	150,200
サイバーリンクス	200	1,190.00	238,000
フィックスターズ	1,500	1,626.00	2,439,000
C A R T A H O L D I N G S	700	1,185.00	829,500
オブティム	600	2,684.00	1,610,400
セレス	500	1,265.00	632,500
ティーガイア	1,000	2,234.00	2,234,000
セック	200	3,045.00	609,000
日本アジアグループ	1,500	358.00	537,000
豆蔵ホールディングス	900	1,795.00	1,615,500
テクマトリックス	1,000	2,428.00	2,428,000
プロシップ	400	1,286.00	514,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,300	2,392.00	7,893,600

GMOペイメントゲートウェイ	2,200	7,850.00	17,270,000
ザッパラス	800	379.00	303,200
システムリサーチ	400	2,003.00	801,200
インターネットイニシアティブ	2,200	2,575.00	5,665,000
さくらインターネット	1,700	721.00	1,225,700
ヴィンクス	400	1,140.00	456,000
GMOクラウド	200	2,702.00	540,400
SRAホールディングス	700	2,510.00	1,757,000
Minor iソリューションズ	300	2,097.00	629,100
システムインテグレータ	400	793.00	317,200
朝日ネット	1,100	637.00	700,700
eBASE	800	1,200.00	960,000
アバント	500	2,159.00	1,079,500
アドソル日進	500	2,410.00	1,205,000
フリービット	800	877.00	701,600
コムチュア	1,500	2,009.00	3,013,500
サイバーコム	300	1,931.00	579,300
アステリア	900	652.00	586,800
アイル	200	2,410.00	482,000
マークラインズ	700	2,000.00	1,400,000
メディカル・データ・ビジョン	1,100	1,150.00	1,265,000
gumi	1,800	747.00	1,344,600
ショーケース	400	722.00	288,800
モバイルファクトリー	300	1,450.00	435,000
テラスカイ	200	2,105.00	421,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,700.00	1,020,000
PCIホールディングス	300	2,095.00	628,500
パイプドHD	200	1,629.00	325,800
アイピーシー	300	1,145.00	343,500
ネオジャパン	300	993.00	297,900
PR TIMES	100	2,548.00	254,800
ランドコンピュータ	200	1,049.00	209,800
ダブルスタンダード	100	5,290.00	529,000
オープンドア	700	2,063.00	1,444,100
マイネット	500	566.00	283,000

アカツキ	500	6,320.00	3,160,000	
ベネフィットジャパン	100	1,616.00	161,600	
Ubicomホールディングス	300	1,455.00	436,500	
LINE	3,100	3,990.00	12,369,000	
カナミックネットワーク	800	592.00	473,600	
ノムラシステムコーポレーション	300	586.00	175,800	
チェンジ	300	2,130.00	639,000	
シンクロ・フード	600	495.00	297,000	
オークネット	800	1,374.00	1,099,200	
エイトレッド	100	1,519.00	151,900	
AOI TYO Holdings	1,400	645.00	903,000	
マクロミル	2,500	967.00	2,417,500	
ビーグリー	300	993.00	297,900	
オロ	400	2,705.00	1,082,000	
テモナ	200	507.00	101,400	
サインポスト	200	1,989.00	397,800	
ソルクシーズ	600	961.00	576,600	
フェイス	600	786.00	471,600	
プロトコーポレーション	1,200	1,147.00	1,376,400	
ハイマックス	200	1,827.00	365,400	
野村総合研究所	25,900	2,230.00	57,757,000	
サイバネットシステム	1,000	724.00	724,000	
CEホールディングス	800	467.00	373,600	
日本システム技術	200	1,303.00	260,600	
インテージホールディングス	1,700	942.00	1,601,400	
東邦システムサイエンス	400	1,003.00	401,200	
ソースネクスト	5,300	465.00	2,464,500	
インフォコム	1,500	2,349.00	3,523,500	
ラクスル	700	3,515.00	2,460,500	
FIG	1,600	317.00	507,200	
システムサポート	100	1,342.00	134,200	
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,472.00	2,208,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,658.00	497,400	
フォーカスシステムズ	900	903.00	812,700	
クレスコ	400	3,400.00	1,360,000	

フジ・メディア・ホールディングス	14,100	1,447.00	20,402,700
オービック	4,700	12,740.00	59,878,000
ジャストシステム	1,900	4,310.00	8,189,000
TDCソフト	1,200	875.00	1,050,000
Zホールディングス	88,300	329.00	29,050,700
トレンドマイクロ	6,000	5,470.00	32,820,000
IDホールディングス	500	1,298.00	649,000
日本オラクル	2,700	9,310.00	25,137,000
アルファシステムズ	400	2,791.00	1,116,400
フューチャー	1,600	1,928.00	3,084,800
CAC Holdings	900	1,330.00	1,197,000
SBテクノロジー	600	1,903.00	1,141,800
トーセ	400	842.00	336,800
オービックビジネスコンサルタント	1,400	4,335.00	6,069,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,200	2,857.00	17,713,400
アイティフォー	1,700	878.00	1,492,600
東計電算	200	3,240.00	648,000
エクスネット	200	978.00	195,600
大塚商会	7,300	4,175.00	30,477,500
サイボウズ	1,600	1,093.00	1,748,800
ソフトブレーン	800	687.00	549,600
電通国際情報サービス	800	3,665.00	2,932,000
デジタルガレージ	2,700	3,570.00	9,639,000
EMシステムズ	1,100	1,938.00	2,131,800
ウェザーニューズ	500	3,340.00	1,670,000
CIJ	1,000	828.00	828,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,090.00	618,000
日本エンタープライズ	1,600	231.00	369,600
WOWOW	600	2,621.00	1,572,600
スカラ	1,000	962.00	962,000
インテリジェント ウェイブ	500	746.00	373,000
IMAGICA GROUP	1,200	574.00	688,800
ネットワンシステムズ	4,800	2,856.00	13,708,800
システムソフト	3,600	115.00	414,000
アルゴグラフィックス	1,200	2,943.00	3,531,600
マーベラス	2,100	771.00	1,619,100

エイベックス	2,300	1,300.00	2,990,000
日本ユニシス	4,200	3,425.00	14,385,000
兼松エレクトロニクス	700	3,315.00	2,320,500
東京放送ホールディングス	9,000	1,723.00	15,507,000
日本テレビホールディングス	12,400	1,425.00	17,670,000
朝日放送グループホールディングス	1,300	735.00	955,500
テレビ朝日ホールディングス	3,700	1,734.00	6,415,800
スカパーJ S A Tホールディングス	8,800	446.00	3,924,800
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,261.00	2,487,100
日本BS放送	400	1,082.00	432,800
ビジョン	1,200	1,642.00	1,970,400
スマートパリュー	400	743.00	297,200
USEN-NEXT HOLDINGS	600	984.00	590,400
コネクシオ	1,000	1,410.00	1,410,000
クロップス	300	648.00	194,400
日本電信電話	92,800	5,298.00	491,654,400
KDDI	111,300	2,936.50	326,832,450
ソフトバンク	144,000	1,480.00	213,120,000
光通信	1,600	23,250.00	37,200,000
NTTドコモ	86,000	2,833.50	243,681,000
エムティーアイ	1,300	716.00	930,800
GMOインターネット	5,400	1,782.00	9,622,800
アйдママーケティングコミュニケーション	300	659.00	197,700
KADOKAWA	4,000	1,487.00	5,948,000
学研ホールディングス	500	5,770.00	2,885,000
ゼンリン	2,700	1,870.00	5,049,000
昭文社	700	392.00	274,400
インプレスホールディングス	1,200	151.00	181,200
アイネット	800	1,431.00	1,144,800
松竹	900	15,730.00	14,157,000
東宝	8,900	4,495.00	40,005,500
東映	600	15,040.00	9,024,000
エヌ・ティ・ティ・データ	36,100	1,417.00	51,153,700
ピー・シー・エー	200	3,855.00	771,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,635.00	527,000
D T S	3,000	2,340.00	7,020,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,300	5,100.00	32,130,000	
シーイーシー	1,500	1,967.00	2,950,500	
カブコン	5,800	2,799.00	16,234,200	
アイ・エス・ビー	300	1,637.00	491,100	
ジャステック	900	1,103.00	992,700	
S C S K	3,600	5,100.00	18,360,000	
日本システムウエア	400	2,641.00	1,056,400	
アイネス	1,700	1,204.00	2,046,800	
T K C	1,100	4,485.00	4,933,500	
富士ソフト	1,700	4,635.00	7,879,500	
N S D	2,200	3,115.00	6,853,000	
コナミホールディングス	5,500	4,890.00	26,895,000	
福井コンピュータホールディングス	400	2,816.00	1,126,400	
J B C Cホールディングス	1,100	1,588.00	1,746,800	
ミロク情報サービス	1,400	2,819.00	3,946,600	
ソフトバンクグループ	107,700	3,996.00	430,369,200	
ハウスイ	100	849.00	84,900	
高千穂交易	500	1,120.00	560,000	
伊藤忠食品	300	5,100.00	1,530,000	
エレマテック	1,300	1,049.00	1,363,700	
J A L U X	400	2,492.00	996,800	
あらた	1,000	4,035.00	4,035,000	
トーメンデバイス	200	2,445.00	489,000	
東京エレクトロン デバイス	500	2,084.00	1,042,000	
フィールズ	1,300	522.00	678,600	
双日	75,300	343.00	25,827,900	
アルフレッサ ホールディングス	15,100	2,437.00	36,798,700	
横浜冷凍	3,800	1,098.00	4,172,400	
神栄	200	756.00	151,200	
ラサ商事	700	861.00	602,700	
ラクーンホールディングス	700	700.00	490,000	
アルコニックス	1,500	1,416.00	2,124,000	
神戸物産	2,400	6,000.00	14,400,000	
あい ホールディングス	2,000	1,920.00	3,840,000	
ディーブイエックス	500	900.00	450,000	
ダイワボウホールディングス	1,300	4,805.00	6,246,500	

マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	1,584.00	6,019,200
ラクト・ジャパン	500	3,630.00	1,815,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,083.00	2,815,800
八洲電機	1,100	874.00	961,400
メディアスホールディングス	800	767.00	613,600
レスターホールディングス	1,500	1,866.00	2,799,000
ジューテックホールディングス	300	1,104.00	331,200
大光	600	687.00	412,200
OCHIホールディングス	400	1,345.00	538,000
TOKAIホールディングス	7,200	1,050.00	7,560,000
黒谷	300	445.00	133,500
Cominix	200	865.00	173,000
三洋貿易	700	2,197.00	1,537,900
ビューティガレージ	200	1,696.00	339,200
ウイン・パートナーズ	900	1,409.00	1,268,100
ミタチ産業	400	723.00	289,200
シップヘルスケアホールディングス	2,800	4,625.00	12,950,000
明治電機工業	400	1,423.00	569,200
デリカフーズホールディングス	500	687.00	343,500
スターティアホールディングス	300	555.00	166,500
コメダホールディングス	3,200	2,101.00	6,723,200
富士興産	600	676.00	405,600
協栄産業	200	1,510.00	302,000
小野建	1,200	1,400.00	1,680,000
南陽	300	1,642.00	492,600
佐鳥電機	1,000	901.00	901,000
エコートレーディング	300	533.00	159,900
伯東	900	1,267.00	1,140,300
コンドーテック	1,100	963.00	1,059,300
中山福	800	540.00	432,000
ナガイレーベン	2,000	2,543.00	5,086,000
三菱食品	1,500	2,775.00	4,162,500
松田産業	1,000	1,482.00	1,482,000
第一興商	2,000	5,080.00	10,160,000
メディバルホールディングス	14,700	2,443.00	35,912,100
SPK	300	2,644.00	793,200

萩原電気ホールディングス	500	2,798.00	1,399,000	
アズワン	1,000	8,810.00	8,810,000	
スズデン	500	1,364.00	682,000	
シモジマ	900	1,197.00	1,077,300	
ドウシシャ	1,300	1,720.00	2,236,000	
小津産業	300	1,828.00	548,400	
高速	800	1,292.00	1,033,600	
たけびし	500	1,399.00	699,500	
リックス	300	1,569.00	470,700	
丸文	1,200	611.00	733,200	
ハビネット	1,100	1,340.00	1,474,000	
橋本総業ホールディングス	300	1,686.00	505,800	
日本ライフライン	4,000	1,753.00	7,012,000	
タカショー	700	480.00	336,000	
エクセル	500	1,271.00	635,500	
マルカ	500	2,210.00	1,105,000	
I D O M	4,700	469.00	2,204,300	
進和	800	2,396.00	1,916,800	
エスケイジャパン	400	448.00	179,200	
ダイトロン	600	1,481.00	888,600	
シークス	1,700	1,657.00	2,816,900	
田中商事	500	667.00	333,500	
オーハシテクニカ	800	1,428.00	1,142,400	
白銅	400	1,455.00	582,000	
伊藤忠商事	92,200	2,284.50	210,630,900	
丸紅	134,200	753.80	101,159,960	
高島	200	1,708.00	341,600	
長瀬産業	7,600	1,632.00	12,403,200	
蝶理	900	1,788.00	1,609,200	
豊田通商	15,200	3,675.00	55,860,000	
三共生興	2,300	535.00	1,230,500	
兼松	5,500	1,283.00	7,056,500	
ツカモトコーポレーション	200	1,100.00	220,000	
三井物産	112,900	1,818.00	205,252,200	
日本紙パルプ商事	800	3,970.00	3,176,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,100	6,620.00	27,142,000	

カメイ	1,800	1,186.00	2,134,800
東都水産	200	2,547.00	509,400
OUGホールディングス	200	2,788.00	557,600
スターゼン	500	4,715.00	2,357,500
山善	5,300	993.00	5,262,900
椿本興業	300	4,085.00	1,225,500
住友商事	81,100	1,729.50	140,262,450
内田洋行	600	4,350.00	2,610,000
三菱商事	96,100	2,735.50	262,881,550
第一実業	600	3,390.00	2,034,000
キヤノンマーケティングジャパン	3,900	2,297.00	8,958,300
西華産業	800	1,356.00	1,084,800
佐藤商事	1,200	867.00	1,040,400
菱洋エレクトロ	1,400	1,904.00	2,665,600
東京産業	1,300	584.00	759,200
ユアサ商事	1,400	3,335.00	4,669,000
神鋼商事	300	2,520.00	756,000
小林産業	800	316.00	252,800
阪和興業	2,400	3,135.00	7,524,000
正栄食品工業	900	3,335.00	3,001,500
カナデン	1,200	1,263.00	1,515,600
菱電商事	1,100	1,552.00	1,707,200
フルサト工業	700	1,618.00	1,132,600
岩谷産業	3,000	3,735.00	11,205,000
すてきナイスグループ	700	920.00	644,000
昭光通商	600	645.00	387,000
ニチモウ	200	1,866.00	373,200
極東貿易	400	1,839.00	735,600
イワキ	1,800	456.00	820,800
三愛石油	3,600	1,037.00	3,733,200
稲畑産業	3,300	1,382.00	4,560,600
G S Iクレオス	400	1,088.00	435,200
明和産業	1,300	555.00	721,500
クワザワ	500	586.00	293,000
ワキタ	2,900	1,099.00	3,187,100
東邦ホールディングス	4,100	2,680.00	10,988,000

サンゲツ	4,000	2,015.00	8,060,000
ミツウロコグループホールディングス	1,800	1,173.00	2,111,400
シナネンホールディングス	600	1,891.00	1,134,600
伊藤忠エネクス	3,000	863.00	2,589,000
サンリオ	4,200	2,201.00	9,244,200
サンワテクノス	800	909.00	727,200
リョーサン	1,500	2,853.00	4,279,500
新光商事	2,500	926.00	2,315,000
トーヨー	600	1,725.00	1,035,000
三信電気	1,000	1,525.00	1,525,000
東陽テクニカ	1,600	1,130.00	1,808,000
モスフードサービス	1,800	2,791.00	5,023,800
加賀電子	1,400	2,100.00	2,940,000
ソーダニッカ	1,400	650.00	910,000
立花エレテック	1,000	1,801.00	1,801,000
フォーバル	600	992.00	595,200
PALTAC	2,500	5,230.00	13,075,000
三谷産業	1,500	331.00	496,500
太平洋興発	600	801.00	480,600
西本Wismettacホールディングス	300	3,400.00	1,020,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,391.00	139,100
国際紙パルプ商事	3,300	312.00	1,029,600
ヤマタネ	700	1,386.00	970,200
丸紅建材リース	100	1,803.00	180,300
日鉄物産	1,000	4,530.00	4,530,000
泉州電業	400	2,829.00	1,131,600
トラスコ中山	2,800	2,711.00	7,590,800
オートバックスセブン	5,400	1,749.00	9,444,600
モリト	1,000	800.00	800,000
加藤産業	2,100	3,505.00	7,360,500
北恵	300	1,036.00	310,800
イノテック	800	958.00	766,400
イエローハット	2,600	1,732.00	4,503,200
J Kホールディングス	1,300	557.00	724,100
日伝	1,100	2,118.00	2,329,800
北沢産業	1,100	277.00	304,700

杉本商事	700	1,941.00	1,358,700
因幡電機産業	1,900	4,960.00	9,424,000
東テク	500	2,331.00	1,165,500
ミスミグループ本社	17,100	2,608.00	44,596,800
アルテック	1,100	238.00	261,800
タキヒヨー	400	1,842.00	736,800
蔵王産業	200	1,435.00	287,000
スズケン	6,200	5,840.00	36,208,000
ジェコス	900	931.00	837,900
グローセル	1,200	456.00	547,200
ローソン	3,400	6,090.00	20,706,000
サンエー	1,000	5,030.00	5,030,000
カワチ薬品	1,100	2,182.00	2,400,200
エービーシー・マート	2,100	7,410.00	15,561,000
ハードオフコーポレーション	500	836.00	418,000
アスクル	1,400	2,937.00	4,111,800
ゲオホールディングス	2,100	1,329.00	2,790,900
アダストリア	1,900	2,688.00	5,107,200
ジーフット	800	616.00	492,800
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	672.00	134,400
くら寿司	700	4,600.00	3,220,000
キャンドウ	700	1,608.00	1,125,600
パルグループホールディングス	700	3,500.00	2,450,000
エディオン	5,800	1,061.00	6,153,800
サーラコーポレーション	2,700	627.00	1,692,900
ワッツ	700	606.00	424,200
ハローズ	500	2,516.00	1,258,000
フジオフードシステム	600	3,010.00	1,806,000
あみやき亭	300	3,405.00	1,021,500
ひらまつ	2,800	320.00	896,000
大黒天物産	300	3,370.00	1,011,000
ハニーズホールディングス	1,200	1,328.00	1,593,600
ファーマライズホールディングス	300	639.00	191,700
アルペン	1,000	1,724.00	1,724,000
ハブ	500	1,052.00	526,000
クオールホールディングス	2,000	1,510.00	3,020,000

ジーンズホールディングス	700	6,760.00	4,732,000	
ビックカメラ	8,100	1,170.00	9,477,000	
D C Mホールディングス	7,300	1,074.00	7,840,200	
ペッパーフードサービス	1,100	1,655.00	1,820,500	
MonotaRO	9,700	3,190.00	30,943,000	
東京一番フーズ	400	614.00	245,600	
D Dホールディングス	600	1,577.00	946,200	
きちりホールディングス	400	804.00	321,600	
アークランドサービスホールディングス	1,000	1,908.00	1,908,000	
J . フロント リテイリング	17,400	1,424.00	24,777,600	
ドトール・日レスホールディングス	2,400	2,168.00	5,203,200	
マツモトキヨシホールディングス	5,600	3,850.00	21,560,000	
ブロンコピラー	700	2,672.00	1,870,400	
Z O Z O	14,700	2,529.00	37,176,300	
トレジャー・ファクトリー	400	1,182.00	472,800	
物語コーポレーション	300	9,340.00	2,802,000	
ココカラファイン	1,500	6,020.00	9,030,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	889.00	22,669,500	
H a m e e	400	1,165.00	466,000	
ウエルシアホールディングス	3,600	6,150.00	22,140,000	
クリエイトSDホールディングス	2,000	2,686.00	5,372,000	
丸善C H Iホールディングス	1,500	366.00	549,000	
ミサワ	300	750.00	225,000	
ティーライフ	200	832.00	166,400	
エー・ピーカンパニー	300	550.00	165,000	
チムニー	400	2,426.00	970,400	
シュッピン	1,000	987.00	987,000	
ネクステージ	2,000	1,060.00	2,120,000	
ジョイフル本田	4,000	1,379.00	5,516,000	
鳥貴族	500	2,071.00	1,035,500	
麒麟堂ホールディングス	600	2,171.00	1,302,600	
ホットランド	900	1,209.00	1,088,100	
すかいらーくホールディングス	15,300	1,953.00	29,880,900	
S F Pホールディングス	600	2,208.00	1,324,800	
綿半ホールディングス	500	2,071.00	1,035,500	
ヨシックス	200	2,912.00	582,400	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	985.00	3,841,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	651.00	390,600
B E E N O S	500	1,298.00	649,000
あさひ	1,100	1,206.00	1,326,600
日本調剤	500	3,755.00	1,877,500
コスモス薬品	600	22,360.00	13,416,000
トーエル	700	765.00	535,500
オンリー	200	798.00	159,600
セブン&アイ・ホールディングス	57,100	4,247.00	242,503,700
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,700	1,871.00	6,922,700
ツルハホールディングス	3,000	12,080.00	36,240,000
サンマルクホールディングス	1,100	2,415.00	2,656,500
フェリシモ	300	1,046.00	313,800
トリドールホールディングス	1,700	2,410.00	4,097,000
T O K Y O B A S E	1,300	735.00	955,500
ウイルプラスホールディングス	200	789.00	157,800
ジャパンミート	700	2,158.00	1,510,600
サツドラホールディングス	200	1,765.00	353,000
デファクトスタンダード	200	327.00	65,400
アレンザホールディングス	700	843.00	590,100
串カツ田中ホールディングス	200	2,371.00	474,200
パロックジャパンリミテッド	1,100	914.00	1,005,400
クスリのアオキホールディングス	1,400	7,840.00	10,976,000
力の源ホールディングス	500	846.00	423,000
スシローグローバルホールディングス	1,500	7,450.00	11,175,000
L I X I L ビバ	1,100	1,810.00	1,991,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	534.00	801,000
はるやまホールディングス	600	819.00	491,400
ノジマ	2,400	1,907.00	4,576,800
カップ・クリエイト	1,900	1,398.00	2,656,200
ライトオン	1,100	586.00	644,600
ジーンズメイト	500	327.00	163,500
良品計画	19,300	2,424.00	46,783,200
三城ホールディングス	1,700	272.00	462,400
アドヴァン	2,100	1,174.00	2,465,400

アルビス	500	2,257.00	1,128,500
コナカ	1,600	418.00	668,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,660.00	332,000
G - 7ホールディングス	400	3,800.00	1,520,000
イオン北海道	1,300	789.00	1,025,700
コジマ	2,400	427.00	1,024,800
ヒマラヤ	500	822.00	411,000
コーナン商事	1,800	2,531.00	4,555,800
エコス	500	1,667.00	833,500
ワタミ	1,800	1,402.00	2,523,600
マルシェ	400	773.00	309,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	32,600	1,705.00	55,583,000
西松屋チェーン	3,000	976.00	2,928,000
ゼンショーホールディングス	6,600	2,298.00	15,166,800
幸楽苑ホールディングス	900	2,042.00	1,837,800
ハークスレイ	300	1,037.00	311,100
サイゼリヤ	2,300	2,514.00	5,782,200
V Tホールディングス	6,200	463.00	2,870,600
魚力	400	1,508.00	603,200
ポブラ	400	504.00	201,600
フジ・コーポレーション	400	2,127.00	850,800
ユナイテッドアローズ	1,600	3,300.00	5,280,000
ハイデイ日高	2,000	2,110.00	4,220,000
京都きもの友禅	1,100	350.00	385,000
コロワイド	4,500	2,107.00	9,481,500
ピーシーデポコーポレーション	1,900	484.00	919,600
壱番屋	900	5,110.00	4,599,000
P L A N T	300	712.00	213,600
スギホールディングス	3,000	6,120.00	18,360,000
薬王堂ホールディングス	600	2,562.00	1,537,200
ヴィア・ホールディングス	1,700	659.00	1,120,300
スクロール	2,100	339.00	711,900
ヨンドシーホールディングス	1,500	2,608.00	3,912,000
ファミリーマート	15,200	2,813.00	42,757,600
木曽路	1,700	2,828.00	4,807,600

S R Sホールディングス	1,600	1,044.00	1,670,400
千趣会	2,600	292.00	759,200
タカキュー	1,300	186.00	241,800
ケーヨー	2,600	530.00	1,378,000
上新電機	1,600	2,248.00	3,596,800
日本瓦斯	2,200	3,155.00	6,941,000
ロイヤルホールディングス	2,400	2,737.00	6,568,800
東天紅	100	1,241.00	124,100
いなげや	1,500	1,517.00	2,275,500
島忠	2,900	3,005.00	8,714,500
チヨダ	1,400	1,610.00	2,254,000
ライフコーポレーション	1,000	2,508.00	2,508,000
リンガーハット	1,700	2,424.00	4,120,800
MrMaxHD	1,800	480.00	864,000
テンアライド	1,300	442.00	574,600
AOKIホールディングス	2,700	1,122.00	3,029,400
オークワ	2,000	1,385.00	2,770,000
コメリ	2,100	2,293.00	4,815,300
青山商事	2,400	1,945.00	4,668,000
しまむら	1,600	8,980.00	14,368,000
はせがわ	800	402.00	321,600
高島屋	10,700	1,260.00	13,482,000
松屋	2,800	873.00	2,444,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,000	1,228.00	8,596,000
近鉄百貨店	500	3,350.00	1,675,000
パルコ	1,300	1,313.00	1,706,900
丸井グループ	11,500	2,460.00	28,290,000
アクシアル リテイリング	1,100	4,185.00	4,603,500
イオン	52,400	2,195.50	115,044,200
イズミ	2,800	4,130.00	11,564,000
平和堂	2,800	2,035.00	5,698,000
フジ	1,700	1,946.00	3,308,200
ヤオコー	1,600	5,070.00	8,112,000
ゼビオホールディングス	1,600	1,216.00	1,945,600
ケーズホールディングス	14,200	1,214.00	17,238,800
Olympicグループ	800	590.00	472,000

日産東京販売ホールディングス	2,100	295.00	619,500
Genky DrugStores	700	2,357.00	1,649,900
総合メディカルホールディングス	1,200	1,781.00	2,137,200
ブックオフグループホールディングス	800	1,164.00	931,200
アインホールディングス	1,800	6,200.00	11,160,000
元気寿司	400	2,783.00	1,113,200
ヤマダ電機	41,500	516.00	21,414,000
アークランドサカモト	2,300	1,275.00	2,932,500
ニトリホールディングス	5,900	16,220.00	95,698,000
愛眼	1,100	248.00	272,800
ケーユーホールディングス	700	856.00	599,200
吉野家ホールディングス	4,800	2,575.00	12,360,000
松屋フーズホールディングス	700	4,250.00	2,975,000
サガミホールディングス	1,800	1,390.00	2,502,000
関西スーパーマーケット	1,000	1,129.00	1,129,000
王将フードサービス	1,000	6,590.00	6,590,000
プレナス	1,500	1,875.00	2,812,500
ミニストップ	1,000	1,479.00	1,479,000
アークス	2,500	2,260.00	5,650,000
パローホールディングス	3,000	1,866.00	5,598,000
藤久	100	774.00	77,400
ベルク	700	5,200.00	3,640,000
大庄	800	1,593.00	1,274,400
ファーストリテイリング	1,800	68,190.00	122,742,000
サンドラッグ	5,100	3,545.00	18,079,500
サクスパー ホールディングス	1,200	906.00	1,087,200
ヤマザワ	300	1,725.00	517,500
やまや	200	2,135.00	427,000
ベルーナ	3,300	700.00	2,310,000
島根銀行	400	671.00	268,400
じもとホールディングス	9,300	100.00	930,000
めぶきフィナンシャルグループ	70,600	278.00	19,626,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,900	1,489.00	2,829,100
九州フィナンシャルグループ	22,300	455.00	10,146,500
ゆうちょ銀行	38,500	1,079.00	41,541,500
富山第一銀行	3,200	326.00	1,043,200

コンコルディア・フィナンシャルグループ	85,500	437.00	37,363,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,500	805.00	6,842,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	6,300	720.00	4,536,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,100	1,741.00	1,915,100	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,767.00	6,640,800	
新生銀行	10,100	1,709.00	17,260,900	
あおぞら銀行	7,700	2,784.00	21,436,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	938,400	566.40	531,509,760	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	149,600	477.30	71,404,080	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,400	3,965.00	108,641,000	
三井住友フィナンシャルグループ	96,100	3,850.00	369,985,000	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	46,900	597.00	27,999,300	
群馬銀行	27,300	368.00	10,046,400	
武蔵野銀行	2,000	1,900.00	3,800,000	
千葉興業銀行	3,900	317.00	1,236,300	
筑波銀行	5,800	203.00	1,177,400	
七十七銀行	4,300	1,701.00	7,314,300	
青森銀行	1,100	2,862.00	3,148,200	
秋田銀行	900	2,135.00	1,921,500	
山形銀行	1,500	1,525.00	2,287,500	
岩手銀行	1,000	2,631.00	2,631,000	
東邦銀行	12,200	259.00	3,159,800	
東北銀行	700	1,012.00	708,400	
みちのく銀行	900	1,667.00	1,500,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,000	2,108.00	25,296,000	
静岡銀行	33,800	834.00	28,189,200	
十六銀行	1,800	2,425.00	4,365,000	
スルガ銀行	14,200	486.00	6,901,200	
八十二銀行	32,900	472.00	15,528,800	
山梨中央銀行	1,700	1,056.00	1,795,200	
大垣共立銀行	2,900	2,521.00	7,310,900	
福井銀行	1,200	1,492.00	1,790,400	
北國銀行	1,400	3,100.00	4,340,000	
清水銀行	500	1,914.00	957,000	
富山銀行	200	2,527.00	505,400	

滋賀銀行	2,700	2,623.00	7,082,100
南都銀行	2,100	2,663.00	5,592,300
百五銀行	12,200	348.00	4,245,600
京都銀行	4,900	4,330.00	21,217,000
紀陽銀行	4,800	1,736.00	8,332,800
ほくほくフィナンシャルグループ	9,100	1,083.00	9,855,300
広島銀行	20,200	555.00	11,211,000
山陰合同銀行	8,100	663.00	5,370,300
中国銀行	11,800	1,068.00	12,602,400
鳥取銀行	500	1,426.00	713,000
伊予銀行	18,100	582.00	10,534,200
百十四銀行	1,500	2,241.00	3,361,500
四国銀行	1,900	1,030.00	1,957,000
阿波銀行	2,100	2,613.00	5,487,300
大分銀行	800	2,899.00	2,319,200
宮崎銀行	900	2,695.00	2,425,500
佐賀銀行	800	1,564.00	1,251,200
沖縄銀行	1,200	3,685.00	4,422,000
琉球銀行	3,200	1,200.00	3,840,000
セブン銀行	45,600	315.00	14,364,000
みずほフィナンシャルグループ	1,852,100	167.30	309,856,330
高知銀行	500	804.00	402,000
山口フィナンシャルグループ	17,000	758.00	12,886,000
長野銀行	400	1,658.00	663,200
名古屋銀行	1,100	3,245.00	3,569,500
北洋銀行	20,700	236.00	4,885,200
愛知銀行	500	3,610.00	1,805,000
中京銀行	600	2,148.00	1,288,800
大光銀行	500	1,683.00	841,500
愛媛銀行	1,900	1,128.00	2,143,200
トマト銀行	500	1,053.00	526,500
京葉銀行	5,800	669.00	3,880,200
栃木銀行	7,300	223.00	1,627,900
北日本銀行	400	1,811.00	724,400
東和銀行	2,400	874.00	2,097,600
福島銀行	1,400	224.00	313,600

大東銀行	700	582.00	407,400	
トモニホールディングス	10,500	371.00	3,895,500	
フィデアホールディングス	13,100	124.00	1,624,400	
池田泉州ホールディングス	14,500	197.00	2,856,500	
F P G	4,300	1,088.00	4,678,400	
マーキュリアインベストメント	600	783.00	469,800	
S B Iホールディングス	16,300	2,372.00	38,663,600	
ジャフコ	2,200	4,030.00	8,866,000	
大和証券グループ本社	109,300	502.30	54,901,390	
野村ホールディングス	240,000	503.90	120,936,000	
岡三証券グループ	11,700	394.00	4,609,800	
丸三証券	4,200	535.00	2,247,000	
東洋証券	5,300	175.00	927,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,800	311.00	4,913,800	
光世証券	400	607.00	242,800	
水戸証券	4,200	245.00	1,029,000	
いちよし証券	2,700	702.00	1,895,400	
松井証券	6,700	896.00	6,003,200	
だいこう証券ビジネス	600	588.00	352,800	
マネックスグループ	12,800	267.00	3,417,600	
極東証券	1,900	796.00	1,512,400	
岩井コスモホールディングス	1,400	1,143.00	1,600,200	
藍澤證券	2,500	749.00	1,872,500	
マネーパートナーズグループ	1,700	252.00	428,400	
スパークス・グループ	5,400	271.00	1,463,400	
かんぽ生命保険	4,900	1,730.00	8,477,000	
S O M P Oホールディングス	24,000	4,148.00	99,552,000	
アニコム ホールディングス	1,100	4,065.00	4,471,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,600	3,427.00	122,001,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,200	2,340.00	26,208,000	
第一生命ホールディングス	77,100	1,810.00	139,551,000	
東京海上ホールディングス	48,800	5,586.00	272,596,800	
T & Dホールディングス	42,200	1,222.00	51,568,400	
アドバンスクリエイト	300	1,875.00	562,500	
全国保証	3,800	4,490.00	17,062,000	

ジェイリース	400	316.00	126,400	
イントラスト	400	754.00	301,600	
日本モーゲージサービス	200	1,352.00	270,400	
C a s a	600	1,271.00	762,600	
アルヒ	1,300	2,337.00	3,038,100	
プレミアグループ	800	2,005.00	1,604,000	
クレディセゾン	9,600	1,561.00	14,985,600	
芙蓉総合リース	1,600	7,080.00	11,328,000	
みずほリース	2,600	3,005.00	7,813,000	
東京センチュリー	2,700	5,000.00	13,500,000	
日本証券金融	6,000	527.00	3,162,000	
アイフル	21,100	255.00	5,380,500	
リコーリース	1,100	3,520.00	3,872,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,700	1,643.00	14,294,100	
アコム	27,300	436.00	11,902,800	
ジャックス	1,500	2,455.00	3,682,500	
オリエントコーポレーション	37,100	147.00	5,453,700	
日立キャピタル	3,200	2,398.00	7,673,600	
アプラスフィナンシャル	6,800	90.00	612,000	
オリックス	90,900	1,650.00	149,985,000	
三菱UFJリース	30,600	665.00	20,349,000	
九州リースサービス	700	604.00	422,800	
日本取引所グループ	36,800	1,781.00	65,540,800	
イー・ギャランティ	1,300	1,488.00	1,934,400	
アサックス	500	629.00	314,500	
NECキャピタルソリューション	500	2,150.00	1,075,000	
いちご	17,300	438.00	7,577,400	
日本駐車場開発	15,100	162.00	2,446,200	
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,888.00	1,321,600	
ヒューリック	29,100	1,155.00	33,610,500	
三栄建築設計	500	1,524.00	762,000	
野村不動産ホールディングス	9,100	2,499.00	22,740,900	
三重交通グループホールディングス	2,800	589.00	1,649,200	
サムティ	1,900	2,005.00	3,809,500	
ディア・ライフ	1,800	518.00	932,400	
コーセーアールイー	400	759.00	303,600	

エー・ディー・ワークス	23,700	32.00	758,400	
日本商業開発	800	1,522.00	1,217,600	
プレサンスコーポレーション	2,100	1,755.00	3,685,500	
ユニゾホールディングス	2,100	5,120.00	10,752,000	
THEグローバル社	800	483.00	386,400	
ハウスコム	100	1,519.00	151,900	
日本管理センター	900	1,448.00	1,303,200	
サンセイランディック	400	923.00	369,200	
エストラスト	200	762.00	152,400	
フージャースホールディングス	3,000	672.00	2,016,000	
オープンハウス	4,000	2,817.00	11,268,000	
東急不動産ホールディングス	36,700	726.00	26,644,200	
飯田グループホールディングス	11,400	1,811.00	20,645,400	
イーランド	200	740.00	148,000	
ムゲンエステート	1,000	671.00	671,000	
ビーロッド	300	2,027.00	608,100	
ファーストブラザーズ	300	1,207.00	362,100	
ハウズドゥ	800	1,847.00	1,477,600	
シーアールイー	400	1,039.00	415,600	
プロパティエージェント	200	1,046.00	209,200	
ケイアイスター不動産	300	1,931.00	579,300	
アグレ都市デザイン	300	475.00	142,500	
グッドコムアセット	300	1,845.00	553,500	
ジェイ・エス・ビー	100	4,670.00	467,000	
テンポイノベーション	200	1,743.00	348,600	
グローバル・リンク・マネジメント	200	717.00	143,400	
パーク24	7,300	2,605.00	19,016,500	
パラカ	300	1,991.00	597,300	
三井不動産	72,400	2,715.50	196,602,200	
三菱地所	95,500	2,073.50	198,019,250	
平和不動産	2,500	2,713.00	6,782,500	
東京建物	14,900	1,570.00	23,393,000	
ダイビル	4,100	1,199.00	4,915,900	
京阪神ビルディング	2,400	1,409.00	3,381,600	
住友不動産	30,700	3,912.00	120,098,400	
テオーシー	3,100	803.00	2,489,300	

東京楽天地	200	5,980.00	1,196,000	
レオパレス21	17,000	289.00	4,913,000	
スターツコーポレーション	1,800	2,769.00	4,984,200	
フジ住宅	1,700	676.00	1,149,200	
空港施設	1,600	536.00	857,600	
明和地所	800	560.00	448,000	
ゴールドクレスト	1,100	2,223.00	2,445,300	
エスリード	500	1,960.00	980,000	
日神不動産	2,000	488.00	976,000	
日本エスコン	2,500	904.00	2,260,000	
タカラレーベン	6,300	440.00	2,772,000	
サンヨーハウジング名古屋	800	947.00	757,600	
イオンモール	6,800	1,769.00	12,029,200	
毎日コムネット	300	802.00	240,600	
ファースト住建	600	1,304.00	782,400	
カチタス	1,500	4,525.00	6,787,500	
トーセイ	1,900	1,355.00	2,574,500	
サンフロンティア不動産	1,900	1,312.00	2,492,800	
エフ・ジェー・ネクスト	1,200	1,112.00	1,334,400	
インテリックス	500	734.00	367,000	
ランドビジネス	600	753.00	451,800	
グランディハウス	1,200	473.00	567,600	
日本空港ビルデング	4,300	5,340.00	22,962,000	
日本工営	900	3,315.00	2,983,500	
LIFULL	4,600	641.00	2,948,600	
ジェイエイシーリクルートメント	900	2,018.00	1,816,200	
日本M&Aセンター	10,000	2,964.00	29,640,000	
メンバーズ	500	1,916.00	958,000	
中広	100	530.00	53,000	
アイティメディア	300	719.00	215,700	
タケエイ	1,400	1,058.00	1,481,200	
E・Jホールディングス	200	1,424.00	284,800	
トラスト・テック	1,500	1,346.00	2,019,000	
コシダカホールディングス	3,200	1,583.00	5,065,600	
アルトナー	300	740.00	222,000	
パソナグループ	1,600	1,468.00	2,348,800	

C D S	300	1,388.00	416,400
リンクアンドモチベーション	3,000	591.00	1,773,000
G C A	1,600	843.00	1,348,800
エス・エム・エス	4,900	2,785.00	13,646,500
サニーサイドアップ	300	977.00	293,100
パーソルホールディングス	13,200	2,063.00	27,231,600
リニカル	800	946.00	756,800
クックパッド	4,700	318.00	1,494,600
エスクリ	400	836.00	334,400
アイ・ケイ・ケイ	600	696.00	417,600
学情	500	1,515.00	757,500
スタジオアリス	700	1,912.00	1,338,400
シミックホールディングス	700	1,765.00	1,235,500
エプコ	200	1,343.00	268,600
N J S	300	1,618.00	485,400
総合警備保障	5,300	5,640.00	29,892,000
カカクコム	9,900	2,417.00	23,928,300
アイロムグループ	500	1,524.00	762,000
セントケア・ホールディング	1,000	514.00	514,000
サイネックス	200	682.00	136,400
ルネサンス	700	1,657.00	1,159,900
ディップ	2,100	2,976.00	6,249,600
オプトホールディング	700	1,663.00	1,164,100
新日本科学	1,800	627.00	1,128,600
ツクイ	3,100	439.00	1,360,900
キャリアデザインセンター	400	1,406.00	562,400
ベネフィット・ワン	3,600	2,140.00	7,704,000
エムスリー	27,800	2,675.00	74,365,000
ツカダ・グローバルホールディング	800	601.00	480,800
プラス	100	642.00	64,200
アウトソーシング	7,600	1,162.00	8,831,200
ウェルネット	1,200	717.00	860,400
ワールドホールディングス	400	1,801.00	720,400
ディー・エヌ・エー	7,100	1,837.00	13,042,700
博報堂D Yホールディングス	18,400	1,626.00	29,918,400
ぐるなび	1,900	790.00	1,501,000

タカミヤ	1,400	686.00	960,400
ジャパンベストレスキューシステム	900	1,086.00	977,400
ファンコミュニケーションズ	3,600	517.00	1,861,200
ライク	500	1,774.00	887,000
ビジネス・ブレークスルー	600	362.00	217,200
エスプール	2,500	632.00	1,580,000
W D Bホールディングス	600	2,815.00	1,689,000
ティア	800	598.00	478,400
C D G	100	1,380.00	138,000
バリューコマース	700	1,627.00	1,138,900
インフォマート	7,300	1,545.00	11,278,500
J Pホールディングス	3,700	296.00	1,095,200
エコナックホールディングス	2,500	126.00	315,000
E P Sホールディングス	2,000	1,306.00	2,612,000
レグス	400	1,442.00	576,800
プレステージ・インターナショナル	5,000	836.00	4,180,000
アミューズ	800	2,850.00	2,280,000
ドリームインキュベータ	400	1,617.00	646,800
クイック	800	1,501.00	1,200,800
T A C	700	200.00	140,000
ケネディクス	12,700	597.00	7,581,900
電通	13,600	3,865.00	52,564,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,253.00	626,500
ぴあ	400	4,645.00	1,858,000
イオンファンタジー	400	2,938.00	1,175,200
シーティーエス	1,500	793.00	1,189,500
ネクシィーズグループ	500	2,088.00	1,044,000
みらかホールディングス	3,700	2,621.00	9,697,700
アルプス技研	1,200	1,618.00	1,941,600
ダイオーズ	300	1,343.00	402,900
日本空調サービス	1,500	714.00	1,071,000
オリエンタルランド	15,600	16,405.00	255,918,000
ダスキン	3,400	2,866.00	9,744,400
明光ネットワークジャパン	1,600	941.00	1,505,600
ファルコホールディングス	700	1,638.00	1,146,600
秀英予備校	300	430.00	129,000

田谷	300	599.00	179,700
ラウンドワン	4,100	1,377.00	5,645,700
リゾートトラスト	5,600	1,730.00	9,688,000
ビー・エム・エル	1,700	3,175.00	5,397,500
ワタベウェディング	200	590.00	118,000
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,401.00	3,362,400
リソー教育	6,800	410.00	2,788,000
早稲田アカデミー	400	896.00	358,400
ユー・エス・エス	16,100	2,033.00	32,731,300
東京個別指導学院	500	840.00	420,000
サイバーエージェント	7,600	4,110.00	31,236,000
楽天	61,600	1,033.00	63,632,800
クリーク・アンド・リバー社	800	1,135.00	908,000
テー・オー・ダブリュー	1,100	772.00	849,200
山田コンサルティンググループ	600	1,805.00	1,083,000
セントラルスポーツ	500	3,210.00	1,605,000
フルキャストホールディングス	1,300	2,262.00	2,940,600
エン・ジャパン	1,900	4,520.00	8,588,000
リソルホールディングス	100	4,020.00	402,000
テクノプロ・ホールディングス	2,700	6,630.00	17,901,000
アトラ	300	354.00	106,200
インターワークス	300	524.00	157,200
アイ・アールジャパンホールディングス	500	3,785.00	1,892,500
Keeper 技研	500	1,489.00	744,500
ファーストロジック	300	629.00	188,700
三機サービス	300	955.00	286,500
Gunosy	900	1,780.00	1,602,000
デザインワン・ジャパン	300	321.00	96,300
イー・ガーディアン	700	1,710.00	1,197,000
リブセンス	1,000	294.00	294,000
ジャパンマテリアル	3,600	1,573.00	5,662,800
ベクトル	1,700	1,024.00	1,740,800
ウチヤマホールディングス	700	511.00	357,700
チャーム・ケア・コーポレーション	400	2,216.00	886,400
ライクキッズ	300	900.00	270,000
キャリアリンク	500	582.00	291,000

I B J	900	992.00	892,800
アサンテ	500	2,003.00	1,001,500
N・フィールド	900	630.00	567,000
バリューHR	200	3,285.00	657,000
M&Aキャピタルパートナーズ	500	6,810.00	3,405,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,345.00	807,000
E R Iホールディングス	400	801.00	320,400
アビスト	200	2,662.00	532,400
シグマクシス	600	1,486.00	891,600
ウィルグループ	900	1,015.00	913,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	228.00	433,200
リクルートホールディングス	94,600	3,535.00	334,411,000
エラン	800	1,710.00	1,368,000
土木管理総合試験所	600	449.00	269,400
ネットマーケティング	500	869.00	434,500
日本郵政	108,100	996.00	107,667,600
ベルシステム24ホールディングス	2,200	1,716.00	3,775,200
鎌倉新書	1,000	1,445.00	1,445,000
S M N	200	837.00	167,400
一蔵	100	693.00	69,300
L I T A L I C O	300	2,219.00	665,700
グローバルキッズCOMPANY	200	834.00	166,800
エボラブルアジア	600	1,960.00	1,176,000
アトラエ	300	3,290.00	987,000
ストライク	500	3,815.00	1,907,500
ソラスト	3,200	1,199.00	3,836,800
セラク	400	747.00	298,800
インソース	600	2,899.00	1,739,400
バイカレント・コンサルティング	900	5,630.00	5,067,000
Orchestra Holdings	300	1,081.00	324,300
アイモバイル	400	614.00	245,600
キャリアインデックス	500	451.00	225,500
MS - Japan	500	1,312.00	656,000
船場	300	989.00	296,700
グレイステクノロジー	500	3,005.00	1,502,500

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,000	2,902.00	2,902,000	
フルテック	200	1,297.00	259,400	
グリーンズ	500	1,313.00	656,500	
ツナググループ・ホールディングス	100	570.00	57,000	
GameWith	300	825.00	247,500	
ソウルドアウト	200	1,448.00	289,600	
MS&Consulting	200	1,003.00	200,600	
日総工産	900	1,318.00	1,186,200	
キュービーネットホールディングス	800	2,362.00	1,889,600	
RPAホールディングス	600	1,155.00	693,000	
スプリックス	400	1,473.00	589,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	600	978.00	586,800	
リログループ	7,200	2,572.00	18,518,400	
東祥	800	2,226.00	1,780,800	
エイチ・アイ・エス	2,100	2,822.00	5,926,200	
ラックランド	300	2,390.00	717,000	
共立メンテナンス	2,000	4,880.00	9,760,000	
イチネンホールディングス	1,400	1,321.00	1,849,400	
建設技術研究所	900	1,738.00	1,564,200	
スペース	900	1,251.00	1,125,900	
長大	500	1,131.00	565,500	
燦ホールディングス	600	1,112.00	667,200	
スバル興業	100	6,900.00	690,000	
東京テアトル	500	1,394.00	697,000	
タナベ経営	300	1,241.00	372,300	
ナガワ	400	6,550.00	2,620,000	
よみうりランド	300	4,525.00	1,357,500	
東京都競馬	900	3,400.00	3,060,000	
常磐興産	600	1,699.00	1,019,400	
カナモト	2,200	2,912.00	6,406,400	
東京ドーム	5,000	949.00	4,745,000	
西尾レントオール	1,300	2,835.00	3,685,500	
トランス・コスモス	1,500	2,656.00	3,984,000	
乃村工藝社	6,200	1,341.00	8,314,200	
藤田観光	600	2,864.00	1,718,400	

KNT - CTホールディングス	700	1,550.00	1,085,000	
日本管財	1,400	1,898.00	2,657,200	
トーカイ	1,300	2,366.00	3,075,800	
白洋舎	200	2,900.00	580,000	
セコム	14,000	9,834.00	137,676,000	
セントラル警備保障	600	6,150.00	3,690,000	
丹青社	2,500	1,143.00	2,857,500	
メイテック	1,600	5,560.00	8,896,000	
応用地質	1,400	1,185.00	1,659,000	
船井総研ホールディングス	2,700	2,603.00	7,028,100	
進学会ホールディングス	600	525.00	315,000	
オオバ	1,000	678.00	678,000	
いであ	300	1,408.00	422,400	
学究社	400	1,245.00	498,000	
ベネッセホールディングス	4,900	2,869.00	14,058,100	
イオンディライト	1,600	3,740.00	5,984,000	
ナック	800	984.00	787,200	
ニチイ学館	1,900	1,814.00	3,446,600	
ダイセキ	2,200	3,070.00	6,754,000	
ステップ	500	1,396.00	698,000	
合 計	16,236,600		32,604,968,140	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	161,793,334	202,582,188
金銭信託	231,905,007	-
コール・ローン	952,451,846	2,384,831,451
出資金	8,217,162	12,296,456
株式	86,957,039,121	177,647,670,078
投資証券	2,218,921,193	5,136,934,798
派生商品評価勘定	4,602,675	69,237,470
未収入金	107,998,029	-
未収配当金	77,429,302	148,294,724
差入委託証拠金	241,069,971	494,738,908
流動資産合計	90,961,427,640	186,096,586,073
資産合計	90,961,427,640	186,096,586,073
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	101,384,053	1,167,670
未払金	119,398,847	153,638,635
未払解約金	22,580,739	251,643,763
未払利息	1,498	653
流動負債合計	243,365,137	406,450,721
負債合計	243,365,137	406,450,721
純資産の部		
元本等		
元本	37,961,659,533	70,689,493,098
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	52,756,402,970	115,000,642,254
元本等合計	90,718,062,503	185,690,135,352
純資産合計	90,718,062,503	185,690,135,352
負債純資産合計	90,961,427,640	186,096,586,073

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>出資金、株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</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	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	34,878,791,197円	37,961,659,533円
	期首からの追加設定元本額	6,427,442,010円	36,194,127,723円
	期首からの一部解約元本額	3,344,573,674円	3,466,294,158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）	17,203,096,280円	18,485,318,413円
	DCインデックスバランス（株式20）	80,398,407円	110,473,619円
	DCインデックスバランス（株式40）	233,573,191円	288,784,765円
	DCインデックスバランス（株式60）	447,780,159円	556,652,830円
	DCインデックスバランス（株式80）	476,526,520円	572,308,634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	2,074,639,698円	2,058,555,229円
	日興五大陸株式ファンド	5,375,436,468円	5,072,486,309円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	18,815,844円	- 円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	93,227,038円	76,673,267円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	147,464,472円	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）	2,627,937,561円	6,832,365,259円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	25,916,934円	27,719,286,275円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,282,446円	4,902,712円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,311,945円	4,164,660円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,218,871円	7,452,502円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	6,309,667円	5,933,515円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,512,298,631円	4,144,203,181円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	26,918,914円	27,756,246円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	76,175,076円	78,838,200円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	112,997,773円	115,217,010円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	113,413,192円	110,705,145円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,291,920,446円	4,275,701,028円
計	37,961,659,533円	70,689,493,098円
2. 受益権の総数	37,961,659,533口	70,689,493,098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 2017年10月27日 至 2018年10月26日	自 2018年10月27日 至 2019年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年10月28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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引

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

(有価証券に関する注記)

(2018年10月26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	1,016,422
株式	417,790,428
投資証券	17,735,973
合計	401,070,877

(2019年10月28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	1,200,668
株式	12,825,500,893
投資証券	574,300,033
合計	13,398,600,258

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2018年10月26日現在)

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,601,502,112	-	1,504,603,584	96,898,528
合計		1,601,502,112	-	1,504,603,584	96,898,528

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,721,044,832	-	3,770,012,232	48,967,400
合計		3,721,044,832	-	3,770,012,232	48,967,400

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（2018年10月26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	1,305,740,850	-	1,305,858,000	117,150
	米ドル	1,168,581,175	-	1,171,604,500	3,023,325
	ユーロ	137,159,675	-	134,253,500	2,906,175

合計	1,305,740,850	-	1,305,858,000	117,150
----	---------------	---	---------------	---------

(2019年10月28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	3,178,621,600	-	3,197,724,000	19,102,400
	米ドル	2,595,425,300	-	2,612,990,000	17,564,700
	ユーロ	583,196,300	-	584,734,000	1,537,700
合計		3,178,621,600	-	3,197,724,000	19,102,400

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2.3897円	1口当たり純資産額	2.6268円
(1万口当たり純資産額)	(23,897円)	(1万口当たり純資産額)	(26,268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	22.07	347,690.78	
	BAKER HUGHES CO	28,145	22.38	629,885.10	
	CABOT OIL & GAS CORP	17,770	18.81	334,253.70	
	CHENIERE ENERGY INC	10,290	64.30	661,647.00	
	CHEVRON CORP	82,861	118.67	9,833,114.87	
	CIMAREX ENERGY CO	5,005	45.99	230,179.95	
	CONCHO RESOURCES INC	9,175	65.82	603,898.50	
	CONOCOPHILLIPS	49,560	56.35	2,792,706.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,310	29.26	96,850.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	18,101	21.47	388,628.47	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,280	87.46	636,708.80	
	EOG RESOURCES INC	24,762	72.48	1,794,749.76	
	EXXON MOBIL CORP	184,611	69.25	12,784,311.75	
	HALLIBURTON CO	40,547	20.48	830,402.56	
	HELMERICH & PAYNE	4,280	40.25	172,270.00	
	HESS CORP	10,710	66.78	715,213.80	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,740	57.42	444,430.80	
	KINDER MORGAN INC	91,070	20.42	1,859,649.40	
	MARATHON OIL CORP	36,877	11.98	441,786.46	
	MARATHON PETROLEUM CORP	29,562	68.01	2,010,511.62	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	16,021	20.85	334,037.85	
	NOBLE ENERGY INC	19,222	20.62	396,357.64	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,131	42.53	1,706,771.43	
	ONEOK INC	19,190	71.55	1,373,044.50	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,380	16.80	157,584.00	
	PHILLIPS 66	20,215	114.42	2,313,000.30	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,620	129.83	989,304.60		
SCHLUMBERGER LTD	59,011	35.09	2,070,695.99		
TARGA RESOURCES CORP	12,250	40.87	500,657.50		
TECHNIPFMC PLC	17,311	21.36	369,762.96		

VALERO ENERGY CORP	17,372	99.27	1,724,518.44
WILLIAMS COS INC	51,814	23.24	1,204,157.36
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,765	213.26	2,082,483.90
ALBEMARLE CORP	4,530	63.59	288,062.70
AMCOR PLC	71,820	9.72	698,090.40
AVERY DENNISON CORP	3,270	126.80	414,636.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,870	29.39	290,079.30
BALL CORP	12,990	71.91	934,110.90
CELANESE CORP	5,540	123.65	685,021.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,120	46.14	374,656.80
CORTEVA INC	31,502	26.73	842,048.46
CROWN HOLDINGS INC	6,965	69.93	487,062.45
DOW INC	32,125	50.48	1,621,670.00
DUPONT DE NEMOURS INC	31,982	66.85	2,137,996.70
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,125	76.28	467,215.00
ECOLAB INC	11,070	191.94	2,124,775.80
FMC CORP	5,320	83.98	446,773.60
FREEPORT-MCMORAN INC	56,728	10.14	575,221.92
INTERNATIONAL PAPER CO	16,760	43.00	720,680.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,355	119.96	522,425.80
LINDE PLC	23,640	195.00	4,609,800.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,300	90.83	1,117,209.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,865	268.33	768,765.45
MOSAIC CO/THE	17,490	20.54	359,244.60
NEWMONT GOLDCORP CORP	34,662	39.18	1,358,057.16
NUCOR CORP	13,279	53.82	714,675.78
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,710	110.93	411,550.30
PPG INDUSTRIES INC	10,354	124.04	1,284,310.16
SEALED AIR CORP	7,116	41.87	297,946.92
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,617	574.93	2,079,521.81
STEEL DYNAMICS INC	9,050	30.65	277,382.50
VULCAN MATERIALS CO	5,583	147.08	821,147.64
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,360	64.31	87,461.60
WESTROCK CO	13,449	38.01	511,196.49
3M CO	25,216	166.09	4,188,125.44

ACUITY BRANDS INC	1,510	124.90	188,599.00
AERCAP HOLDINGS NV	6,440	58.25	375,130.00
ALLEGION PLC	4,710	113.33	533,784.30
AMETEK INC	9,833	89.96	884,576.68
ARCONIC INC	17,563	27.64	485,441.32
BOEING CO/THE	23,252	339.83	7,901,727.16
CATERPILLAR INC	25,046	139.73	3,499,677.58
CUMMINS INC	6,375	178.52	1,138,065.00
DEERE & CO	13,390	173.11	2,317,942.90
DOVER CORP	6,500	103.65	673,725.00
EATON CORP PLC	17,596	85.62	1,506,569.52
EMERSON ELECTRIC CO	26,060	70.82	1,845,569.20
FASTENAL CO	24,606	37.18	914,851.08
FLOWSERVE CORP	5,495	48.69	267,551.55
FLUOR CORP	4,943	19.84	98,069.12
FORTIVE CORP	13,514	68.36	923,817.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,330	60.36	321,718.80
GENERAL DYNAMICS CORP	10,932	173.54	1,897,139.28
GENERAL ELECTRIC CO	381,903	9.00	3,437,127.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	40.34	361,043.00
HEICO CORP	1,500	118.64	177,960.00
HEICO CORP-CLASS A	4,070	92.57	376,759.90
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,616	171.63	5,426,254.08
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,440	221.19	318,513.60
IDEX CORP	3,580	158.72	568,217.60
ILLINOIS TOOL WORKS	14,315	171.81	2,459,460.15
INGERSOLL-RAND PLC	11,216	121.06	1,357,808.96
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,090	93.93	572,033.70
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,970	56.60	507,702.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	10,600	30.90	327,540.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,414	42.56	1,422,099.84
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,635	200.96	1,936,249.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,330	243.08	323,296.40
LOCKHEED MARTIN CORP	11,051	370.73	4,096,937.23
MASCO CORP	11,999	44.62	535,395.38

MIDDLEBY CORP	3,030	119.39	361,751.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,979	345.00	2,407,755.00
OWENS CORNING	4,700	62.68	294,596.00
PACCAR INC	14,754	76.89	1,134,508.83
PARKER HANNIFIN CORP	5,820	190.70	1,109,874.00
PENTAIR PLC	5,938	41.24	244,883.12
RAYTHEON COMPANY	12,212	212.15	2,590,775.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,333	177.38	945,967.54
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,580	334.47	1,531,872.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,030	51.08	359,092.40
SMITH (A.O.) CORP	4,990	51.07	254,839.30
SNAP-ON INC	2,170	166.64	361,608.80
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	3,810	78.13	297,675.30
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,056	151.35	1,067,925.60
TEXTRON INC	11,916	47.26	563,150.16
TRANSDIGM GROUP INC	2,130	523.45	1,114,948.50
UNITED RENTALS INC	3,670	135.38	496,844.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	35,578	142.96	5,086,230.88
WABCO HOLDINGS INC	2,630	134.83	354,602.90
WABTEC CORP	8,250	70.50	581,625.00
WW GRAINGER INC	1,897	317.34	601,993.98
XYLEM INC	8,868	83.30	738,704.40
CINTAS CORP	3,717	270.34	1,004,853.78
COPART INC	8,360	83.94	701,738.40
COSTAR GROUP INC	1,535	564.94	867,182.90
EQUIFAX INC	5,844	137.90	805,887.60
IHS MARKIT LTD	15,573	69.35	1,079,987.55
MANPOWERGROUP INC	2,437	91.00	221,767.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,295	20.60	315,077.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,350	86.03	890,410.50
ROBERT HALF INTL INC	4,995	57.92	289,310.40
ROLLINS INC	8,030	38.38	308,191.40
TRANSUNION	8,850	82.50	730,125.00
VERISK ANALYTICS INC	6,370	148.92	948,620.40
WASTE CONNECTIONS INC	11,456	91.33	1,046,276.48

WASTE MANAGEMENT INC	18,854	111.35	2,099,392.90
AMERCO	375	411.64	154,365.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,860	30.86	119,119.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,670	90.11	601,033.70
CSX CORP	33,073	72.32	2,391,839.36
DELTA AIR LINES INC	6,135	54.60	334,971.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,947	75.25	598,011.75
FEDEX CORP	11,048	158.09	1,746,578.32
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	116.75	525,375.00
KANSAS CITY SOUTHERN	3,840	144.49	554,841.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,600	38.66	177,836.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,630	188.25	2,189,347.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,940	186.60	548,604.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,860	56.74	332,496.40
UBER TECHNOLOGIES INC	7,540	32.71	246,633.40
UNION PACIFIC CORP	30,746	172.33	5,298,458.18
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,925	91.64	268,047.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,407	115.72	3,518,698.04
XPO LOGISTICS INC	3,850	79.72	306,922.00
APTIV PLC	11,340	89.58	1,015,837.20
AUTOLIV INC	4,250	82.07	348,797.50
BORGWARNER INC	9,890	39.72	392,830.80
FORD MOTOR COMPANY	163,905	8.72	1,429,251.60
GENERAL MOTORS CORP	57,955	36.74	2,129,266.70
HARLEY-DAVIDSON INC	6,229	39.39	245,360.31
LEAR CORP	2,710	124.22	336,636.20
TESLA INC	5,860	328.13	1,922,841.80
CAPRI HOLDINGS LTD	5,890	31.87	187,714.30
DR HORTON INC	15,026	53.71	807,046.46
GARMIN LTD	5,265	87.23	459,265.95
HANESBRANDS INC	12,690	15.89	201,644.10
HASBRO INC	5,168	96.01	496,179.68
LEGGETT & PLATT INC	4,778	45.25	216,204.50
LENNAR CORP-CL A	13,220	61.81	817,128.20
LULULEMON ATHLETICA INC	4,570	208.00	950,560.00

MOHAWK INDUSTRIES INC	2,488	144.13	358,595.44
NEWELL BRANDS INC	19,156	19.65	376,415.40
NIKE INC -CL B	54,588	90.92	4,963,140.96
NVR INC	140	3,727.75	521,885.00
POLARIS INC	1,930	101.37	195,644.10
PULTE GROUP INC	11,880	40.41	480,070.80
PVH CORP	3,580	92.77	332,116.60
RALPH LAUREN CORP	1,725	98.79	170,412.75
ROKU INC	3,700	133.74	494,838.00
TAPESTRY INC	10,656	26.45	281,851.20
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,060	21.06	211,863.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	9,412	19.06	179,392.72
VF CORP	15,350	84.15	1,291,702.50
WHIRLPOOL CORP	3,114	159.36	496,247.04
ARAMARK	9,390	44.22	415,225.80
CARNIVAL CORP	16,887	44.57	752,653.59
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,135	787.87	894,232.45
DARDEN RESTAURANTS INC	5,483	112.37	616,124.71
DOMINO'S PIZZA INC	2,000	271.75	543,500.00
H&R BLOCK INC	7,790	25.18	196,152.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,420	97.69	1,213,309.80
LAS VEGAS SANDS CORP	15,420	61.22	944,012.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	11,753	126.18	1,482,993.54
MCDONALD'S CORP	33,181	194.61	6,457,354.41
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,700	22.44	195,228.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,750	28.15	640,412.50
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	8,190	51.47	421,539.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,988	111.37	889,623.56
STARBUCKS CORP	52,584	83.38	4,384,453.92
VAIL RESORTS INC	1,690	236.03	398,890.70
WYNN RESORTS LTD	4,590	120.85	554,701.50
YUM! BRANDS INC	13,264	109.10	1,447,102.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	33,790	55.26	1,867,235.40
ALPHABET INC-CL A	13,070	1,264.30	16,524,401.00
ALPHABET INC-CL C	13,652	1,265.13	17,271,554.76

ALTICE USA INC- A	8,400	29.94	251,496.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	13,468	36.04	485,386.72
CHARTER COMMUNICATION-A	6,891	462.19	3,184,951.29
COMCAST CORP-CLASS A	196,964	45.65	8,991,406.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,730	27.57	157,976.10
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	17,930	25.60	459,008.00
DISH NETWORK CORP-A	9,729	34.76	338,180.04
ELECTRONIC ARTS INC	12,584	96.31	1,211,965.04
FACEBOOK INC-CLASS A	104,780	187.89	19,687,114.20
FOX CORP - CLASS A	13,334	32.41	432,154.94
FOX CORP- CLASS B	7,746	31.70	245,548.20
IAC/INTERACTIVECORP	3,470	226.83	787,100.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17,186	21.85	375,514.10
LIBERTY BROADBAND-C	5,240	116.15	608,626.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	24.37	184,846.45
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,871	23.21	484,415.91
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,470	41.41	309,332.70
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	8,020	43.75	350,875.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,315	43.44	144,003.60
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,660	69.06	390,879.60
NETFLIX INC	19,110	276.82	5,290,030.20
NEWS CORP - CLASS A	18,680	13.80	257,784.00
OMNICOM GROUP	10,017	76.82	769,505.94
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,730	6.44	436,181.20
SNAP INC - A	27,720	13.96	386,971.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,240	125.33	656,729.20
THE WALT DISNEY CO.	78,382	130.90	10,260,203.80
TRIPADVISOR INC	5,300	40.32	213,696.00
TWITTER INC	29,830	30.30	903,849.00
VIACOM INC-CLASS B	11,888	21.65	257,434.64
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	34.37	232,684.90
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,368	165.56	557,606.08
AMAZON.COM INC	18,235	1,761.33	32,117,852.55
AUTOZONE INC	1,047	1,129.47	1,182,555.09
BEST BUY CO INC	11,264	73.15	823,961.60

BOOKING HOLDINGS INC	1,888	2,055.93	3,881,595.84
BURLINGTON STORES INC	3,090	196.12	606,010.80
CARMAX INC	7,439	94.77	704,994.03
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	11,140	162.18	1,806,685.20
DOLLAR TREE INC	10,406	114.55	1,192,007.30
EBAY INC	35,127	35.84	1,258,951.68
EXPEDIA INC	6,602	137.06	904,870.12
GAP INC/THE	8,676	17.33	150,355.08
GENUINE PARTS CO	5,811	102.51	595,685.61
GRUBHUB INC	3,200	59.02	188,864.00
HOME DEPOT INC	47,860	234.38	11,217,426.80
KOHL'S CORP	7,462	53.96	402,649.52
L BRANDS INC	8,828	17.76	156,785.28
LKQ CORP	12,100	31.63	382,723.00
LOWE'S COS INC	34,662	111.58	3,867,585.96
MACY'S INC	13,499	15.58	210,314.42
MERCADOLIBRE INC	1,970	549.81	1,083,125.70
NORDSTROM INC	3,980	37.23	148,175.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,245	438.54	1,423,062.30
QURATE RETAIL INC	16,340	9.84	160,785.60
ROSS STORES INC	16,062	110.69	1,777,902.78
TARGET CORP	22,350	109.02	2,436,597.00
TIFFANY & CO	4,790	98.55	472,054.50
TJX COMPANIES INC	52,586	59.10	3,107,832.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,750	96.46	458,185.00
ULTA BEAUTY INC	2,610	240.90	628,749.00
WAYFAIR INC- CLASS A	2,530	118.19	299,020.70
COSTCO WHOLESALE CORP	19,109	296.50	5,665,818.50
KROGER CO	36,870	25.28	932,073.60
SYSCO CORP	20,886	79.17	1,653,544.62
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,462	55.42	1,909,884.04
WALMART INC	62,332	119.04	7,420,001.28
ALTRIA GROUP INC	81,978	46.80	3,836,570.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,953	41.01	1,064,332.53
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	13,770	64.28	885,135.60

BUNGE LTD	6,327	55.24	349,503.48
CAMPBELL SOUP CO	6,865	46.46	318,947.90
COCA-COLA CO/THE	176,252	53.75	9,473,545.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	9,300	54.19	503,967.00
CONAGRA BRANDS INC	22,860	26.92	615,391.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,500	195.84	1,468,800.00
GENERAL MILLS INC	25,619	50.51	1,294,015.69
HERSHEY CO/THE	6,445	143.31	923,632.95
HORMEL FOODS CORP	11,960	40.57	485,217.20
INGREDION INC	3,120	80.05	249,756.00
JM SMUCKER CO/THE	4,630	108.28	501,336.40
KELLOGG CO	11,938	60.89	726,904.82
KRAFT HEINZ CO/THE	30,041	28.38	852,563.58
LAMB WESTON HOLDING INC	6,370	75.00	477,750.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,135	159.38	818,416.30
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,870	56.84	504,170.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	62,455	52.77	3,295,750.35
MONSTER BEVERAGE CORP	17,370	56.35	978,799.50
PEPSICO INC	60,951	136.64	8,328,344.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	67,878	81.98	5,564,638.44
TYSON FOODS INC-CL A	13,586	78.48	1,066,229.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,360	74.89	850,750.40
CLOROX COMPANY	5,406	151.40	818,468.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	35,780	68.41	2,447,709.80
COTY INC-CL A	10,350	11.76	121,716.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,550	188.63	1,801,416.50
KIMBERLY-CLARK CORP	15,063	134.20	2,021,454.60
PROCTER & GAMBLE CO	109,149	123.25	13,452,614.25
ABBOTT LABORATORIES	76,646	81.65	6,258,145.90
ABIOMED INC	1,570	182.34	286,273.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,080	243.38	749,610.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,464	86.80	647,875.20
ANTHEM INC	11,141	263.07	2,930,862.87
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,719	77.28	1,601,164.32
BECTON DICKINSON AND CO	11,837	244.30	2,891,779.10

BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,928	40.85	2,448,058.80
CARDINAL HEALTH INC	14,485	50.05	724,974.25
CENTENE CORP	19,720	48.23	951,095.60
CERNER CORP	13,960	66.43	927,362.80
CIGNA CORP	16,630	171.49	2,851,878.70
COOPER COS INC/THE	2,200	281.75	619,850.00
CVS HEALTH CORP	56,588	65.10	3,683,878.80
DANAHER CORP	27,959	135.87	3,798,789.33
DAVITA INC	5,038	57.83	291,347.54
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	53.07	610,468.65
DEXCOM INC	3,600	147.39	530,604.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,070	228.21	2,069,864.70
HCA HEALTHCARE INC	12,005	126.27	1,515,871.35
HENRY SCHEIN INC	6,170	62.25	384,082.50
HOLOGIC INC	12,828	47.49	609,201.72
HUMANA INC	5,865	288.09	1,689,647.85
IDEXX LABORATORIES INC	3,840	268.29	1,030,233.60
INTUITIVE SURGICAL INC	5,055	549.27	2,776,559.85
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,735	165.69	784,542.15
MCKESSON CORP	8,314	145.96	1,213,511.44
MEDTRONIC PLC	58,258	105.44	6,142,723.52
QUEST DIAGNOSTICS	6,386	100.63	642,623.18
RESMED INC	6,140	144.26	885,756.40
STERIS PLC	3,420	138.01	471,994.20
STRYKER CORP	14,583	211.62	3,086,054.46
TELEFLEX INC	1,780	321.88	572,946.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	41,340	244.91	10,124,579.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,380	137.93	466,203.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,684	120.30	563,485.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,230	146.77	767,607.10
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,170	279.75	607,057.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,012	134.07	1,208,238.84
ABBVIE INC	64,566	76.53	4,941,235.98
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,880	75.39	1,121,803.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,850	105.18	1,036,023.00

ALKERMES PLC	8,550	19.48	166,554.00
ALLERGAN PLC	14,385	173.84	2,500,688.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,260	89.25	380,205.00
AMGEN INC	26,491	203.05	5,378,997.55
BEIGENE LTD-ADR	1,840	138.89	255,557.60
BIOGEN INC	8,693	288.04	2,503,931.72
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,430	71.19	600,131.70
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	71,511	54.98	3,931,674.78
CELGENE CORP	30,784	105.21	3,238,784.64
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	14,986	26.87	402,673.82
ELI LILLY & CO	37,974	110.20	4,184,734.80
EXACT SCIENCES CORP	5,500	89.89	494,395.00
GILEAD SCIENCES INC	55,664	63.32	3,524,644.48
ILLUMINA INC	6,400	290.64	1,860,096.00
INCYTE CORP	8,180	77.55	634,359.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,140	53.89	330,884.60
IQVIA HOLDINGS INC	7,013	147.51	1,034,487.63
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,330	123.85	288,570.50
JOHNSON & JOHNSON	115,631	128.35	14,841,238.85
MERCK & CO. INC.	111,993	82.26	9,212,544.18
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,125	698.19	785,463.75
MYLAN NV	26,285	18.70	491,529.50
NEKTAR THERAPEUTICS	9,130	16.68	152,288.40
PERKINELMER INC	4,880	86.23	420,802.40
PERRIGO CO PLC	5,039	54.05	272,357.95
PFIZER INC	242,380	36.77	8,912,312.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,450	306.21	1,056,424.50
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,700	85.75	231,525.00
SEATTLE GENETICS INC	4,870	102.62	499,759.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	44,220	8.03	355,086.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,374	296.68	5,154,518.32
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,280	194.49	2,193,847.20
WATERS CORP	2,826	218.11	616,378.86
ZOETIS INC	20,730	124.36	2,577,982.80
BANK OF AMERICA CORP	394,139	31.72	12,502,089.08

BB&T CORP	33,528	53.58	1,796,430.24
CIT GROUP INC	4,145	43.99	182,338.55
CITIGROUP INC	100,997	73.17	7,389,950.49
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,180	35.85	723,453.00
COMERICA INC	7,850	65.59	514,881.50
EAST WEST BANCORP INC	7,460	43.57	325,032.20
FIFTH THIRD BANCORP	33,759	29.05	980,698.95
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,410	107.65	797,686.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	41,490	14.48	600,775.20
JPMORGAN CHASE & CO	141,490	126.03	17,831,984.70
KEYCORP	47,768	18.20	869,377.60
M & T BANK CORP	5,603	156.58	877,317.74
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	16,360	16.82	275,175.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,790	146.67	2,902,599.30
REGIONS FINANCIAL CORP	41,254	16.40	676,565.60
SIGNATURE BANK	2,310	121.57	280,826.70
SUNTRUST BANKS INC	18,967	69.09	1,310,430.03
SVB FINANCIAL GROUP	2,030	219.79	446,173.70
US BANCORP	66,201	56.74	3,756,244.74
WELLS FARGO & CO	186,380	51.57	9,611,616.60
ZIONS BANCORP NA	9,240	47.95	443,058.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,200	77.34	170,148.00
ALLY FINANCIAL INC	15,270	30.82	470,621.40
AMERICAN EXPRESS CO	30,914	118.26	3,655,889.64
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,910	149.45	883,249.50
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,900	22.20	264,180.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,002	46.38	1,716,152.76
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,550	211.80	11,977,290.00
BLACKROCK INC	5,005	459.80	2,301,299.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	19,915	93.25	1,857,073.75
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,210	114.10	594,461.00
CME GROUP INC	15,520	200.46	3,111,139.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,180	80.14	1,136,385.20
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,630	41.05	436,361.50
EATON VANCE CORP	5,440	45.49	247,465.60

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	254.07	444,622.50
FRANKLIN RESOURCES INC	11,655	27.83	324,358.65
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,428	214.23	3,090,910.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,650	91.96	2,266,814.00
INVESCO LTD	15,877	17.05	270,702.85
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	11,015	18.91	208,293.65
KKR & CO INC -A	22,350	28.15	629,152.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,690	344.07	581,478.30
MOODY'S CORP	7,567	216.01	1,634,547.67
MORGAN STANLEY	55,345	46.37	2,566,347.65
MSCI INC	3,820	222.20	848,804.00
NASDAQ INC	5,765	98.43	567,448.95
NORTHERN TRUST CORP	9,520	101.53	966,565.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,000	84.48	506,880.00
S&P GLOBAL INC	10,682	249.27	2,662,702.14
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,854	40.98	2,206,936.92
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,385	59.60	320,946.00
STATE STREET CORP	16,607	65.75	1,091,910.25
SYNCHRONY FINANCIAL	28,360	35.29	1,000,824.40
T ROWE PRICE GROUP INC	11,055	113.71	1,257,064.05
TD AMERITRADE HOLDING CORP	10,670	38.65	412,395.50
VOYA FINANCIAL INC	6,040	53.99	326,099.60
AFLAC INC	33,434	53.26	1,780,694.84
ALLEGHANY CORP	630	757.69	477,344.70
ALLSTATE CORP	13,843	107.24	1,484,523.32
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,240	102.21	331,160.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,515	52.80	2,033,592.00
AON PLC	10,652	188.65	2,009,499.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,425	40.80	710,940.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,160	89.45	729,912.00
ASSURANT INC	2,080	125.57	261,185.60
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,320	42.00	265,440.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,804	38.21	183,560.84
CHUBB LTD	19,935	149.14	2,973,105.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,310	111.65	816,161.50

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	185.66	220,935.40
EVEREST RE GROUP LTD	1,694	248.59	421,111.46
FNF GROUP	12,811	45.53	583,284.83
GLOBE LIFE INC	5,426	96.39	523,012.14
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,522	56.80	881,649.60
LINCOLN NATIONAL CORP	7,573	61.59	466,421.07
LOEWS CORP	13,585	51.00	692,835.00
MARKEL CORP	635	1,110.77	705,338.95
MARSH & MCLENNAN COS	22,223	97.57	2,168,298.11
METLIFE INC	34,045	46.32	1,576,964.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,910	54.51	594,704.10
PROGRESSIVE CORP	25,350	69.30	1,756,755.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,772	91.75	1,630,581.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,440	157.21	383,592.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,887	183.72	346,679.64
TRAVELERS COS INC/THE	11,754	130.43	1,533,074.22
UNUM GROUP	8,138	28.49	231,851.62
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,488	184.98	1,015,170.24
WR BERKLEY CORP	7,244	69.44	503,023.36
CBRE GROUP INC - A	14,560	52.61	766,001.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	56,500	5.40	305,100.00
JONES LANG LASALLE INC	2,120	146.29	310,134.80
ACCENTURE PLC-CL A	27,708	183.07	5,072,503.56
ADOBE INC	21,209	270.98	5,747,214.82
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,540	89.15	583,041.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,040	104.80	213,792.00
ANSYS INC	3,630	220.25	799,507.50
AUTODESK INC	9,190	145.54	1,337,512.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,071	161.96	3,088,739.16
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,770	123.55	589,333.50
CADENCE DESIGN SYS INC	12,030	65.10	783,153.00
CDK GLOBAL INC	5,890	49.70	292,733.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,460	108.32	591,427.20
CITRIX SYSTEMS INC	5,338	105.64	563,906.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,938	60.46	1,447,291.48

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,230	100.05	123,061.50	
DOCUSIGN INC	4,660	65.40	304,764.00	
DROPBOX INC-CLASS A	6,480	19.73	127,850.40	
DXC TECHNOLOGY CO	9,803	28.31	277,522.93	
EPAM SYSTEMS INC	2,340	176.15	412,191.00	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,688	129.32	3,451,292.16	
FISERV INC	24,974	102.51	2,560,084.74	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,530	298.88	1,055,046.40	
FORTINET INC	5,730	80.48	461,150.40	
GARTNER INC	3,900	146.04	569,556.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,439	161.34	2,168,248.26	
GODADDY INC-CLASS A	8,370	65.40	547,398.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	38,762	135.44	5,249,925.28	
INTUIT INC	11,366	257.67	2,928,677.22	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,950	139.53	551,143.50	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,260	79.98	420,694.80	
MASTERCARD INC	39,540	270.19	10,683,312.60	
MICROSOFT CORP	317,084	140.73	44,623,231.32	
MONGODB INC	1,660	125.78	208,794.80	
OKTA INC	4,070	107.99	439,519.30	
ORACLE CORP	104,283	54.17	5,649,010.11	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,550	224.65	1,022,157.50	
PAYCHEX INC	14,212	84.53	1,201,340.36	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,200	209.67	461,274.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	48,747	107.19	5,225,190.93	
PTC INC	3,690	67.75	249,997.50	
SABRE CORP	10,440	21.81	227,696.40	
SALESFORCE.COM INC	36,295	150.49	5,462,034.55	
SERVICENOW INC	8,200	241.22	1,978,004.00	
SPLUNK INC	6,340	119.58	758,137.20	
SQUARE INC - A	15,390	62.89	967,877.10	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,590	51.24	593,871.60	
SYMANTEC CORP	27,555	22.69	625,222.95	
SYNOPSYS INC	6,467	137.14	886,884.38	
TWILIO INC - A	5,300	106.98	566,994.00	

VERISIGN INC	4,810	190.16	914,669.60
VISA INC-CLASS A SHARES	75,682	177.85	13,460,043.70
VMWARE INC	3,795	159.19	604,126.05
WESTERN UNION CO	19,111	24.82	474,335.02
WIX.COM LTD	1,980	120.72	239,025.60
WORKDAY INC-CLASS A	6,830	160.75	1,097,922.50
AMPHENOL CORP-CL A	12,830	100.23	1,285,950.90
APPLE INC	200,512	246.58	49,442,248.96
ARISTA NETWORKS INC	2,530	244.36	618,230.80
ARROW ELECTRONICS INC	3,320	77.17	256,204.40
CDW CORP/DE	5,760	124.86	719,193.60
CISCO SYSTEMS INC	186,680	46.90	8,755,292.00
COGNEX CORP	8,270	52.50	434,175.00
CORNING INC	36,988	30.51	1,128,503.88
DELL TECHNOLOGIES -C	5,742	51.68	296,746.56
F5 NETWORKS INC	2,825	143.55	405,528.75
FLEX LTD	18,516	11.61	214,970.76
FLIR SYSTEMS INC	5,685	54.17	307,956.45
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	60,245	16.16	973,559.20
HP INC	64,795	17.33	1,122,897.35
IPG PHOTONICS CORP	1,840	143.07	263,248.80
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	25.23	465,569.19
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,960	101.28	806,188.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,955	163.41	1,136,516.55
NETAPP INC	11,346	56.01	635,489.46
SEAGATE TECHNOLOGY	11,144	56.91	634,260.76
TE CONNECTIVITY LTD	15,575	94.10	1,465,607.50
TRIMBLE INC	8,980	38.99	350,130.20
WESTERN DIGITAL CORP	13,408	61.23	820,971.84
XEROX HOLDINGS CORP	8,148	30.51	248,595.48
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,190	219.08	479,785.20
AT&T INC	317,717	36.91	11,726,934.47
CENTURYLINK INC	39,676	12.89	511,423.64
SPRINT CORP	33,770	6.38	215,452.60
T-MOBILE US INC	15,642	81.62	1,276,700.04

VERIZON COMMUNICATIONS INC	179,937	60.37	10,862,796.69
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	10,290	34.28	352,741.20
AES CORP	25,998	16.80	436,766.40
ALLIANT ENERGY CORP	9,050	53.18	481,279.00
AMEREN CORPORATION	10,652	76.59	815,836.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,898	94.35	1,971,726.30
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,305	121.11	1,005,818.55
ATMOS ENERGY CORP	5,480	112.30	615,404.00
CENTERPOINT ENERGY INC	19,962	29.54	589,677.48
CMS ENERGY CORP	12,590	63.65	801,353.50
CONSOLIDATED EDISON INC	14,846	93.32	1,385,428.72
DOMINION ENERGY INC	34,791	81.89	2,849,034.99
DTE ENERGY COMPANY	7,808	128.21	1,001,063.68
DUKE ENERGY CORP	31,546	95.43	3,010,434.78
EDISON INTERNATIONAL	15,789	66.05	1,042,863.45
ENTERGY CORP	8,637	120.27	1,038,771.99
EVERGY INC	10,050	63.50	638,175.00
EVERSOURCE ENERGY	14,260	85.31	1,216,520.60
EXELON CORP	43,196	45.89	1,982,264.44
FIRSTENERGY CORP	22,145	48.01	1,063,181.45
NEXTERA ENERGY INC	20,795	236.88	4,925,919.60
NISOURCE INC	17,890	28.04	501,635.60
NRG ENERGY INC	11,980	40.81	488,903.80
OGE ENERGY CORP	7,900	43.05	340,095.00
PINNACLE WEST CAPITAL	5,629	94.20	530,251.80
PPL CORP	31,448	33.22	1,044,702.56
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,458	62.90	1,412,608.20
SEMPRA ENERGY	12,287	143.97	1,768,959.39
SOUTHERN CO	45,055	61.35	2,764,124.25
UGI CORP	9,220	48.19	444,311.80
VISTRA ENERGY CORP	14,940	27.10	404,874.00
WEC ENERGY GROUP INC	13,890	93.79	1,302,743.10
XCEL ENERGY INC	22,784	63.64	1,449,973.76
ADVANCED MICRO DEVICES	44,890	32.71	1,468,351.90
ANALOG DEVICES INC	16,210	106.83	1,731,714.30

	APPLIED MATERIALS INC	39,913	55.72	2,223,952.36	
	BROADCOM INC	17,310	289.82	5,016,784.20	
	INTEL CORP	195,402	56.46	11,032,396.92	
	KLA CORP	7,269	169.94	1,235,293.86	
	LAM RESEARCH CORP	6,517	270.05	1,759,915.85	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	27,664	24.75	684,684.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,030	57.16	630,474.80	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,844	93.90	1,018,251.60	
	MICRON TECHNOLOGY INC	47,827	48.03	2,297,130.81	
	NVIDIA CORP	25,295	204.54	5,173,839.30	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,927	105.86	1,368,452.22	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,620	19.18	337,951.60	
	QORVO INC	4,760	79.02	376,135.20	
	QUALCOMM INC	53,182	80.17	4,263,600.94	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,890	90.06	620,513.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	40,952	120.51	4,935,125.52	
	XILINX INC	10,475	94.90	994,077.50	
	米ドル小計	13,094,972		1,118,525,024.36	(121,695,522,650)
加ドル	CAMECO CORP	19,892	11.92	237,112.64	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,124	34.02	1,705,218.48	
	CENOVUS ENERGY INC	38,273	11.46	438,608.58	
	ENBRIDGE INC	88,587	47.65	4,221,170.55	
	ENCANA CORP	48,808	5.56	271,372.48	
	HUSKY ENERGY INC	17,673	9.30	164,358.90	
	IMPERIAL OIL LTD	12,902	33.26	429,120.52	
	INTER PIPELINE LTD	16,700	22.17	370,239.00	
	KEYERA CORP	7,360	30.38	223,596.80	
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,402	46.50	995,193.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,890	14.98	103,212.20	
	SUNCOR ENERGY INC	71,189	39.78	2,831,898.42	
	TC ENERGY CORP	40,863	66.74	2,727,196.62	
	TOURMALINE OIL CORP	11,075	11.54	127,805.50	
	VERMILION ENERGY INC	6,550	20.36	133,358.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,805	76.73	905,797.65	

BARRICK GOLD CORP	74,274	22.47	1,668,936.78
CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	53.48	427,840.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,400	10.99	367,066.00
FRANCO-NEVADA CORP	7,595	125.13	950,362.35
KINROSS GOLD CORP	57,165	6.29	359,567.85
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,760	59.70	522,972.00
LUNDIN MINING CORP	35,450	6.82	241,769.00
METHANEX CORP	2,760	48.24	133,142.40
NUTRIEN LTD	26,108	64.49	1,683,704.92
TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	21.80	553,175.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,460	59.92	147,403.20
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18,095	35.89	649,429.55
BOMBARDIER INC 'B'	91,096	1.61	146,664.56
CAE INC	14,195	33.13	470,280.35
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,175	19.91	122,944.25
WSP GLOBAL INC	3,500	81.22	284,270.00
THOMSON REUTERS CORP	9,046	86.35	781,122.10
AIR CANADA	4,800	45.99	220,752.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,628	116.23	3,676,122.44
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,205	296.48	1,839,658.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,538	70.78	958,219.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	33.88	337,106.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,278	89.29	917,722.62
STARS GROUP INC/THE	12,310	26.51	326,338.10
QUEBECOR INC -CL B	6,060	29.62	179,497.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,045	25.72	541,277.40
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,560	143.30	366,848.00
DOLLARAMA INC	14,590	45.38	662,094.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	39,460	39.81	1,570,902.60
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	34.75	288,077.50
LOBLAW COMPANIES LTD	8,629	69.60	600,578.40
METRO INC	12,760	54.92	700,779.20
WESTON (GEORGE) LTD	2,998	106.06	317,967.88
SAPUTO INC	10,250	37.61	385,502.50
AURORA CANNABIS INC	38,070	4.99	189,969.30

BAUSCH HEALTH COS INC	13,194	30.73	405,451.62
CANOPY GROWTH CORP	8,750	28.53	249,637.50
CRONOS GROUP INC	7,240	11.69	84,635.60
BANK OF MONTREAL	27,261	98.10	2,674,304.10
BANK OF NOVA SCOTIA	53,549	75.13	4,023,136.37
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,455	112.07	2,068,251.85
NATIONAL BANK OF CANADA	16,230	67.47	1,095,038.10
ROYAL BANK OF CANADA	62,319	106.02	6,607,060.38
TORONTO-DOMINION BANK	79,970	75.16	6,010,545.20
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	37,433	70.35	2,633,411.55
CI FINANCIAL CORP	9,570	19.17	183,456.90
IGM FINANCIAL INC	3,295	36.85	121,420.75
ONEX CORPORATION	3,805	76.51	291,120.55
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,160	554.63	643,370.80
GREAT-WEST LIFE CO INC	14,894	31.17	464,245.98
IA FINANCIAL CORP INC	3,855	62.07	239,279.85
INTACT FINANCIAL CORP	6,255	132.60	829,413.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	82,651	24.48	2,023,296.48
POWER CORP OF CANADA	12,630	30.47	384,836.10
POWER FINANCIAL CORP	9,665	30.69	296,618.85
SUN LIFE FINANCIAL INC	25,584	58.40	1,494,105.60
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,720	21.92	125,382.40
BLACKBERRY LTD	27,808	6.81	189,372.48
CGI INC	10,470	102.06	1,068,568.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	835	1,305.01	1,089,683.35
OPEN TEXT CORP	13,510	52.29	706,437.90
SHOPIFY INC - CLASS-A	4,310	414.58	1,786,839.80
BCE INC	6,980	60.91	425,151.80
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,735	61.17	962,509.95
TELUS CORP	7,466	46.01	343,510.66
ALTAGAS LTD	11,800	18.81	221,958.00
ATCO LTD -CLASS I	3,260	46.86	152,763.60
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,330	38.39	166,228.70
EMERA INC	12,030	54.54	656,116.20
FORTIS INC	19,925	53.98	1,075,551.50

	HYDRO ONE LTD	13,000	24.23	314,990.00
加ドル小計		1,801,912		81,583,024.70 (6,791,786,806)
ユーロ	ENI SPA	116,266	14.04	1,632,374.64
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,185	14.26	330,618.10
	NESTE OYJ	19,170	32.65	625,900.50
	OMV AG	6,310	52.18	329,255.80
	REPSOL SA	58,939	14.99	883,495.61
	TENARIS SA	19,815	9.40	186,340.26
	TOTAL SA	104,527	47.69	4,985,415.26
	VOPAK	3,530	48.84	172,405.20
	AIR LIQUIDE SA	20,720	116.80	2,420,096.00
	AKZO NOBEL	9,927	82.92	823,146.84
	ARCELORMITTAL	26,232	14.05	368,559.60
	ARKEMA	3,145	92.94	292,296.30
	BASF SE	40,315	70.62	2,847,045.30
	COVESTRO AG	9,190	46.69	429,081.10
	CRH PLC	35,340	32.99	1,165,866.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,800	24.60	167,280.00
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,920	34.16	99,747.20
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	66.02	498,120.90
	IMERYS SA	830	34.82	28,900.60
	KONINKLIJKE DSM NV	7,802	108.60	847,297.20
	LANXESS AG	3,295	61.48	202,576.60
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,140	29.84	272,737.60
	SOLVAY SA	3,701	101.70	376,391.70
	STORA ENSO OYJ-R SHS	27,755	12.25	340,137.52
	SYMRISE AG	6,470	86.60	560,302.00
	THYSSENKRUPP AG	19,305	13.37	258,204.37
	UMICORE	8,650	37.14	321,261.00
	UPM-KYMMENE OYJ	25,138	29.74	747,604.12
	VOESTALPINE AG	4,239	22.97	97,369.83
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,456	36.41	453,522.96
	AIRBUS GROUP SE	25,568	123.52	3,158,159.36
	ALSTOM	9,320	37.80	352,296.00

ANDRITZ AG	3,810	39.38	150,037.80
BOUYGUES SA	8,880	38.81	344,632.80
BRENTAG AG	6,625	45.39	300,708.75
CNH INDUSTRIAL NV	47,220	9.96	470,688.96
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,356	37.04	791,026.24
DASSAULT AVIATION SA	135	1,209.00	163,215.00
EIFFAGE	3,680	96.00	353,280.00
FERROVIAL SA	23,945	26.25	628,556.25
GEA GROUP AG	6,580	27.69	182,200.20
HOCHTIEF AG	870	109.40	95,178.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,770	46.60	268,882.00
KION GROUP AG	2,380	58.82	139,991.60
KNORR-BREMSE AG	1,770	94.29	166,893.30
KONE OYJ-B	13,804	56.34	777,717.36
LEGRAND SA	12,518	69.82	874,006.76
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	22,040	10.53	232,081.20
METSO OYJ	4,110	34.26	140,808.60
MTU AERO ENGINES AG	2,430	233.50	567,405.00
PRYSMIAN SPA	10,595	20.49	217,091.55
SAFRAN SA	14,520	139.30	2,022,636.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,478	83.86	2,052,725.08
SIEMENS AG-REG	33,526	104.40	3,500,114.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	12.34	145,177.20
THALES SA	4,675	87.04	406,912.00
VINCI SA	22,070	100.65	2,221,345.50
WARTSILA OYJ ABP	21,180	9.26	196,296.24
BUREAU VERITAS SA	14,440	22.45	324,178.00
EDENRED	10,346	45.80	473,846.80
RANDSTAD NV	5,235	50.14	262,482.90
SOCIETE BIC SA	955	63.50	60,642.50
TELEPERFORMANCE	2,760	201.40	555,864.00
WOLTERS KLUWER	13,377	64.40	861,478.80
ADP	1,130	168.00	189,840.00
AENA SA	3,010	165.00	496,650.00
ATLANTIA SPA	23,620	21.77	514,207.40

BOLLORE	34,310	3.89	133,740.38
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	15.89	189,786.30
DEUTSCHE POST AG-REG	42,063	32.02	1,346,857.26
FRAPORT AG	1,680	74.46	125,092.80
GETLINK	17,870	15.17	271,087.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,195	69.43	985,558.85
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	56.20	161,856.00
CONTINENTAL AG	5,225	124.14	648,631.50
DAIMLER AG	38,862	52.88	2,055,022.56
FAURECIA	2,770	45.05	124,788.50
FERRARI NV	5,664	140.25	794,376.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	45,947	11.84	544,380.05
MICHELIN (CGDE)-B	7,199	107.30	772,452.70
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,535	26.97	122,308.95
PEUGEOT SA	23,410	24.84	581,504.40
PIRELLI & C SPA	14,070	5.59	78,651.30
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	6,110	65.74	401,671.40
RENAULT SA	8,677	49.03	425,433.31
VALEO SA	9,660	33.89	327,377.40
VOLKSWAGEN AG	1,521	170.80	259,786.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,713	172.36	1,329,412.68
ADIDAS AG	7,911	275.15	2,176,711.65
ESSILORLUXOTTICA	12,175	134.55	1,638,146.25
HERMES INTERNATIONAL	1,297	653.20	847,200.40
HUGO BOSS AG -ORD	2,070	37.58	77,790.60
KERING	3,447	514.00	1,771,758.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,144	383.95	4,662,688.80
MONCLER SPA	8,620	36.17	311,785.40
PUMA SE	3,260	65.95	214,997.00
SEB SA	770	139.80	107,646.00
ACCOR SA	8,656	38.60	334,121.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,650	89.86	327,989.00
SODEXO	3,380	97.38	329,144.40
EUTELSAT COMMUNICATIONS	5,925	18.34	108,664.50
JC DECAUX SA	2,720	23.92	65,062.40

PUBLICIS GROUPE	8,535	38.79	331,072.65
RTL GROUP	1,470	44.14	64,885.80
SES	15,290	17.54	268,186.60
TELENET GROUP HOLDING NV	2,110	42.00	88,620.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	46.94	140,820.00
VIVENDI	40,450	24.88	1,006,396.00
DELIVERY HERO SE	5,320	44.35	235,942.00
INDITEX	46,965	28.28	1,328,170.20
PROSUS	21,200	62.50	1,325,000.00
ZALANDO SE	7,390	41.68	308,015.20
CARREFOUR SA	30,103	15.73	473,670.70
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,304	46.29	106,652.16
COLRUYT SA	2,315	50.42	116,722.30
JERONIMO MARTINS	8,855	14.93	132,205.15
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	50,178	22.81	1,144,811.07
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	7,040	14.52	102,256.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,321	73.68	2,455,091.28
DANONE	27,944	73.96	2,066,738.24
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	24,900	8.18	203,682.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,485	85.90	385,261.50
HEINEKEN NV	11,593	92.00	1,066,556.00
KERRY GROUP PLC-A	7,310	109.00	796,790.00
PERNOD-RICARD SA	9,506	159.30	1,514,305.80
REMY COINTREAU	810	118.30	95,823.00
BEIERSDORF AG	4,205	103.65	435,848.25
HENKEL AG & CO KGAA	5,210	83.50	435,035.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,283	92.30	672,220.90
L'OREAL	11,071	243.30	2,693,574.30
UNILEVER NV	63,795	53.24	3,396,445.80
BIOMERIEUX	1,820	71.65	130,403.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	97.00	184,300.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,583	59.34	568,655.22
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,815	43.44	730,443.60
KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,401	39.66	1,642,170.66
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,570	176.30	276,791.00

SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,680	37.82	214,817.60
BAYER AG-REG	40,874	66.54	2,719,755.96
EUROFINS SCIENTIFIC	470	441.40	207,458.00
GRIFOLS SA	12,270	27.80	341,106.00
IPSEN	1,330	93.90	124,887.00
MERCK KGAA	5,260	106.50	560,190.00
ORION OYJ-CLASS B	5,150	39.05	201,107.50
QIAGEN N.V.	10,894	26.00	283,244.00
RECORDATI SPA	4,230	36.86	155,917.80
SANOFI	49,216	83.40	4,104,614.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,120	131.00	146,720.00
UCB SA	4,528	69.78	315,963.84
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,560	16.97	281,106.00
AIB GROUP PLC	42,660	2.99	127,553.40
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	294,673	4.88	1,439,477.60
BANCO DE SABADELL SA	227,252	1.01	230,547.15
BANCO SANTANDER SA	736,679	3.98	2,933,455.77
BANK OF IRELAND GROUP PLC	40,719	4.19	170,938.36
BANKIA SA	56,390	1.77	100,233.22
BANKINTER SA	23,710	6.28	149,088.48
BNP PARIBAS	49,332	47.69	2,352,643.08
CAIXABANK S.A	146,150	2.54	372,244.05
COMMERZBANK AG	48,544	5.46	265,244.41
CREDIT AGRICOLE SA	43,722	11.98	523,789.56
ERSTE GROUP BANK AG	11,618	32.28	375,029.04
FINECOBANK SPA	25,930	10.16	263,448.80
ING GROEP NV-CVA	163,855	10.37	1,700,159.48
INTESA SANPAOLO	657,293	2.27	1,493,698.34
KBC GROEP NV	10,999	64.70	711,635.30
MEDIOBANCA SPA	20,820	10.84	225,792.90
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	22.51	174,677.60
SOCIETE GENERALE	31,419	26.20	823,334.89
UNICREDIT SPA	93,136	11.53	1,074,230.62
AMUNDI SA	3,300	64.80	213,840.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	86,765	7.17	622,799.17

DEUTSCHE BOERSE AG	8,680	141.65	1,229,522.00
EURAZEO SE	1,877	61.95	116,280.15
EXOR NV	5,564	62.14	345,746.96
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,672	88.78	237,220.16
NATIXIS	49,540	4.12	204,154.34
WENDEL	1,010	123.70	124,937.00
AEGON NV	86,259	4.00	345,036.00
AGEAS	9,104	51.92	472,679.68
ALLIANZ SE-REG	18,568	221.55	4,113,740.40
ASSICURAZIONI GENERALI	44,878	18.35	823,735.69
AXA	82,622	24.30	2,008,127.71
CNP ASSURANCES	6,040	18.14	109,565.60
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	158.20	483,301.00
MAPFRE SA	35,184	2.59	91,196.92
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,356	250.10	1,589,635.60
NN GROUP NV	11,090	34.23	379,610.70
POSTE ITALIANE SPA	25,780	10.86	279,970.80
SAMPO OYJ-A SHS	21,389	36.00	770,004.00
SCOR SE	7,452	38.12	284,070.24
AROUNDTOWN SA	46,620	7.41	345,640.68
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,830	33.51	563,973.30
VONOVIA SE	23,358	47.15	1,101,329.70
ADYEN NV	480	629.40	302,112.00
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	67.06	1,230,551.00
ATOS SE	3,460	67.54	233,688.40
CAP GEMINI SA	6,909	101.50	701,263.50
DASSAULT SYSTEMES SA	6,280	134.15	842,462.00
SAP SE	42,972	119.22	5,123,121.84
WIRECARD AG	5,480	114.50	627,460.00
WORLDLINE SA	3,120	57.35	178,932.00
INGENICO GROUP	2,900	94.12	272,948.00
NOKIA OYJ	240,966	3.45	832,417.04
CELLNEX TELECOM SA	10,780	38.84	418,695.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	146,236	16.00	2,340,653.41
DRILLISCH AG	1,640	23.90	39,196.00

	ELISA OYJ	6,135	48.70	298,774.50	
	ILIAD SA	890	92.44	82,271.60	
	KONINKLIJKE KPN NV	153,006	2.89	442,646.35	
	ORANGE S.A.	83,624	14.68	1,227,600.32	
	PROXIMUS	8,290	26.77	221,923.30	
	TELECOM ITALIA SPA	352,713	0.53	187,996.02	
	TELECOM ITALIA-RSP	211,957	0.52	111,616.55	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,570	2.89	94,355.29	
	TELEFONICA SA	196,249	7.15	1,403,769.09	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,700	28.93	193,831.00	
	E.ON SE	90,679	8.91	808,131.24	
	EDF	21,825	9.29	202,754.25	
	ENAGAS SA	12,350	20.87	257,744.50	
	ENDESA SA	11,770	23.91	281,420.70	
	ENEL SPA	352,217	6.88	2,423,252.96	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	98,571	3.62	357,615.58	
	ENGIE	77,534	14.92	1,157,194.95	
	FORTUM OYJ	21,025	21.47	451,406.75	
	IBERDROLA SA	263,312	9.21	2,426,683.39	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	23.63	358,041.76	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,720	18.34	306,728.40	
	RWE AG	22,395	27.54	616,758.30	
	SNAM SPA	86,480	4.55	393,743.44	
	SUEZ	12,499	13.75	171,861.25	
	TERNA SPA	54,797	5.88	322,535.14	
	UNIPER SE	7,650	28.33	216,724.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,474	23.01	540,136.74	
	VERBUND AG	2,990	48.64	145,433.60	
	ASML HOLDING NV	18,612	237.85	4,426,864.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,835	17.58	911,362.97	
	STMICROELECTRONICS NV	33,663	20.21	680,329.23	
ユーロ小計		8,334,011		175,884,884.89	(21,202,922,873)
英債券	BP PLC	889,178	5.12	4,552,591.36	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	190,258	23.25	4,424,449.79	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	163,799	23.24	3,806,688.76
WOOD GROUP (JOHN) PLC	29,210	3.40	99,372.42
ANGLO AMERICAN PLC	46,624	20.15	939,706.72
ANTOFAGASTA PLC	14,940	8.70	130,067.64
BHP GROUP PLC	90,251	16.57	1,495,639.57
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	48.20	295,514.20
EVRAZ PLC	27,180	3.84	104,398.38
FRESNILLO PLC	8,070	6.81	54,988.98
GLENCORE PLC	486,213	2.34	1,138,953.95
JOHNSON MATTHEY PLC	6,669	31.09	207,339.21
MONDI PLC	21,700	15.75	341,883.50
RIO TINTO PLC	47,685	41.18	1,963,668.30
ASHTED GROUP PLC	18,690	22.69	424,076.10
BAE SYSTEMS PLC ORD	132,645	5.58	741,220.26
BUNZL PLC	14,996	20.01	300,069.96
DCC PLC	3,950	71.44	282,188.00
FERGUSON PLC	10,352	65.32	676,192.64
MEGGITT PLC	27,315	6.18	168,915.96
MELROSE INDUSTRIES PLC	199,080	2.12	423,443.16
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,535	7.12	509,901.48
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT-C(N)	3,290,610	0.00	3,290.61
SMITHS GROUP PLC	21,173	16.08	340,461.84
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	75.95	299,243.00
WEIR GROUP PLC/THE	10,140	13.78	139,729.20
EXPERIAN PLC	37,048	23.91	885,817.68
G4S PLC	58,799	2.10	123,654.29
INTERTEK GROUP PLC	6,335	51.42	325,745.70
RELX PLC	86,975	18.47	1,606,863.12
RENTOKIL INITIAL PLC	72,430	4.42	320,213.03
EASYJET PLC	6,550	12.03	78,829.25
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	49,140	6.46	317,444.40
BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	44.06	294,320.80
BURBERRY GROUP PLC	19,084	20.22	385,878.48
PERSIMMON PLC	16,300	23.50	383,050.00
TAYLOR WIMPEY PLC	146,790	1.67	245,286.09

CARNIVAL PLC	6,090	32.29	196,646.10
COMPASS GROUP PLC	68,158	19.94	1,359,070.52
GVC HOLDINGS PLC	27,190	8.77	238,619.44
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,273	46.34	290,690.82
MERLIN ENTERTAINME	25,700	4.54	116,883.60
TUI AG-DI	22,603	10.07	227,725.22
WHITBREAD PLC	5,410	41.02	221,918.20
AUTO TRADER GROUP PLC	33,020	5.65	186,761.12
INFORMA PLC	54,470	7.73	421,488.86
ITV PLC	197,275	1.35	268,096.72
PEARSON PLC	29,059	6.75	196,148.25
WPP PLC	60,674	9.74	591,207.45
KINGFISHER PLC	114,937	2.12	244,470.99
MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,664	1.83	118,529.11
NEXT PLC	6,767	67.12	454,201.04
OCADO GROUP PLC	20,770	13.25	275,202.50
SAINSBURY (J) PLC	72,601	2.12	154,131.92
TESCO PLC	449,364	2.39	1,076,676.14
WM MORRISON SUPERMARKETS	86,455	2.01	173,861.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,985	21.92	306,551.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	100,437	27.09	2,720,838.33
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,420	23.27	195,933.40
DIAGEO PLC	103,162	31.21	3,219,686.02
IMPERIAL BRANDS PLC	38,352	18.20	698,006.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,525	58.30	1,779,607.50
UNILEVER PLC	48,647	46.31	2,253,085.80
NMC HEALTH PLC	3,660	24.69	90,365.40
SMITH & NEPHEW PLC	38,156	16.91	645,408.74
ASTRAZENECA PLC	57,043	73.83	4,211,484.69
GLAXOSMITHKLINE PLC	217,341	17.00	3,694,797.00
BARCLAYS PLC	765,191	1.70	1,303,579.38
HSBC HOLDINGS PLC	883,951	6.17	5,457,513.47
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,134,236	0.60	1,880,541.60
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	188,330	2.25	425,249.14
STANDARD CHARTERED PLC	118,990	6.92	823,410.80

	3I GROUP PLC	45,549	10.97	499,672.53
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,830	17.39	188,387.85
	INVESTEC PLC	36,485	4.43	161,628.55
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,227	68.18	901,816.86
	M&G PLC	109,522	2.25	246,643.54
	SCHRODERS PLC	4,101	31.00	127,131.00
	ST JAMES' S PLACE PLC	20,690	10.23	211,762.15
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	2.97	370,334.38
	ADMIRAL GROUP PLC	6,455	20.14	130,003.70
	AVIVA PLC	184,725	4.20	777,507.52
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	2.82	207,640.11
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	241,801	2.70	653,588.10
	PRUDENTIAL PLC	109,522	13.91	1,523,451.02
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	5.22	288,151.18
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	13,079	10.49	137,251.02
	SAGE GROUP PLC/THE	38,650	7.07	273,410.10
	HALMA PLC	18,330	18.58	340,571.40
	BT GROUP PLC	350,552	2.01	706,362.28
	VODAFONE GROUP PLC	1,177,928	1.60	1,891,752.36
	CENTRICA PLC	272,675	0.72	197,798.44
	NATIONAL GRID PLC	153,458	9.03	1,387,106.86
	SEVERN TRENT PLC	11,503	23.00	264,569.00
	SSE PLC	49,417	13.01	642,915.17
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	28,615	8.68	248,378.20
英債券小計		16,590,491		77,727,319.02 (10,846,847,369)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,550	21.45	161,947.50
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	290	626.00	181,540.00
	GIVAUDAN-REG	398	2,846.00	1,132,708.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	20,679	49.99	1,033,743.21
	SIKA AG-REG	5,360	164.25	880,380.00
	ABB LTD-REG	77,875	20.94	1,630,702.50
	GEBERIT AG-REG	1,720	491.60	845,552.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	226.00	237,300.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,560	233.10	363,636.00

ADECCO GROUP AG-REG	6,547	58.86	385,356.42		
SGS SA-REG	258	2,546.00	656,868.00		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,550	162.60	414,630.00		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	21,999	75.02	1,650,364.98		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,040	271.30	282,152.00		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,870	51.90	97,053.00		
DUFREY AG-REG	1,570	86.48	135,773.60		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	2,068.00	155,100.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	48	7,165.00	343,920.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	79,600.00	318,400.00		
NESTLE SA-REG	133,623	104.68	13,987,655.64		
ALCON INC	17,924	58.16	1,042,459.84		
SONOVA HOLDING AG-REG	2,610	223.20	582,552.00		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	857.40	411,552.00		
LONZA GROUP AG-REG	3,158	348.70	1,101,194.60		
NOVARTIS AG-REG	93,813	86.90	8,152,349.70		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,678	294.55	9,036,204.90		
VIFOR PHARMA AG	1,840	154.45	284,188.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	108,668	12.53	1,361,610.04		
JULIUS BAER GROUP LTD	8,370	43.60	364,932.00		
PARGESA HOLDING SA-BR	1,295	76.60	99,197.00		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	885	760.40	672,954.00		
UBS GROUP AG-REG	164,662	11.74	1,933,955.19		
BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	180.80	450,192.00		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,600	488.30	781,280.00		
SWISS RE AG	13,529	104.25	1,410,398.25		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,641	390.70	2,594,638.70		
SWISS PRIME SITE-REG	2,551	100.50	256,375.50		
TEMENOS AG	2,850	143.20	408,120.00		
SWISSCOM AG-REG	1,154	507.00	585,078.00		
スイスフラン小計	751,264		56,424,014.57 (6,172,787,193)		
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	7,310	319.30	2,334,083.00	
	BOLIDEN AB	9,430	257.45	2,427,753.50	
	ALFA LAVAL AB	13,200	222.90	2,942,280.00	

	ASSA ABLOY AB-B	44,650	225.00	10,046,250.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,255	334.20	9,777,021.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,780	294.30	4,644,054.00	
	EPIROC AB-A	29,345	106.10	3,113,504.50	
	EPIROC AB-B	14,810	101.35	1,500,993.50	
	SANDVIK AB	46,040	168.20	7,743,928.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,960	208.00	2,487,680.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	178.50	3,553,756.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	60,850	145.85	8,874,972.50	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	153.65	2,247,745.85	
	ELECTROLUX AB - B	8,065	266.20	2,146,903.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,680	74.50	1,093,660.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,848	205.50	7,161,264.00	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	427.70	1,809,171.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,100	454.50	3,681,450.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,485	305.30	8,085,870.50	
	NORDEA BANK ABP	137,412	72.44	9,954,125.28	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	69,270	95.66	6,626,368.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	67,010	98.48	6,599,144.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	36,770	141.50	5,202,955.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,870	210.20	1,233,874.00	
	INVESTOR AB-B SHS	21,495	493.00	10,597,035.00	
	KINNEVIK AB - B	12,405	263.90	3,273,679.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	362.40	1,442,352.00	
	ERICSSON LM-B SHS	129,365	87.10	11,267,691.50	
	HEXAGON AB-B SHS	10,500	481.10	5,051,550.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,330	426.00	992,580.00	
	TELE2 AB-B SHS	21,615	143.35	3,098,510.25	
	TELIA CO AB	122,530	43.60	5,342,308.00	
	スウェーデンクローナ小計	1,054,128		156,354,514.38	(1,755,861,196)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	3,800	257.80	979,640.00	
	EQUINOR ASA	42,924	175.30	7,524,577.20	
	NORSK HYDRO A S	62,840	32.76	2,058,638.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,800	358.20	2,793,960.00	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	243.20	1,250,048.00	
	MOWI ASA	20,670	228.00	4,712,760.00	
	ORKLA ASA	38,170	85.50	3,263,535.00	
	DNB ASA	40,535	167.70	6,797,719.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,030	173.45	1,219,353.50	
	TELENOR ASA	34,555	173.30	5,988,381.50	
ノルウェークローネ小計		263,464		36,588,613.10	(432,843,292)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,680	521.20	2,439,216.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	9,075	316.50	2,872,237.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	8,360	546.80	4,571,248.00	
	ISS A/S	7,930	174.90	1,386,957.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	195	8,005.00	1,560,975.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	253	8,552.00	2,163,656.00	
	DSV PANALPINA A S	9,770	639.00	6,243,030.00	
	PANDORA A/S	4,560	316.00	1,440,960.00	
	CARLSBERG AS-B	4,630	957.80	4,434,614.00	
	COLOPLAST-B	5,825	796.80	4,641,360.00	
	DEMANT A/S	4,440	172.20	764,568.00	
	GENMAB A/S	2,630	1,424.00	3,745,120.00	
	H LUNDBECK A/S	2,450	225.70	552,965.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	76,945	364.05	28,011,827.25	
	DANSKE BANK A/S	31,805	98.60	3,135,973.00	
TRYG A/S	6,075	185.90	1,129,342.50		
ORSTED A/S	7,690	630.00	4,844,700.00		
デンマーククローネ小計		187,313		73,938,749.25	(1,193,371,412)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	8,355	27.69	231,349.95	
	OIL SEARCH LTD	68,980	7.25	500,105.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,720	7.97	547,698.40	
	SANTOS LTD	79,625	8.18	651,332.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	44,633	32.56	1,453,250.48	
	WORLEYPARSONS LTD	12,600	13.69	172,494.00	
	ALUMINA LTD	107,822	2.34	252,303.48	
	BHP GROUP LTD	129,066	35.77	4,616,690.82	

BLUESCOPE STEEL LTD	18,750	12.88	241,500.00
BORAL LTD	42,795	4.88	208,839.60
FORTESCUE METALS GROUP LTD	57,895	8.82	510,633.90
INCITEC PIVOT LTD	75,040	3.46	259,638.40
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	18,225	25.57	466,013.25
NEWCREST MINING LTD	34,449	32.43	1,117,181.07
ORICA LIMITED	20,325	23.68	481,296.00
RIO TINTO LTD	18,988	90.81	1,724,300.28
SOUTH32 LTD	194,147	2.60	504,782.20
CIMIC GROUP LTD	4,887	34.26	167,428.62
BRAMBLES LTD	64,688	12.23	791,134.24
SEEK LTD	11,730	22.04	258,529.20
AURIZON HOLDINGS LTD	95,170	5.87	558,647.90
SYDNEY AIRPORT	51,686	8.85	457,421.10
TRANSURBAN GROUP	117,559	14.71	1,729,292.89
ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,560	32.30	1,116,288.00
CROWN RESORTS LTD	19,095	12.24	233,722.80
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,630	43.25	70,497.50
TABCORP HOLDINGS LTD	97,874	4.84	473,710.16
REA GROUP LTD	1,800	109.82	197,676.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	12,062	4.12	49,695.44
WESFARMERS LTD	51,575	41.05	2,117,153.75
COLES GROUP LTD	51,925	14.96	776,798.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	53,412	37.93	2,025,917.16
COCA-COLA AMATIL LTD	17,820	10.26	182,833.20
TREASURY WINE ESTATES LTD	26,956	18.02	485,747.12
COCHLEAR LTD	2,917	207.42	605,044.14
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,855	69.10	473,680.50
SONIC HEALTHCARE LTD	20,390	28.71	585,396.90
CSL LTD	19,642	256.77	5,043,476.34
AUST AND NZ BANKING GROUP	126,189	28.03	3,537,077.67
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	14,130	9.08	128,300.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	17,778	10.88	193,424.64
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	76,697	80.70	6,189,447.90
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,783	29.18	3,582,807.94

	WESTPAC BANKING CORP	150,651	29.05	4,376,411.55	
	AMP LTD	156,627	1.85	290,543.08	
	ASX LTD	7,715	83.17	641,656.55	
	CHALLENGER LTD	20,840	7.73	161,093.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	15,914	134.98	2,148,071.72	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,540	50.63	229,860.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	92,475	8.04	743,499.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	104,360	3.41	355,867.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,820	12.71	709,472.20	
	SUNCORP GROUP LTD	56,606	13.51	764,747.06	
	COMPUTERSHARE LTD	25,050	16.03	401,551.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	171,384	3.56	610,127.04	
	TPG TELECOM LTD	7,840	6.69	52,449.60	
	AGL ENERGY LTD	28,301	19.71	557,812.71	
	APA GROUP	53,448	11.67	623,738.16	
	AUSNET SERVICES	69,210	1.85	128,038.50	
豪ドル小計		3,143,006		58,765,498.51 (4,360,987,644)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	30,583	4.60	140,681.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	36,555	8.95	327,167.25	
	A2 MILK CO LTD	30,340	12.74	386,531.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,590	18.93	465,488.70	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,200	12.75	181,050.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,377	4.44	356,873.88	
	MERIDIAN ENERGY LTD	55,650	4.81	267,676.50	
ニュージーランドドル小計		272,295		2,125,469.73 (146,912,467)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	119,708	72.20	8,642,917.60	
	NWS HOLDINGS LTD	82,500	11.88	980,100.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	60,000	56.85	3,411,000.00	
	MTR CORP	82,000	44.55	3,653,100.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	21.45	525,525.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	52.30	4,340,900.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,400	12.54	356,136.00	
	SANDS CHINA LTD	121,400	38.65	4,692,110.00	

SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	7.88	220,640.00		
SJM HOLDINGS LTD	82,000	8.27	678,140.00		
WYNN MACAU LTD	55,800	16.84	939,672.00		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	47,000	29.70	1,395,900.00		
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	40,000	31.35	1,254,000.00		
WH GROUP LTD	389,500	7.65	2,979,675.00		
BANK OF EAST ASIA	45,040	18.94	853,057.60		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	158,500	27.20	4,311,200.00		
HANG SENG BANK LTD	31,800	167.20	5,316,960.00		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	241.20	12,735,360.00		
AIA GROUP LTD	528,390	74.75	39,497,152.50		
CK ASSET HOLDINGS LTD	122,708	53.40	6,552,607.20		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,000	16.86	1,331,940.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	38.05	2,773,883.05		
HYSAN DEVELOPMENT CO	25,000	30.90	772,500.00		
KERRY PROPERTIES LTD	31,950	25.00	798,750.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	283,666	11.18	3,171,385.88		
SINO LAND CO	143,050	12.40	1,773,820.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	72,480	114.80	8,320,704.00		
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	73.35	1,284,871.95		
SWIRE PROPERTIES LTD	39,200	24.20	948,640.00		
WHARF HOLDINGS LTD	42,800	18.08	773,824.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	47,800	45.20	2,160,560.00		
WHEELLOCK & CO LTD	29,600	47.55	1,407,480.00		
HKT TRUST AND HKT LTD	153,000	12.50	1,912,500.00		
PCCW LTD	231,000	4.65	1,074,150.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	27,000	54.55	1,472,850.00		
CLP HOLDINGS LTD	75,000	81.50	6,112,500.00		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	93,500	7.71	720,885.00		
HONG KONG & CHINA GAS	427,434	15.30	6,539,740.20		
POWER ASSETS HOLDINGS	59,000	54.75	3,230,250.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,700	107.30	1,148,110.00		
香港ドル小計	4,144,644		151,065,496.98 (2,096,789,098)		
シンガポールド	KEPPEL CORP LTD	62,360	6.91	430,907.60	

ル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.32	48,720.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,000	3.97	202,470.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	71,300	2.42	172,546.00	
	SATS LTD	22,000	4.99	109,780.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	21,800	9.13	199,034.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	212,600	0.92	196,655.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,250	2.23	125,437.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,500	31.53	110,355.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.22	28,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	84,360	3.71	312,975.60	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	77,915	25.18	1,961,899.70	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	140,840	10.76	1,515,438.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	52,800	26.09	1,377,552.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	36,800	8.85	325,680.00	
	CAPITALAND LTD	109,900	3.63	398,937.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,200	10.74	184,728.00	
	UOL GROUP LTD	15,650	7.77	121,600.50	
	VENTURE CORP LTD	9,700	15.29	148,313.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,080	3.27	1,161,111.60	
シンガポールドル小計	1,552,055		9,132,740.90	(728,975,378)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	36,890	16.20	597,618.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	570.30	684,360.00	
	BANK HAPOLIM BM	60,335	28.21	1,702,050.35	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	53,225	25.62	1,363,624.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	41,400	16.34	676,476.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	87.84	430,416.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,610	275.00	442,750.00	
	NICE LTD	2,455	537.50	1,319,562.50	
イスラエルシュケル小計	202,015		7,216,857.35	(222,062,700)	
合 計	51,391,570		177,647,670,078	(177,647,670,078)	

(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	113,018.90	
	出資金小計		5,737.00	113,018.90 (12,296,456)	
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	22,170	366,691.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,140	813,405.00	
		AMERICAN TOWER CORP	19,189	4,157,680.63	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	66,040	580,491.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,845	1,282,451.45	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,937	916,932.66	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,830	435,968.90	
		CROWN CASTLE INTL CORP	18,230	2,570,430.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,835	1,173,464.70	
		DUKE REALTY CORPORATION	17,385	600,825.60	
		EQUINIX INC	3,668	2,075,134.32	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,580	522,110.40	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,790	1,384,467.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,960	962,266.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,500	617,265.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,755	383,055.20	
		HCP INC	21,815	791,884.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	29,879	498,381.72	
		INVITATION HOMES INC	19,500	602,355.00	
		IRON MOUNTAIN INC	12,895	439,590.55	
		KIMCO REALTY CORPORATION	20,575	435,161.25	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,083	408,757.31	
		MACERICH CO/THE	4,120	117,420.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,800	650,304.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,390	369,917.10	
PROLOGIS INC	27,672	2,514,277.92			
PUBLIC STORAGE	6,619	1,548,846.00			
REALTY INCOME CORP	12,970	1,049,013.60			

		REGENCY CENTERS CORP	8,145	557,932.50	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,860	1,186,569.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,654	2,124,016.24	
		SL GREEN REALTY CORP	3,450	285,832.50	
		SUN COMMUNITIES INC	3,850	606,105.50	
		UDR INC	10,870	537,195.40	
		VENTAS INC	14,645	966,570.00	
		VEREIT INC	47,904	467,543.04	
		VORNADO REALTY TRUST	8,131	522,660.68	
		WELLTOWER INC	18,200	1,600,872.00	
		WEYERHAEUSER CO	33,338	968,802.28	
		WP CAREY INC	7,400	678,876.00	
		投資証券小計	561,619	38,771,524.95	(4,218,341,914)
米ドル小計			567,356	38,884,543.85	(4,230,638,370)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,690	150,123.60	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,660	149,820.20	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	54,198.30	
加ドル小計			14,040	354,142.10	(29,482,329)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,665	166,167.00	
		GECINA SA	2,350	354,615.00	
		ICADE	1,175	102,107.50	
		KLEPIERRE	7,522	251,310.02	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,350	898,525.00	
ユーロ小計			19,062	1,772,724.52	(213,701,940)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	34,331	210,792.34	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	317,377.93	
		SEGRO PLC	45,073	370,680.35	
英ポンド小計			113,538	898,850.62	(125,434,604)
豪ドル	投資証券	DEXUS	42,687	516,512.70	
		GOODMAN GROUP	64,202	919,372.64	
		GPT GROUP	87,135	550,693.20	

		LENDLEASE GROUP	28,927	523,000.16	
		MIRVAC GROUP	208,775	663,904.50	
		SCENTRE GROUP	206,171	804,066.90	
		STOCKLAND	115,500	552,090.00	
		VICINITY CENTRES	123,402	330,717.36	
豪ドル小計			876,799	4,860,357.46 (360,687,127)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	93,500	7,947,500.00	
香港ドル小計			93,500	7,947,500.00 (110,311,300)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	88,600	282,634.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	92,140	188,887.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	132,400	344,240.00	
		SUNTEC REIT	91,400	173,660.00	
シンガポールドル小計			404,540	989,421.00 (78,975,584)	
合計				5,149,231,254 (5,149,231,254)	

(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	96.7%			66.6%
	投資証券 40銘柄			3.3%	2.3%
加ドル	株式 87銘柄	99.6%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 238銘柄	99.0%			11.6%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
英ポンド	株式 96銘柄	98.9%			5.9%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.4%

スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%			1.0%
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%			0.7%
豪ドル	株式	59銘柄	92.4%			2.4%
	投資証券	8銘柄			7.6%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	40銘柄	95.0%			1.1%
	投資証券	1銘柄			5.0%	0.1%
シンガポールドル	株式	20銘柄	90.2%			0.4%
	投資証券	4銘柄			9.8%	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。

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

貸借対照表

（単位：円）

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	51,897,794	46,217,539
金銭信託	41,634,297	-
コール・ローン	170,995,284	284,451,793
株式	6,327,724,845	8,158,784,232
投資証券	162,570,443	237,520,855
派生商品評価勘定	39,065,779	7,164,956
未収入金	9,232,010	-
未収配当金	5,787,810	7,140,505
差入委託証拠金	55,461,137	124,863,937
流動資産合計	6,864,369,399	8,866,143,817
資産合計	6,864,369,399	8,866,143,817
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	58,701,960	151,159,863
未払金	10,068,734	-
未払解約金	2,580,812	3,629,327
未払利息	269	77
流動負債合計	71,351,775	154,789,267
負債合計	71,351,775	154,789,267
純資産の部		
元本等		
元本	4,317,838,768	4,930,561,728
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,475,178,856	3,780,792,822
元本等合計	6,793,017,624	8,711,354,550
純資産合計	6,793,017,624	8,711,354,550
負債純資産合計	6,864,369,399	8,866,143,817

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

		2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	3,576,957,718円	4,317,838,768円
	期首からの追加設定元本額	1,161,111,188円	1,023,341,795円

期首からの一部解約元本額	420,230,138円	410,618,835円
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用)	2,802,212,323円	3,346,675,760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)	437,588,598円	417,114,961円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,034,788円	7,150,113円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	6,520,047円	6,181,292円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	11,040,978円	11,011,206円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	9,640,630円	8,706,099円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	3,367,988円	-円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	2,839,097円	-円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	41,001,984円	41,252,581円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	115,922,313円	116,515,193円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	171,685,569円	169,068,988円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	172,791,072円	162,415,851円
インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	535,193,381円	644,469,684円
計	4,317,838,768円	4,930,561,728円
2. 受益権の総数	4,317,838,768口	4,930,561,728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 2017年10月27日 至 2018年10月26日	自 2018年10月27日 至 2019年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年10月26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	8,850,377
投資証券	1,550,976
合計	7,299,401

(2019年10月28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	799,877,998
投資証券	34,784,785
合計	834,662,783

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2018年10月26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	334,619,385	-	319,728,260	14,891,125
合計		334,619,385	-	319,728,260	14,891,125

(2019年10月28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	382,035,109	-	387,190,445	5,155,336
合計		382,035,109	-	387,190,445	5,155,336

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	6,525,498,274	-	6,530,243,330	4,745,056
	米ドル	4,435,028,415	-	4,464,638,200	29,609,785
	加ドル	240,820,469	-	241,121,700	301,231
	ユーロ	790,879,581	-	781,360,180	9,519,401
	英ポンド	433,835,312	-	426,204,020	7,631,292
	スイスフラン	215,230,861	-	211,274,060	3,956,801
	スウェーデンクローナ	63,799,572	-	62,785,920	1,013,652
	ノルウェークローネ	18,447,317	-	18,274,320	172,997
	デンマーククローネ	40,275,263	-	39,539,340	735,923
	豪ドル	171,391,847	-	168,984,000	2,407,847
	ニュージーランドドル	2,206,651	-	2,186,740	19,911
	香港ドル	77,832,421	-	78,099,700	267,279
	シンガポールドル	30,147,186	-	30,183,710	36,524
	イスラエルシェケル	5,603,379	-	5,591,440	11,939
合計		6,525,498,274	-	6,530,243,330	4,745,056

(2019年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	8,335,107,087	-	8,484,257,330	149,150,243

米ドル	5,752,101,030	-	5,847,149,720	95,048,690
加ドル	302,831,255	-	311,532,840	8,701,585
ユーロ	992,907,287	-	1,005,609,220	12,701,933
英ポンド	485,234,154	-	508,489,470	23,255,316
スイスフラン	284,579,987	-	286,161,950	1,581,963
スウェーデンク ローナ	79,723,849	-	80,945,610	1,221,761
ノルウェークロー ネ	19,831,201	-	19,703,550	127,651
デンマーククロー ネ	55,130,495	-	55,758,370	627,875
豪ドル	215,860,434	-	219,616,680	3,756,246
ニュージーランド ドル	5,314,567	-	5,445,400	130,833
香港ドル	101,287,680	-	102,670,600	1,382,920
シンガポールドル	32,588,206	-	33,332,470	744,264
イスラエルシケ ル	7,716,942	-	7,841,450	124,508
合計	8,335,107,087	-	8,484,257,330	149,150,243

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額	1.5732円	1口当たり純資産額	1.7668円
(1万口当たり純資産額)	(15,732円)	(1万口当たり純資産額)	(17,668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	934	22.07	20,613.38	
	BAKER HUGHES CO	885	22.38	19,806.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	773	18.81	14,540.13	
	CHENIERE ENERGY INC	484	64.30	31,121.20	
	CHEVRON CORP	3,780	118.67	448,572.60	
	CIMAREX ENERGY CO	248	45.99	11,405.52	
	CONCHO RESOURCES INC	524	65.82	34,489.68	
	CONOCOPHILLIPS	2,340	56.35	131,859.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	899	21.47	19,301.53	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	359	87.46	31,398.14	
	EOG RESOURCES INC	1,141	72.48	82,699.68	
	EXXON MOBIL CORP	8,385	69.25	580,661.25	
	HALLIBURTON CO	1,839	20.48	37,662.72	
	HELMERICH & PAYNE	287	40.25	11,551.75	
	HESS CORP	622	66.78	41,537.16	
	HOLLYFRONTIER CORP	293	57.42	16,824.06	
	KINDER MORGAN INC	4,069	20.42	83,088.98	
	MARATHON OIL CORP	1,779	11.98	21,312.42	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,461	68.01	99,362.61	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,320	20.85	27,522.00	
	NOBLE ENERGY INC	872	20.62	17,980.64	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,930	42.53	82,082.90	
	ONEOK INC	881	71.55	63,035.55	
PHILLIPS 66	888	114.42	101,604.96		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	356	129.83	46,219.48		
SCHLUMBERGER LTD	2,990	35.09	104,919.10		

TARGA RESOURCES CORP	482	40.87	19,699.34
TECHNIPFMC PLC	867	21.36	18,519.12
VALERO ENERGY CORP	903	99.27	89,640.81
WILLIAMS COS INC	2,319	23.24	53,893.56
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	458	213.26	97,673.08
ALBEMARLE CORP	263	63.59	16,724.17
AMCOR PLC	3,040	9.72	29,548.80
BALL CORP	635	71.91	45,662.85
CELANESE CORP	251	123.65	31,036.15
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	462	46.14	21,316.68
CORTEVA INC	1,416	26.73	37,849.68
CROWN HOLDINGS INC	274	69.93	19,160.82
DOW INC	1,416	50.48	71,479.68
DUPONT DE NEMOURS INC	1,581	66.85	105,689.85
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	295	76.28	22,502.60
ECOLAB INC	519	191.94	99,616.86
FMC CORP	252	83.98	21,162.96
FREEPORT-MCMORAN INC	3,051	10.14	30,937.14
INTERNATIONAL PAPER CO	792	43.00	34,056.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	209	119.96	25,071.64
LINDE PLC	1,086	195.00	211,770.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	557	90.83	50,592.31
MARTIN MARIETTA MATERIALS	144	268.33	38,639.52
MOSAIC CO/THE	882	20.54	18,116.28
NEWMONT GOLDCORP CORP	1,690	39.18	66,214.20
NUCOR CORP	622	53.82	33,476.04
PACKAGING CORP OF AMERICA	192	110.93	21,298.56
PPG INDUSTRIES INC	481	124.04	59,663.24
SEALED AIR CORP	300	41.87	12,561.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	157	574.93	90,264.01
STEEL DYNAMICS INC	428	30.65	13,118.20
VULCAN MATERIALS CO	255	147.08	37,505.40
WESTROCK CO	562	38.01	21,361.62
3M CO	1,161	166.09	192,830.49
ACUITY BRANDS INC	69	124.90	8,618.10

AERCAP HOLDINGS NV	367	58.25	21,377.75
ALLEGION PLC	231	113.33	26,179.23
AMETEK INC	484	89.96	43,540.64
ARCONIC INC	740	27.64	20,453.60
BOEING CO/THE	1,071	339.83	363,957.93
CATERPILLAR INC	1,110	139.73	155,100.30
CUMMINS INC	302	178.52	53,913.04
DEERE & CO	627	173.11	108,539.97
DOVER CORP	354	103.65	36,692.10
EATON CORP PLC	892	85.62	76,373.04
EMERSON ELECTRIC CO	1,306	70.82	92,490.92
FASTENAL CO	1,213	37.18	45,099.34
FLUOR CORP	337	19.84	6,686.08
FORTIVE CORP	574	68.36	39,238.64
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	347	60.36	20,944.92
GENERAL DYNAMICS CORP	496	173.54	86,075.84
GENERAL ELECTRIC CO	17,874	9.00	160,866.00
HEICO CORP-CLASS A	253	92.57	23,420.21
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,426	171.63	244,744.38
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	221.19	25,879.23
IDEX CORP	206	158.72	32,696.32
ILLINOIS TOOL WORKS	657	171.81	112,879.17
INGERSOLL-RAND PLC	504	121.06	61,014.24
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	300	93.93	28,179.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	600	56.60	33,960.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	500	30.90	15,450.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,525	42.56	64,904.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	435	200.96	87,417.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	243.08	19,446.40
LOCKHEED MARTIN CORP	504	370.73	186,847.92
MASCO CORP	681	44.62	30,386.22
MIDDLEBY CORP	154	119.39	18,386.06
NORTHROP GRUMMAN CORP	315	345.00	108,675.00
PACCAR INC	745	76.89	57,286.77
PARKER HANNIFIN CORP	264	190.70	50,344.80

PENTAIR PLC	320	41.24	13,196.80
RAYTHEON COMPANY	544	212.15	115,409.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	238	177.38	42,216.44
ROPER TECHNOLOGIES INC	211	334.47	70,573.17
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	51.08	18,286.64
SMITH (A.O.) CORP	370	51.07	18,895.90
SNAP-ON INC	152	166.64	25,329.28
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	269	78.13	21,016.97
STANLEY BLACK & DECKER INC	355	151.35	53,729.25
TEXTRON INC	508	47.26	24,008.08
TRANSDIGM GROUP INC	94	523.45	49,204.30
UNITED RENTALS INC	194	135.38	26,263.72
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,637	142.96	234,025.52
WABCO HOLDINGS INC	140	134.83	18,876.20
WABTEC CORP	412	70.50	29,046.00
WW GRAINGER INC	99	317.34	31,416.66
XYLEM INC	392	83.30	32,653.60
CINTAS CORP	192	270.34	51,905.28
COPART INC	420	83.94	35,254.80
COSTAR GROUP INC	80	564.94	45,195.20
EQUIFAX INC	272	137.90	37,508.80
IHS MARKIT LTD	723	69.35	50,140.05
NIELSEN HOLDINGS PLC	1,073	20.60	22,103.80
REPUBLIC SERVICES INC	504	86.03	43,359.12
TRANSUNION	455	82.50	37,537.50
VERISK ANALYTICS INC	325	148.92	48,399.00
WASTE CONNECTIONS INC	580	91.33	52,971.40
WASTE MANAGEMENT INC	815	111.35	90,750.25
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	278	90.11	25,050.58
CSX CORP	1,479	72.32	106,961.28
DELTA AIR LINES INC	342	54.60	18,673.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	427	75.25	32,131.75
FEDEX CORP	486	158.09	76,831.74
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	176	116.75	20,548.00
KANSAS CITY SOUTHERN	189	144.49	27,308.61

NORFOLK SOUTHERN CORP	501	188.25	94,313.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	144	186.60	26,870.40
SOUTHWEST AIRLINES CO	481	56.74	27,291.94
UNION PACIFIC CORP	1,415	172.33	243,846.95
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,404	115.72	162,470.88
XPO LOGISTICS INC	212	79.72	16,900.64
APTIV PLC	534	89.58	47,835.72
BORGWARNER INC	694	39.72	27,565.68
FORD MOTOR COMPANY	8,108	8.72	70,701.76
GENERAL MOTORS CORP	2,567	36.74	94,311.58
HARLEY-DAVIDSON INC	418	39.39	16,465.02
LEAR CORP	167	124.22	20,744.74
TESLA INC	285	328.13	93,517.05
CAPRI HOLDINGS LTD	318	31.87	10,134.66
DR HORTON INC	657	53.71	35,287.47
GARMIN LTD	290	87.23	25,296.70
HANESBRANDS INC	1,260	15.89	20,021.40
HASBRO INC	280	96.01	26,882.80
LENNAR CORP-CL A	559	61.81	34,551.79
LULULEMON ATHLETICA INC	214	208.00	44,512.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	184	144.13	26,519.92
NEWELL BRANDS INC	1,116	19.65	21,929.40
NIKE INC -CL B	2,524	90.92	229,482.08
NVR INC	10	3,727.75	37,277.50
POLARIS INC	77	101.37	7,805.49
PULTE GROUP INC	707	40.41	28,569.87
PVH CORP	247	92.77	22,914.19
ROKU INC	170	133.74	22,735.80
TAPESTRY INC	759	26.45	20,075.55
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	655	19.06	12,484.30
VF CORP	630	84.15	53,014.50
WHIRLPOOL CORP	131	159.36	20,876.16
ARAMARK	646	44.22	28,566.12
CARNIVAL CORP	815	44.57	36,324.55
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	54	787.87	42,544.98

DARDEN RESTAURANTS INC	311	112.37	34,947.07
DOMINO'S PIZZA INC	93	271.75	25,272.75
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	592	97.69	57,832.48
LAS VEGAS SANDS CORP	718	61.22	43,955.96
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	563	126.18	71,039.34
MCDONALD'S CORP	1,510	194.61	293,861.10
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,153	28.15	32,456.95
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	415	51.47	21,360.05
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	348	111.37	38,756.76
STARBUCKS CORP	2,470	83.38	205,948.60
VAIL RESORTS INC	76	236.03	17,938.28
WYNN RESORTS LTD	211	120.85	25,499.35
YUM! BRANDS INC	665	109.10	72,551.50
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,573	55.26	86,923.98
ALPHABET INC-CL A	594	1,264.30	750,994.20
ALPHABET INC-CL C	634	1,265.13	802,092.42
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	781	36.04	28,147.24
CHARTER COMMUNICATION-A	309	462.19	142,816.71
COMCAST CORP-CLASS A	9,000	45.65	410,850.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	834	25.60	21,350.40
DISH NETWORK CORP-A	595	34.76	20,682.20
ELECTRONIC ARTS INC	572	96.31	55,089.32
FACEBOOK INC-CLASS A	4,814	187.89	904,502.46
FOX CORP - CLASS A	613	32.41	19,867.33
FOX CORP- CLASS B	654	31.70	20,731.80
IAC/INTERACTIVECORP	168	226.83	38,107.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	714	21.85	15,600.90
LIBERTY BROADBAND-C	201	116.15	23,346.15
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,319	23.21	30,613.99
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	514	41.41	21,284.74
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	569	43.75	24,893.75
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	338	69.06	23,342.28
NETFLIX INC	878	276.82	243,047.96
NEWS CORP - CLASS A	1,188	13.80	16,394.40
OMNICOM GROUP	510	76.82	39,178.20

SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,371	6.44	21,709.24
SNAP INC - A	1,167	13.96	16,291.32
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	197	125.33	24,690.01
THE WALT DISNEY CO.	3,581	130.90	468,752.90
TWITTER INC	1,610	30.30	48,783.00
VIACOM INC-CLASS B	908	21.65	19,662.74
ADVANCE AUTO PARTS INC	116	165.56	19,204.96
AMAZON.COM INC	841	1,761.33	1,481,278.53
AUTOZONE INC	53	1,129.47	59,861.91
BEST BUY CO INC	559	73.15	40,890.85
BOOKING HOLDINGS INC	86	2,055.93	176,809.98
BURLINGTON STORES INC	158	196.12	30,986.96
CARMAX INC	342	94.77	32,411.34
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	495	162.18	80,279.10
DOLLAR TREE INC	446	114.55	51,089.30
EBAY INC	1,579	35.84	56,591.36
EXPEDIA INC	295	137.06	40,432.70
GAP INC/THE	486	17.33	8,422.38
GENUINE PARTS CO	327	102.51	33,520.77
GRUBHUB INC	145	59.02	8,557.90
HOME DEPOT INC	2,190	234.38	513,292.20
KOHL'S CORP	450	53.96	24,282.00
L BRANDS INC	428	17.76	7,601.28
LKQ CORP	715	31.63	22,615.45
LOWE'S COS INC	1,621	111.58	180,871.18
MACY'S INC	442	15.58	6,886.36
MERCADOLIBRE INC	95	549.81	52,231.95
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	148	438.54	64,903.92
QURATE RETAIL INC	990	9.84	9,741.60
ROSS STORES INC	766	110.69	84,788.54
TARGET CORP	1,095	109.02	119,376.90
TIFFANY & CO	227	98.55	22,370.85
TJX COMPANIES INC	2,324	59.10	137,348.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	96.46	27,780.48
ULTA BEAUTY INC	115	240.90	27,703.50

WAYFAIR INC- CLASS A	96	118.19	11,346.24
COSTCO WHOLESALE CORP	867	296.50	257,065.50
KROGER CO	1,569	25.28	39,664.32
SYSCO CORP	935	79.17	74,023.95
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,624	55.42	90,002.08
WALMART INC	2,860	119.04	340,454.40
ALTRIA GROUP INC	3,768	46.80	176,342.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,074	41.01	44,044.74
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	579	64.28	37,218.12
BUNGE LTD	384	55.24	21,212.16
CAMPBELL SOUP CO	333	46.46	15,471.18
COCA-COLA CO/THE	7,998	53.75	429,892.50
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	578	54.19	31,321.82
CONAGRA BRANDS INC	900	26.92	24,228.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	358	195.84	70,110.72
GENERAL MILLS INC	1,196	50.51	60,409.96
HERSHEY CO/THE	319	143.31	45,715.89
HORMEL FOODS CORP	696	40.57	28,236.72
JM SMUCKER CO/THE	211	108.28	22,847.08
KELLOGG CO	581	60.89	35,377.09
KRAFT HEINZ CO/THE	1,453	28.38	41,236.14
LAMB WESTON HOLDING INC	259	75.00	19,425.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	265	159.38	42,235.70
MOLSON COORS BREWING CO -B	389	56.84	22,110.76
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,770	52.77	146,172.90
MONSTER BEVERAGE CORP	794	56.35	44,741.90
PEPSICO INC	2,750	136.64	375,760.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,116	81.98	255,449.68
TYSON FOODS INC-CL A	617	78.48	48,422.16
CHURCH & DWIGHT CO INC	550	74.89	41,189.50
CLOROX COMPANY	261	151.40	39,515.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,633	68.41	111,713.53
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	428	188.63	80,733.64
KIMBERLY-CLARK CORP	682	134.20	91,524.40
PROCTER & GAMBLE CO	4,980	123.25	613,785.00

ABBOTT LABORATORIES	3,488	81.65	284,795.20
ABIOMED INC	101	182.34	18,416.34
ALIGN TECHNOLOGY INC	146	243.38	35,533.48
AMERISOURCEBERGEN CORP	353	86.80	30,640.40
ANTHEM INC	516	263.07	135,744.12
BAXTER INTERNATIONAL INC	963	77.28	74,420.64
BECTON DICKINSON AND CO	545	244.30	133,143.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,870	40.85	117,239.50
CARDINAL HEALTH INC	508	50.05	25,425.40
CENTENE CORP	776	48.23	37,426.48
CERNER CORP	707	66.43	46,966.01
CIGNA CORP	778	171.49	133,419.22
COOPER COS INC/THE	111	281.75	31,274.25
CVS HEALTH CORP	2,617	65.10	170,366.70
DANAHER CORP	1,269	135.87	172,419.03
DAVITA INC	260	57.83	15,035.80
DENTSPLY SIRONA INC	429	53.07	22,769.17
DEXCOM INC	168	147.39	24,761.52
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	407	228.21	92,881.47
HCA HEALTHCARE INC	584	126.27	73,741.68
HENRY SCHEIN INC	264	62.25	16,434.00
HOLOGIC INC	457	47.49	21,702.93
HUMANA INC	280	288.09	80,665.20
IDEXX LABORATORIES INC	170	268.29	45,609.30
INTUITIVE SURGICAL INC	219	549.27	120,290.13
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	186	165.69	30,818.34
MCKESSON CORP	399	145.96	58,238.04
MEDTRONIC PLC	2,625	105.44	276,780.00
QUEST DIAGNOSTICS	309	100.63	31,094.67
RESMED INC	262	144.26	37,796.12
STERIS PLC	186	138.01	25,669.86
STRYKER CORP	661	211.62	139,880.82
TELEFLEX INC	102	321.88	32,831.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,900	244.91	465,329.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	137.93	25,379.12

VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	234	120.30	28,150.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	233	146.77	34,197.41
WELLCARE HEALTH PLANS INC	119	279.75	33,290.25
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	434	134.07	58,186.38
ABBVIE INC	2,993	76.53	229,054.29
AGILENT TECHNOLOGIES INC	614	75.39	46,289.46
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	480	105.18	50,486.40
ALLERGAN PLC	650	173.84	112,996.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	289	89.25	25,793.25
AMGEN INC	1,190	203.05	241,629.50
BIOGEN INC	378	288.04	108,879.12
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	361	71.19	25,699.59
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,307	54.98	181,818.86
CELGENE CORP	1,441	105.21	151,607.61
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	880	26.87	23,645.60
ELI LILLY & CO	1,755	110.20	193,401.00
EXACT SCIENCES CORP	296	89.89	26,607.44
GILEAD SCIENCES INC	2,457	63.32	155,577.24
ILLUMINA INC	280	290.64	81,379.20
INCYTE CORP	431	77.55	33,424.05
IONIS PHARMACEUTICALS INC	353	53.89	19,023.17
IQVIA HOLDINGS INC	350	147.51	51,628.50
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	125	123.85	15,481.25
JOHNSON & JOHNSON	5,301	128.35	680,383.35
MERCK & CO. INC.	5,144	82.26	423,145.44
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	51	698.19	35,607.69
MYLAN NV	1,004	18.70	18,774.80
NEKTAR THERAPEUTICS	276	16.68	4,603.68
PERKINELMER INC	293	86.23	25,265.39
PERRIGO CO PLC	266	54.05	14,377.30
PFIZER INC	11,124	36.77	409,029.48
REGENERON PHARMACEUTICALS	163	306.21	49,912.23
SAREPTA THERAPEUTICS INC	170	85.75	14,577.50
SEATTLE GENETICS INC	292	102.62	29,965.04
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	3,353	8.03	26,924.59

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	803	296.68	238,234.04
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	514	194.49	99,967.86
WATERS CORP	172	218.11	37,514.92
ZOETIS INC	918	124.36	114,162.48
BANK OF AMERICA CORP	18,019	31.72	571,562.68
BB&T CORP	1,452	53.58	77,798.16
CIT GROUP INC	365	43.99	16,056.35
CITIGROUP INC	4,584	73.17	335,411.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	871	35.85	31,225.35
COMERICA INC	345	65.59	22,628.55
EAST WEST BANCORP INC	327	43.57	14,247.39
FIFTH THIRD BANCORP	1,569	29.05	45,579.45
FIRST REPUBLIC BANK/CA	358	107.65	38,538.70
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,332	14.48	33,767.36
JPMORGAN CHASE & CO	6,461	126.03	814,279.83
KEYCORP	1,901	18.20	34,598.20
M & T BANK CORP	282	156.58	44,155.56
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	900	146.67	132,003.00
REGIONS FINANCIAL CORP	1,940	16.40	31,816.00
SIGNATURE BANK	168	121.57	20,423.76
SUNTRUST BANKS INC	841	69.09	58,104.69
SVB FINANCIAL GROUP	106	219.79	23,297.74
US BANCORP	2,984	56.74	169,312.16
WELLS FARGO & CO	8,528	51.57	439,788.96
ZIONS BANCORP NA	517	47.95	24,790.15
AFFILIATED MANAGERS GROUP	127	77.34	9,822.18
ALLY FINANCIAL INC	701	30.82	21,604.82
AMERICAN EXPRESS CO	1,397	118.26	165,209.22
AMERIPRISE FINANCIAL INC	259	149.45	38,707.55
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,733	46.38	80,376.54
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	2,579	211.80	546,232.20
BLACKROCK INC	233	459.80	107,133.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	941	93.25	87,748.25
CBOE GLOBAL MARKETS INC	196	114.10	22,363.60
CME GROUP INC	723	200.46	144,932.58

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	669	80.14	53,613.66
E*TRADE FINANCIAL CORP	481	41.05	19,745.05
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	86	254.07	21,850.02
FRANKLIN RESOURCES INC	492	27.83	13,692.36
GOLDMAN SACHS GROUP INC	652	214.23	139,677.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,158	91.96	106,489.68
INVESCO LTD	990	17.05	16,879.50
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	878	18.91	16,602.98
KKR & CO INC -A	894	28.15	25,166.10
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	344.07	32,342.58
MOODY'S CORP	352	216.01	76,035.52
MORGAN STANLEY	2,547	46.37	118,104.39
MSCI INC	152	222.20	33,774.40
NASDAQ INC	243	98.43	23,918.49
NORTHERN TRUST CORP	437	101.53	44,368.61
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	232	84.48	19,599.36
S&P GLOBAL INC	489	249.27	121,893.03
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,334	40.98	95,647.32
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	59.60	20,681.20
STATE STREET CORP	743	65.75	48,852.25
SYNCHRONY FINANCIAL	1,373	35.29	48,453.17
T ROWE PRICE GROUP INC	464	113.71	52,761.44
TD AMERITRADE HOLDING CORP	625	38.65	24,156.25
VOYA FINANCIAL INC	316	53.99	17,060.84
AFLAC INC	1,375	53.26	73,232.50
ALLEGHANY CORP	27	757.69	20,457.63
ALLSTATE CORP	680	107.24	72,923.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,820	52.80	96,096.00
AON PLC	454	188.65	85,647.10
ARCH CAPITAL GROUP LTD	837	40.80	34,149.60
ARTHUR J GALLAGHER & CO	425	89.45	38,016.25
ASSURANT INC	167	125.57	20,970.19
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	463	42.00	19,446.00
CHUBB LTD	906	149.14	135,120.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	292	111.65	32,601.80

EVEREST RE GROUP LTD	83	248.59	20,632.97
FNF GROUP	589	45.53	26,817.17
GLOBE LIFE INC	215	96.39	20,723.85
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	709	56.80	40,271.20
LINCOLN NATIONAL CORP	407	61.59	25,067.13
LOEWS CORP	575	51.00	29,325.00
MARKEL CORP	27	1,110.77	29,990.79
MARSH & MCLENNAN COS	1,006	97.57	98,155.42
METLIFE INC	1,556	46.32	72,073.92
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	516	54.51	28,127.16
PROGRESSIVE CORP	1,188	69.30	82,328.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	784	91.75	71,932.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	184	157.21	28,926.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	119	183.72	21,862.68
TRAVELERS COS INC/THE	497	130.43	64,823.71
UNUM GROUP	475	28.49	13,532.75
WILLIS TOWERS WATSON PLC	289	184.98	53,459.22
WR BERKLEY CORP	316	69.44	21,943.04
CBRE GROUP INC - A	605	52.61	31,829.05
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	4,000	5.40	21,600.00
JONES LANG LASALLE INC	136	146.29	19,895.44
ACCENTURE PLC-CL A	1,246	183.07	228,105.22
ADOBE INC	966	270.98	261,766.68
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	362	89.15	32,272.30
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	93	104.80	9,746.40
ANSYS INC	172	220.25	37,883.00
AUTODESK INC	429	145.54	62,436.66
AUTOMATIC DATA PROCESSING	849	161.96	137,504.04
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	279	123.55	34,470.45
CADENCE DESIGN SYS INC	601	65.10	39,125.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	291	108.32	31,521.12
CITRIX SYSTEMS INC	258	105.64	27,255.12
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,058	60.46	63,966.68
DXC TECHNOLOGY CO	566	28.31	16,023.46
EPAM SYSTEMS INC	131	176.15	23,075.65

FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,218	129.32	157,511.76
FISERV INC	1,127	102.51	115,528.77
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	192	298.88	57,384.96
FORTINET INC	268	80.48	21,568.64
GARTNER INC	176	146.04	25,703.04
GLOBAL PAYMENTS INC	618	161.34	99,708.12
GODADDY INC-CLASS A	323	65.40	21,124.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,763	135.44	238,780.72
INTUIT INC	508	257.67	130,896.36
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	151	139.53	21,069.03
LEIDOS HOLDINGS INC	309	79.98	24,713.82
MASTERCARD INC	1,801	270.19	486,612.19
MICROSOFT CORP	14,543	140.73	2,046,636.39
OKTA INC	233	107.99	25,161.67
ORACLE CORP	4,802	54.17	260,124.34
PALO ALTO NETWORKS INC	197	224.65	44,256.05
PAYCHEX INC	662	84.53	55,958.86
PAYCOM SOFTWARE INC	111	209.67	23,273.37
PAYPAL HOLDINGS INC	2,234	107.19	239,462.46
PTC INC	186	67.75	12,601.50
SALESFORCE.COM INC	1,662	150.49	250,114.38
SERVICENOW INC	355	241.22	85,633.10
SPLUNK INC	302	119.58	36,113.16
SQUARE INC - A	622	62.89	39,117.58
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	51.24	30,897.72
SYMANTEC CORP	1,077	22.69	24,437.13
SYNOPSYS INC	308	137.14	42,239.12
TWILIO INC - A	239	106.98	25,568.22
VERISIGN INC	250	190.16	47,540.00
VISA INC-CLASS A SHARES	3,443	177.85	612,337.55
VMWARE INC	164	159.19	26,107.16
WIX.COM LTD	150	120.72	18,108.00
WORKDAY INC-CLASS A	348	160.75	55,941.00
AMPHENOL CORP-CL A	673	100.23	67,454.79
APPLE INC	9,212	246.58	2,271,494.96

ARISTA NETWORKS INC	124	244.36	30,300.64
CDW CORP/DE	335	124.86	41,828.10
CISCO SYSTEMS INC	8,578	46.90	402,308.20
COGNEX CORP	423	52.50	22,207.50
CORNING INC	1,471	30.51	44,880.21
DELL TECHNOLOGIES -C	371	51.68	19,173.28
F5 NETWORKS INC	110	143.55	15,790.50
FLEX LTD	1,430	11.61	16,602.30
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	2,722	16.16	43,987.52
HP INC	3,088	17.33	53,515.04
JUNIPER NETWORKS INC	802	25.23	20,234.46
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	408	101.28	41,322.24
MOTOROLA SOLUTIONS INC	341	163.41	55,722.81
NETAPP INC	482	56.01	26,996.82
SEAGATE TECHNOLOGY	608	56.91	34,604.32
TE CONNECTIVITY LTD	750	94.10	70,575.00
TRIMBLE INC	488	38.99	19,027.12
WESTERN DIGITAL CORP	634	61.23	38,819.82
XEROX HOLDINGS CORP	608	30.51	18,550.08
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	122	219.08	26,727.76
AT&T INC	14,575	36.91	537,963.25
CENTURYLINK INC	1,839	12.89	23,704.71
SPRINT CORP	1,370	6.38	8,740.60
T-MOBILE US INC	627	81.62	51,175.74
VERIZON COMMUNICATIONS INC	8,234	60.37	497,086.58
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	663	34.28	22,727.64
AES CORP	1,319	16.80	22,159.20
ALLIANT ENERGY CORP	481	53.18	25,579.58
AMEREN CORPORATION	515	76.59	39,443.85
AMERICAN ELECTRIC POWER	911	94.35	85,952.85
AMERICAN WATER WORKS CO INC	373	121.11	45,174.03
ATMOS ENERGY CORP	294	112.30	33,016.20
CENTERPOINT ENERGY INC	1,225	29.54	36,186.50
CMS ENERGY CORP	656	63.65	41,754.40
CONSOLIDATED EDISON INC	622	93.32	58,045.04

DOMINION ENERGY INC	1,562	81.89	127,912.18
DTE ENERGY COMPANY	408	128.21	52,309.68
DUKE ENERGY CORP	1,378	95.43	131,502.54
EDISON INTERNATIONAL	770	66.05	50,858.50
ENTERGY CORP	373	120.27	44,860.71
EVERGY INC	616	63.50	39,116.00
EVERSOURCE ENERGY	611	85.31	52,124.41
EXELON CORP	1,931	45.89	88,613.59
FIRSTENERGY CORP	1,092	48.01	52,426.92
NEXTERA ENERGY INC	926	236.88	219,350.88
NISOURCE INC	783	28.04	21,955.32
NRG ENERGY INC	676	40.81	27,587.56
PINNACLE WEST CAPITAL	319	94.20	30,049.80
PPL CORP	1,563	33.22	51,922.86
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,079	62.90	67,869.10
SEMPRA ENERGY	540	143.97	77,743.80
SOUTHERN CO	1,995	61.35	122,393.25
UGI CORP	547	48.19	26,359.93
VISTRA ENERGY CORP	921	27.10	24,959.10
WEC ENERGY GROUP INC	588	93.79	55,148.52
XCEL ENERGY INC	1,030	63.64	65,549.20
ADVANCED MICRO DEVICES	2,135	32.71	69,835.85
ANALOG DEVICES INC	708	106.83	75,635.64
APPLIED MATERIALS INC	1,941	55.72	108,152.52
BROADCOM INC	796	289.82	230,696.72
INTEL CORP	8,933	56.46	504,357.18
KLA CORP	338	169.94	57,439.72
LAM RESEARCH CORP	308	270.05	83,175.40
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,302	24.75	32,224.50
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	575	57.16	32,867.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	530	93.90	49,767.00
MICRON TECHNOLOGY INC	2,273	48.03	109,172.19
NVIDIA CORP	1,162	204.54	237,675.48
NXP SEMICONDUCTORS NV	543	105.86	57,481.98
ON SEMICONDUCTOR CORP	1,060	19.18	20,330.80

	QORVO INC	316	79.02	24,970.32	
	QUALCOMM INC	2,436	80.17	195,294.12	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	371	90.06	33,412.26	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,832	120.51	220,774.32	
	XILINX INC	546	94.90	51,815.40	
米ドル小計		604,715		51,464,011.36	(5,599,284,435)
加ドル	CAMECO CORP	1,280	11.92	15,257.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	2,511	34.02	85,424.22	
	CENOVUS ENERGY INC	2,415	11.46	27,675.90	
	ENBRIDGE INC	4,124	47.65	196,508.60	
	ENCANA CORP	3,834	5.56	21,317.04	
	HUSKY ENERGY INC	959	9.30	8,918.70	
	IMPERIAL OIL LTD	880	33.26	29,268.80	
	INTER PIPELINE LTD	1,244	22.17	27,579.48	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,143	46.50	53,149.50	
	SUNCOR ENERGY INC	3,184	39.78	126,659.52	
	TC ENERGY CORP	1,909	66.74	127,406.66	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	545	76.73	41,817.85	
	BARRICK GOLD CORP	3,386	22.47	76,083.42	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	452	53.48	24,172.96	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,206	10.99	13,253.94	
	FRANCO-NEVADA CORP	437	125.13	54,681.81	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	526	59.70	31,402.20	
	NUTRIEN LTD	1,285	64.49	82,869.65	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,186	21.80	25,854.80	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,129	35.89	40,519.81	
	BOMBARDIER INC 'B'	4,930	1.61	7,937.30	
	CAE INC	753	33.13	24,946.89	
	THOMSON REUTERS CORP	553	86.35	47,751.55	
	AIR CANADA	415	45.99	19,085.85	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,503	116.23	174,693.69	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	322	296.48	95,466.56	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	674	70.78	47,705.72	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	543	33.88	18,396.84	

	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	538	89.29	48,038.02	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,223	25.72	31,455.56	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	143.30	19,918.70	
	DOLLARAMA INC	672	45.38	30,495.36	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	1,766	39.81	70,304.46	
	LOBLAW COMPANIES LTD	459	69.60	31,946.40	
	METRO INC	776	54.92	42,617.92	
	WESTON (GEORGE) LTD	240	106.06	25,454.40	
	SAPUTO INC	498	37.61	18,729.78	
	AURORA CANNABIS INC	1,284	4.99	6,407.16	
	BAUSCH HEALTH COS INC	555	30.73	17,055.15	
	CANOPY GROWTH CORP	376	28.53	10,727.28	
	BANK OF MONTREAL	1,287	98.10	126,254.70	
	BANK OF NOVA SCOTIA	2,426	75.13	182,265.38	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	919	112.07	102,992.33	
	NATIONAL BANK OF CANADA	850	67.47	57,349.50	
	ROYAL BANK OF CANADA	2,773	106.02	293,993.46	
	TORONTO-DOMINION BANK	3,580	75.16	269,072.80	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,815	70.35	127,685.25	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	78	554.63	43,261.14	
	GREAT-WEST LIFECO INC	917	31.17	28,582.89	
	INTACT FINANCIAL CORP	323	132.60	42,829.80	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	4,130	24.48	101,102.40	
	POWER FINANCIAL CORP	887	30.69	27,222.03	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,366	58.40	79,774.40	
	CGI INC	605	102.06	61,746.30	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	44	1,305.01	57,420.44	
	OPEN TEXT CORP	696	52.29	36,393.84	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	207	414.58	85,818.06	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	691	61.17	42,268.47	
	TELUS CORP	610	46.01	28,066.10	
	FORTIS INC	873	53.98	47,124.54	
加ドル小計		76,931		3,740,180.88	(311,370,058)
ユーロ	ENI SPA	5,286	14.04	74,215.44	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,664	14.26	23,728.64
NESTE OYJ	854	32.65	27,883.10
OMV AG	339	52.18	17,689.02
REPSOL SA	2,764	14.99	41,432.36
TOTAL SA	4,747	47.69	226,408.16
AIR LIQUIDE SA	981	116.80	114,580.80
AKZO NOBEL	468	82.92	38,806.56
ARCELORMITTAL	2,154	14.05	30,263.70
ARKEMA	208	92.94	19,331.52
BASF SE	1,922	70.62	135,731.64
COVESTRO AG	543	46.69	25,352.67
CRH PLC	1,668	32.99	55,027.32
HEIDELBERGCEMENT AG	333	66.02	21,984.66
KONINKLIJKE DSM NV	338	108.60	36,706.80
LANXESS AG	260	61.48	15,984.80
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	739	29.84	22,051.76
SOLVAY SA	192	101.70	19,526.40
STORA ENSO OYJ-R SHS	1,994	12.25	24,436.47
SYMRISE AG	297	86.60	25,720.20
THYSSENKRUPP AG	881	13.37	11,783.37
UMICORE	374	37.14	13,890.36
UPM-KYMMENE OYJ	1,142	29.74	33,963.08
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	774	36.41	28,181.34
AIRBUS GROUP SE	1,196	123.52	147,729.92
BOUYGUES SA	502	38.81	19,482.62
BRENTAG AG	402	45.39	18,246.78
CNH INDUSTRIAL NV	2,110	9.96	21,032.48
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,042	37.04	38,595.68
EIFFAGE	260	96.00	24,960.00
FERROVIAL SA	852	26.25	22,365.00
KINGSPAN GROUP PLC	450	46.60	20,970.00
KONE OYJ-B	732	56.34	41,240.88
LEGRAND SA	562	69.82	39,238.84
MTU AERO ENGINES AG	116	233.50	27,086.00
SAFRAN SA	694	139.30	96,674.20

SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,085	83.86	90,988.10
SIEMENS AG-REG	1,563	104.40	163,177.20
THALES SA	232	87.04	20,193.28
VINCI SA	989	100.65	99,542.85
WARTSILA OYJ ABP	1,236	9.26	11,455.24
EDENRED	658	45.80	30,136.40
RANDSTAD NV	417	50.14	20,908.38
TELEPERFORMANCE	136	201.40	27,390.40
WOLTERS KLUWER	669	64.40	43,083.60
AENA SA	163	165.00	26,895.00
ATLANTIA SPA	918	21.77	19,984.86
DEUTSCHE POST AG-REG	1,990	32.02	63,719.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	680	69.43	47,212.40
CONTINENTAL AG	268	124.14	33,269.52
DAIMLER AG	1,934	52.88	102,269.92
FERRARI NV	245	140.25	34,361.25
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,975	11.84	23,399.80
MICHELIN (CGDE)-B	424	107.30	45,495.20
PEUGEOT SA	1,292	24.84	32,093.28
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	446	65.74	29,320.04
RENAULT SA	379	49.03	18,582.37
VALEO SA	437	33.89	14,809.93
VOLKSWAGEN AG-PFD	385	172.36	66,358.60
ADIDAS AG	376	275.15	103,456.40
ESSILORLUXOTTICA	588	134.55	79,115.40
HERMES INTERNATIONAL	67	653.20	43,764.40
KERING	154	514.00	79,156.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	564	383.95	216,547.80
MONCLER SPA	532	36.17	19,242.44
PUMA SE	260	65.95	17,147.00
ACCOR SA	541	38.60	20,882.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	149	89.86	13,389.14
SODEXO	273	97.38	26,584.74
PUBLICIS GROUPE	562	38.79	21,799.98
SES	642	17.54	11,260.68

UBISOFT ENTERTAINMENT	247	46.94	11,594.18
VIVENDI	2,083	24.88	51,825.04
INDITEX	2,013	28.28	56,927.64
PROSUS	975	62.50	60,937.50
CARREFOUR SA	1,713	15.73	26,954.05
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,423	22.81	55,280.74
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,550	73.68	114,204.00
DANONE	1,208	73.96	89,343.68
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	1,970	8.18	16,114.60
HEINEKEN HOLDING NV	292	85.90	25,082.80
HEINEKEN NV	528	92.00	48,576.00
KERRY GROUP PLC-A	290	109.00	31,610.00
PERNOD-RICARD SA	422	159.30	67,224.60
BEIERSDORF AG	244	103.65	25,290.60
HENKEL AG & CO KGAA	220	83.50	18,370.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	389	92.30	35,904.70
L'OREAL	529	243.30	128,705.70
UNILEVER NV	2,909	53.24	154,875.16
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	437	59.34	25,931.58
FRESENIUS SE & CO KGAA	810	43.44	35,186.40
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,754	39.66	69,572.41
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	114	176.30	20,098.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	508	37.82	19,212.56
BAYER AG-REG	1,929	66.54	128,355.66
GRIFOLS SA	713	27.80	19,821.40
MERCK KGAA	308	106.50	32,802.00
QIAGEN N.V.	760	26.00	19,760.00
SANOFI	2,292	83.40	191,152.80
UCB SA	286	69.78	19,957.08
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	16.97	13,732.77
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	12,357	4.88	60,363.94
BANCO DE SABADELL SA	19,724	1.01	20,009.99
BANCO SANTANDER SA	33,448	3.98	133,189.93
BNP PARIBAS	2,383	47.69	113,645.27
CAIXABANK S.A	7,994	2.54	20,360.71

COMMERZBANK AG	3,549	5.46	19,391.73
CREDIT AGRICOLE SA	2,542	11.98	30,453.16
ERSTE GROUP BANK AG	838	32.28	27,050.64
ING GROEP NV-CVA	8,470	10.37	87,884.72
INTESA SANPAOLO	26,963	2.27	61,273.41
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	-	-
KBC GROEP NV	520	64.70	33,644.00
MEDIOBANCA SPA	2,408	10.84	26,114.76
SOCIETE GENERALE	1,599	26.20	41,901.79
UNICREDIT SPA	5,071	11.53	58,488.91
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,447	7.17	31,920.56
DEUTSCHE BOERSE AG	401	141.65	56,801.65
EXOR NV	369	62.14	22,929.66
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	287	88.78	25,479.86
AEGON NV	4,432	4.00	17,728.00
AGEAS	414	51.92	21,494.88
ALLIANZ SE-REG	839	221.55	185,880.45
ASSICURAZIONI GENERALI	1,868	18.35	34,287.14
AXA	4,042	24.30	98,240.81
HANNOVER RUECK SE-REG	158	158.20	24,995.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	291	250.10	72,779.10
NN GROUP NV	566	34.23	19,374.18
SAMPO OYJ-A SHS	1,114	36.00	40,104.00
SCOR SE	541	38.12	20,622.92
AROUNDTOWN SA	2,481	7.41	18,394.13
DEUTSCHE WOHNEN SE	738	33.51	24,730.38
VONOVIA SE	1,148	47.15	54,128.20
ADYEN NV	16	629.40	10,070.40
AMADEUS IT GROUP SA	875	67.06	58,677.50
ATOS SE	214	67.54	14,453.56
CAP GEMINI SA	319	101.50	32,378.50
DASSAULT SYSTEMES SA	289	134.15	38,769.35
SAP SE	1,976	119.22	235,578.72
WIRECARD AG	276	114.50	31,602.00
WORLDLINE SA	244	57.35	13,993.40

	NOKIA OYJ	10,908	3.45	37,681.68
	CELLNEX TELECOM SA	547	38.84	21,245.48
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	7,081	16.00	113,338.48
	KONINKLIJKE KPN NV	6,612	2.89	19,128.51
	ORANGE S.A.	4,593	14.68	67,425.24
	TELECOM ITALIA SPA	29,118	0.53	15,519.89
	TELEFONICA SA	9,063	7.15	64,827.63
	E.ON SE	4,498	8.91	40,086.17
	EDF	951	9.29	8,834.79
	ENAGAS SA	514	20.87	10,727.18
	ENDESA SA	822	23.91	19,654.02
	ENEL SPA	16,878	6.88	116,120.64
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	6,241	3.62	22,642.34
	ENGIE	3,625	14.92	54,103.12
	FORTUM OYJ	1,026	21.47	22,028.22
	IBERDROLA SA	11,962	9.21	110,241.79
	NATURGY ENERGY GROUP SA	720	23.63	17,013.60
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	989	18.34	18,143.20
	RWE AG	1,273	27.54	35,058.42
	SNAM SPA	4,206	4.55	19,149.91
	TERNA SPA	4,271	5.88	25,139.10
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,423	23.01	32,743.23
	ASML HOLDING NV	842	237.85	200,269.70
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,499	17.58	43,937.41
	STMICROELECTRONICS NV	1,501	20.21	30,335.21
ユーロ小計		384,950		8,038,283.29 (969,015,050)
英ポンド	BP PLC	39,590	5.12	202,700.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	8,756	23.25	203,620.78
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	7,510	23.24	174,532.40
	ANGLO AMERICAN PLC	2,374	20.15	47,847.97
	BHP GROUP PLC	4,061	16.57	67,298.89
	GLENCORE PLC	25,062	2.34	58,707.73
	JOHNSON MATTHEY PLC	515	31.09	16,011.35
	MONDI PLC	1,379	15.75	21,726.14

RIO TINTO PLC	2,254	41.18	92,819.72
ASHTED GROUP PLC	986	22.69	22,372.34
BAE SYSTEMS PLC ORD	6,413	5.58	35,835.84
BUNZL PLC	865	20.01	17,308.65
DCC PLC	217	71.44	15,502.48
FERGUSON PLC	539	65.32	35,207.48
MELROSE INDUSTRIES PLC	11,311	2.12	24,058.49
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,577	7.12	25,496.85
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT-C(N)	164,542	0.00	164.54
SMITHS GROUP PLC	845	16.08	13,587.60
EXPERIAN PLC	1,892	23.91	45,237.72
INTERTEK GROUP PLC	389	51.42	20,002.38
RELX PLC	3,799	18.47	70,186.52
RENTOKIL INITIAL PLC	4,172	4.42	18,444.41
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	6.46	15,219.76
BURBERRY GROUP PLC	993	20.22	20,078.46
PERSIMMON PLC	663	23.50	15,580.50
TAYLOR WIMPEY PLC	10,487	1.67	17,523.77
CARNIVAL PLC	365	32.29	11,785.85
COMPASS GROUP PLC	3,481	19.94	69,411.14
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	393	46.34	18,211.62
WHITBREAD PLC	426	41.02	17,474.52
AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	5.65	16,487.24
INFORMA PLC	2,569	7.73	19,878.92
ITV PLC	13,268	1.35	18,031.21
PEARSON PLC	1,354	6.75	9,139.50
WPP PLC	2,617	9.74	25,500.04
KINGFISHER PLC	4,306	2.12	9,158.86
MARKS & SPENCER GROUP PLC	6,969	1.83	12,774.17
NEXT PLC	290	67.12	19,464.80
OCADO GROUP PLC	718	13.25	9,513.50
TESCO PLC	19,937	2.39	47,769.05
WM MORRISON SUPERMARKETS	8,375	2.01	16,842.12
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	21.92	18,785.44
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	4,670	27.09	126,510.30

	COCA-COLA HBC AG-CDI	556	23.27	12,938.12	
	DIAGEO PLC	4,723	31.21	147,404.83	
	IMPERIAL BRANDS PLC	2,179	18.20	39,657.80	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,474	58.30	85,934.20	
	UNILEVER PLC	2,257	46.31	104,532.95	
	SMITH & NEPHEW PLC	1,973	16.91	33,373.29	
	ASTRAZENECA PLC	2,628	73.83	194,025.24	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	9,893	17.00	168,181.00	
	BARCLAYS PLC	36,980	1.70	62,999.12	
	HSBC HOLDINGS PLC	39,641	6.17	244,743.53	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	146,529	0.60	87,917.40	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	9,505	2.25	21,462.29	
	STANDARD CHARTERED PLC	5,798	6.92	40,122.16	
	3I GROUP PLC	2,022	10.97	22,181.34	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	913	17.39	15,881.63	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	624	68.18	42,544.32	
	M&G PLC	5,002	2.25	11,264.50	
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,607	10.23	16,447.64	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,796	2.97	11,308.28	
	AVIVA PLC	8,042	4.20	33,848.77	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	12,544	2.70	33,906.43	
	PRUDENTIAL PLC	5,002	13.91	69,577.82	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,591	5.22	13,540.56	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	940	10.49	9,864.36	
	SAGE GROUP PLC/THE	3,107	7.07	21,978.91	
	BT GROUP PLC	21,498	2.01	43,318.47	
	VODAFONE GROUP PLC	56,975	1.60	91,501.85	
	NATIONAL GRID PLC	7,231	9.03	65,361.00	
	SEVERN TRENT PLC	795	23.00	18,285.00	
	SSE PLC	2,314	13.01	30,105.14	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	8.68	14,131.04	
英債券小計		779,824		3,572,150.84	(498,493,649)
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	20	2,846.00	56,920.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,085	49.99	54,239.15	

	SIKA AG-REG	236	164.25	38,763.00	
	ABB LTD-REG	4,212	20.94	88,199.28	
	GEBERIT AG-REG	81	491.60	39,819.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	85	233.10	19,813.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	58.86	24,662.34	
	SGS SA-REG	14	2,546.00	35,644.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	164	162.60	26,666.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,097	75.02	82,296.94	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	271.30	25,773.50	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4	7,165.00	28,660.00	
	NESTLE SA-REG	6,070	104.68	635,407.60	
	ALCON INC	803	58.16	46,702.48	
	SONOVA HOLDING AG-REG	152	223.20	33,926.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	29	857.40	24,864.60	
	LONZA GROUP AG-REG	146	348.70	50,910.20	
	NOVARTIS AG-REG	4,313	86.90	374,799.70	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,407	294.55	414,431.85	
	VIFOR PHARMA AG	91	154.45	14,054.95	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,786	12.53	72,498.58	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	43.60	25,244.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	44	760.40	33,457.60	
	UBS GROUP AG-REG	7,444	11.74	87,429.78	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	83	488.30	40,528.90	
	SWISS RE AG	623	104.25	64,947.75	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	299	390.70	116,819.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	215	100.50	21,607.50	
	TEMENOS AG	155	143.20	22,196.00	
	SWISSCOM AG-REG	56	507.00	28,392.00	
	スイスフラン小計	35,807		2,629,677.30 (287,686,696)	
スウェーデンク ローナ	ASSA ABLOY AB-B	2,398	225.00	539,550.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,445	334.20	482,919.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,038	294.30	305,483.40	
	EPIROC AB-A	1,930	106.10	204,773.00	
	EPIROC AB-B	603	101.35	61,114.05	

	SANDVIK AB	2,353	168.20	395,774.60	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	208.00	219,648.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	3,384	145.85	493,556.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,569	205.50	322,429.50	
	SWEDISH MATCH AB	559	454.50	254,065.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,300	305.30	396,890.00	
	NORDEA BANK ABP	7,877	72.44	570,609.88	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	3,860	95.66	369,247.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,151	98.48	310,310.48	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,076	141.50	293,754.00	
	INVESTOR AB-B SHS	1,038	493.00	511,734.00	
	KINNEVIK AB - B	792	263.90	209,008.80	
	ERICSSON LM-B SHS	6,281	87.10	547,075.10	
	HEXAGON AB-B SHS	583	481.10	280,481.30	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	143.35	209,291.00	
	TELIA CO AB	5,025	43.60	219,090.00	
スウェーデンクローナ小計		49,778		7,196,805.61	(80,820,127)
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	1,861	175.30	326,233.30	
	NORSK HYDRO A S	3,505	32.76	114,823.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	358.20	153,667.80	
	MOWI ASA	876	228.00	199,728.00	
	ORKLA ASA	1,924	85.50	164,502.00	
	DNB ASA	2,071	167.70	347,306.70	
	TELENOR ASA	1,320	173.30	228,756.00	
ノルウェークローネ小計		11,986		1,535,017.60	(18,159,258)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	320	521.20	166,784.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	501	316.50	158,566.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	380	546.80	207,784.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	22	8,552.00	188,144.00	
	DSV PANALPINA A S	452	639.00	288,828.00	
	PANDORA A/S	209	316.00	66,044.00	
	CARLSBERG AS-B	239	957.80	228,914.20	
	COLOPLAST-B	302	796.80	240,633.60	

	GENMAB A/S	153	1,424.00	217,872.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	3,615	364.05	1,316,040.75	
	DANSKE BANK A/S	1,229	98.60	121,179.40	
	ORSTED A/S	438	630.00	275,940.00	
	デンマーククロネ小計	7,860		3,476,730.45	(56,114,429)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	775	27.69	21,459.75	
	ORIGIN ENERGY LTD	4,535	7.97	36,143.95	
	SANTOS LTD	3,916	8.18	32,032.88	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,892	32.56	61,603.52	
	BHP GROUP LTD	6,198	35.77	221,702.46	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,189	8.82	19,306.98	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	25.57	33,394.42	
	NEWCREST MINING LTD	1,393	32.43	45,174.99	
	ORICA LIMITED	1,061	23.68	25,124.48	
	RIO TINTO LTD	786	90.81	71,376.66	
	SOUTH32 LTD	8,960	2.60	23,296.00	
	CIMIC GROUP LTD	130	34.26	4,453.80	
	BRAMBLES LTD	3,858	12.23	47,183.34	
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,319	5.87	31,222.53	
	SYDNEY AIRPORT	3,332	8.85	29,488.20	
	TRANSURBAN GROUP	5,592	14.71	82,258.32	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,588	32.30	51,292.40	
	TABCORP HOLDINGS LTD	5,056	4.84	24,471.04	
	WESFARMERS LTD	2,478	41.05	101,721.90	
	COLES GROUP LTD	2,052	14.96	30,697.92	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	2,464	37.93	93,459.52	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	2,070	18.02	37,301.40	
	COCHLEAR LTD	173	207.42	35,883.66	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	454	69.10	31,371.40	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	28.71	34,107.48	
	CSL LTD	879	256.77	225,700.83	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	5,908	28.03	165,601.24	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,534	80.70	285,193.80	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	5,880	29.18	171,578.40	

	WESTPAC BANKING CORP	7,152	29.05	207,765.60	
	AMP LTD	12,049	1.85	22,350.89	
	ASX LTD	514	83.17	42,749.38	
	MACQUARIE GROUP LTD	644	134.98	86,927.12	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	335	50.63	16,961.05	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	5,019	8.04	40,352.76	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	5,416	3.41	18,468.56	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	2,354	12.71	29,919.34	
	SUNCORP GROUP LTD	2,519	13.51	34,031.69	
	TELSTRA CORPORATION LTD	6,763	3.56	24,076.28	
	AGL ENERGY LTD	1,271	19.71	25,051.41	
	APA GROUP	2,771	11.67	32,337.57	
豪ドル小計		131,773		2,654,594.92	(196,997,489)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	2,653	8.95	23,744.35	
	A2 MILK CO LTD	1,419	12.74	18,078.06	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	18.93	28,167.84	
ニュージーランドドル小計		5,560		69,990.25	(4,837,726)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	6,098	72.20	440,275.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	56.85	227,400.00	
	MTR CORP	4,000	44.55	178,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	5,000	52.30	261,500.00	
	SANDS CHINA LTD	7,000	38.65	270,550.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	2,400	29.70	71,280.00	
	WH GROUP LTD	17,000	7.65	130,050.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,000	18.94	56,820.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	9,500	27.20	258,400.00	
	HANG SENG BANK LTD	1,550	167.20	259,160.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,671	241.20	644,245.20	
	AIA GROUP LTD	24,263	74.75	1,813,659.25	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	6,098	53.40	325,633.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	7,756	16.86	130,766.16	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,200	38.05	159,810.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	19,000	11.18	212,420.00		

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,433	114.80	394,108.40	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,500	73.35	110,025.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	45.20	135,600.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	12,000	12.50	150,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	3,694	81.50	301,061.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	20,722	15.30	317,046.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	54.75	219,000.00	
香港ドル小計		171,885		7,067,010.41	(98,090,104)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	3,283	6.91	22,685.53	
	GENTING SINGAPORE LTD	14,000	0.92	12,950.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	3,602	25.18	90,698.36	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	7,808	10.76	84,014.08	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,642	26.09	68,929.78	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,300	8.85	20,355.00	
	CAPITALAND LTD	6,211	3.63	22,545.93	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	17,500	3.27	57,225.00	
シンガポールドル小計		57,346		379,403.68	(30,284,001)
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	2,421	28.21	68,296.41	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,406	25.62	87,261.72	
	NICE LTD	172	537.50	92,450.00	
イスラエルシェケル小計		5,999		248,008.13	(7,631,210)
合 計		2,324,414		8,158,784,232	(8,158,784,232)

(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	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	1,361	22,510.94	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	213	33,707.25	
		AMERICAN TOWER CORP	859	186,119.53	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	3,008	26,440.32	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	276	60,557.16		
	BOSTON PROPERTIES INC	326	43,090.68		
	CAMDEN PROPERTY TRUST	182	20,717.06		
	CROWN CASTLE INTL CORP	872	122,952.00		
	DIGITAL REALTY TRUST INC	428	56,846.96		
	DUKE REALTY CORPORATION	777	26,853.12		
	EQUINIX INC	178	100,701.72		
	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	770	67,513.60		
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	145	47,138.05		
	EXTRA SPACE STORAGE INC	323	36,250.29		
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	194	26,973.76		
	HCP INC	1,109	40,256.70		
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1,367	22,801.56		
	INVITATION HOMES INC	938	28,974.82		
	IRON MOUNTAIN INC	538	18,340.42		
	KIMCO REALTY CORPORATION	1,073	22,693.95		
	MACERICH CO/THE	187	5,329.50		
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	280	37,934.40		
	PROLOGIS INC	1,215	110,394.90		
	PUBLIC STORAGE	317	74,178.00		
	REALTY INCOME CORP	706	57,101.28		
	REGENCY CENTERS CORP	482	33,017.00		
	SBA COMMUNICATIONS CORP	240	58,596.00		
	SIMON PROPERTY GROUP INC	639	99,402.84		
	SL GREEN REALTY CORP	250	20,712.50		
	UDR INC	680	33,605.60		
	VENTAS INC	800	52,800.00		
	VORNADO REALTY TRUST	436	28,026.08		
	WELLTOWER INC	846	74,414.16		
	WEYERHAEUSER CO	1,373	39,899.38		
	WP CAREY INC	324	29,723.76		
	米ドル小計	23,712	1,766,575.29	(192,203,391)	
ユーロ	投資証券	GECINA SA	150	22,635.00	
		KLEPIERRE	588	19,645.08	

		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	49,666.50	
ユーロ小計			1,089	91,946.58	(11,084,160)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	3,140	19,279.60	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	15,750.81	
		SEGRO PLC	2,651	21,801.82	
英ポンド小計			7,485	56,832.23	(7,930,937)
豪ドル	投資証券	DEXUS	2,875	34,787.50	
		GOODMAN GROUP	3,775	54,058.00	
		GPT GROUP	5,900	37,288.00	
		LENDLEASE GROUP	1,550	28,024.00	
		MIRVAC GROUP	11,628	36,977.04	
		SCENTRE GROUP	11,481	44,775.90	
		STOCKLAND	5,114	24,444.92	
		VICINITY CENTRES	8,011	21,469.48	
豪ドル小計			50,334	281,824.84	(20,914,221)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	4,567	388,195.00	
香港ドル小計			4,567	388,195.00	(5,388,146)
合計				237,520,855	(237,520,855)

(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 556銘柄	96.7%		66.7%
	投資証券 35銘柄		3.3%	2.3%
加ドル	株式 60銘柄	100.0%		3.7%
ユーロ	株式 166銘柄	98.9%		11.5%
	投資証券 3銘柄		1.1%	0.1%

英ポンド	株式	74銘柄	98.4%		5.9%
	投資証券	3銘柄		1.6%	0.1%
スイスフラン	株式	30銘柄	100.0%		3.4%
スウェーデンクローナ	株式	21銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式	7銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	100.0%		0.7%
豪ドル	株式	41銘柄	90.4%		2.3%
	投資証券	8銘柄		9.6%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	3銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	23銘柄	94.8%		1.2%
	投資証券	1銘柄		5.2%	0.1%
シンガポールドル	株式	8銘柄	100.0%		0.4%
イスラエルシェケル	株式	3銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,033,935	-
コール・ローン	94,602,155	167,968,244
国債証券	30,067,973,850	31,964,995,556
地方債証券	2,792,055,000	3,166,772,000
特殊債券	3,106,375,000	3,263,504,000
社債券	2,356,368,000	2,753,050,000
未収利息	80,137,461	80,383,938
前払費用	719,683	1,407,203
流動資産合計	38,521,265,084	41,398,080,941
資産合計	38,521,265,084	41,398,080,941
負債の部		

流動負債		
未払解約金	54,418,138	7,446,973
未払利息	148	46
流動負債合計	54,418,286	7,447,019
負債合計	54,418,286	7,447,019
純資産の部		
元本等		
元本	27,733,551,245	28,913,282,954
剰余金		
剰余金又は欠損金()	10,733,295,553	12,477,350,968
元本等合計	38,466,846,798	41,390,633,922
純資産合計	38,466,846,798	41,390,633,922
負債純資産合計	38,521,265,084	41,398,080,941

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	26,501,934,817円	27,733,551,245円
	期首からの追加設定元本額	3,531,441,697円	3,514,710,092円
	期首からの一部解約元本額	2,299,825,269円	2,334,978,383円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	1,832,450,054円	2,535,930,689円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,862,268,494円	2,322,233,086円
	DCインデックスバランス(株式60)	1,342,863,165円	1,675,794,828円
	DCインデックスバランス(株式80)	221,368,003円	259,508,561円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,798,701,774円	1,955,743,762円

世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,834,626,257円	3,612,132,571円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	3,933,014円	- 円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,514,625,168円	1,528,015,066円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,753,159円	4,277,309円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	26,123,505円	25,114,375円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	119,991,693円	120,247,275円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	300,427,344円	272,928,864円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,991,215,999円	4,280,739,177円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	3,454,881円	- 円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	8,181,717円	- 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,241,071,680円	1,312,679,950円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,252,645,847円	1,273,971,733円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	685,795,510円	679,086,849円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	102,644,008円	97,643,471円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,322,149,282円	6,654,000,097円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	264,260,691円	303,235,291円
計	27,733,551,245円	28,913,282,954円
2. 受益権の総数	27,733,551,245口	28,913,282,954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 2017年10月27日 至 2018年10月26日	自 2018年10月27日 至 2019年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2018年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

国債証券	239,804,020
地方債証券	22,560,000
特殊債券	19,086,000
社債券	15,636,000
合計	297,086,020

(2019年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	875,565,314
地方債証券	21,381,000
特殊債券	15,962,000
社債券	13,905,000
合計	824,317,314

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.3870円	1口当たり純資産額	1.4315円
(1万口当たり純資産額)	(13,870円)	(1万口当たり純資産額)	(14,315円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 1 2 3 回利付国債（ 5 年）	100,000,000	100,088,728	
	第 1 2 4 回利付国債（ 5 年）	560,000,000	561,119,540	
	第 1 2 5 回利付国債（ 5 年）	325,000,000	326,113,288	
	第 1 2 6 回利付国債（ 5 年）	220,000,000	220,767,800	
	第 1 回利付国債（ 4 0 年）	70,000,000	108,032,400	
	第 2 回利付国債（ 4 0 年）	145,000,000	217,642,100	
	第 3 回利付国債（ 4 0 年）	50,000,000	75,719,000	
	第 4 回利付国債（ 4 0 年）	95,000,000	145,321,500	
	第 5 回利付国債（ 4 0 年）	35,000,000	51,951,200	
	第 6 回利付国債（ 4 0 年）	70,000,000	102,589,200	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年）	50,000,000	70,610,000	
	第 8 回利付国債（ 4 0 年）	95,000,000	125,815,150	
	第 9 回利付国債（ 4 0 年）	160,000,000	158,988,800	
	第 1 0 回利付国債（ 4 0 年）	125,000,000	145,563,750	
	第 1 1 回利付国債（ 4 0 年）	140,000,000	158,372,200	
	第 1 2 回利付国債（ 4 0 年）	65,000,000	66,644,500	
	第 3 0 8 回利付国債（ 1 0 年）	140,000,000	141,367,450	
	第 3 0 9 回利付国債（ 1 0 年）	134,000,000	135,134,600	
	第 3 1 0 回利付国債（ 1 0 年）	78,000,000	78,894,012	
	第 3 1 1 回利付国債（ 1 0 年）	23,000,000	23,222,634	
	第 3 1 2 回利付国債（ 1 0 年）	205,000,000	208,296,400	
	第 3 1 3 回利付国債（ 1 0 年）	370,000,000	377,781,100	
	第 3 1 5 回利付国債（ 1 0 年）	65,000,000	66,508,650	
	第 3 1 6 回利付国債（ 1 0 年）	35,000,000	35,754,950	
	第 3 1 7 回利付国債（ 1 0 年）	105,000,000	107,634,450	
	第 3 1 8 回利付国債（ 1 0 年）	185,000,000	189,290,150	
	第 3 1 9 回利付国債（ 1 0 年）	5,000,000	5,142,600	
	第 3 2 0 回利付国債（ 1 0 年）	190,000,000	195,010,300	
	第 3 2 1 回利付国債（ 1 0 年）	175,000,000	180,169,500	
	第 3 2 2 回利付国債（ 1 0 年）	75,000,000	77,035,500	
	第 3 2 3 回利付国債（ 1 0 年）	45,000,000	46,350,900	
	第 3 2 4 回利付国債（ 1 0 年）	25,000,000	25,684,000	
第 3 2 5 回利付国債（ 1 0 年）	210,000,000	216,329,400		

第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,892,800	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,139,800	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,300,500	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	238,829,700	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	218,624,700	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,656,800	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	217,921,200	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,818,000	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	508,330,900	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	83,168,800	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,875,400	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	404,067,300	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	383,978,600	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	436,590,000	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	724,689,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	133,039,400	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	250,958,400	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	51,263,000	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	625,975,900	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	503,475,000	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	164,489,600	
第348回利付国債(10年)	90,000,000	92,573,100	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	504,043,400	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	493,545,600	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	447,062,550	
第352回利付国債(10年)	390,000,000	400,592,400	
第353回利付国債(10年)	200,000,000	205,300,000	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	277,434,560	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	198,911,580	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	47,500,600	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	146,899,500	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,925,600	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	55,256,800	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	76,232,200	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	94,483,280	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	27,209,200	

第26回利付国債(30年)	170,000,000	234,821,000	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	40,768,780	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	132,935,740	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	387,244,560	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	204,428,490	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	165,283,200	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	70,225,500	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	182,452,500	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	279,750,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	229,024,320	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	184,893,300	
第37回利付国債(30年)	131,000,000	177,228,590	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	126,976,050	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	102,166,500	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	120,771,000	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	52,844,400	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	178,560,450	
第43回利付国債(30年)	205,000,000	271,786,950	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	199,104,000	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	76,922,400	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	128,310,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	150,594,800	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	132,432,300	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	113,723,100	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,852,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	69,062,700	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	93,317,400	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	111,505,800	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	122,524,600	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	122,475,100	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	55,717,500	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	111,385,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	111,332,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	184,766,200	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	136,958,400	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	75,976,600	

第62回利付国債(30年)	120,000,000	123,643,200	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	90,238,500	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,472,254	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	102,073,950	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	58,841,100	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	243,993,870	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	40,421,550	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	15,783,000	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	69,539,580	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	54,942,680	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	143,395,650	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,026,860	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	310,316,400	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,143,720	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,322,830	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,540,860	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	108,953,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,901,900	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,235,440	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	86,460,660	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	116,912,640	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	125,006,560	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	126,244,730	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	132,445,560	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,283,700	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,466,240	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	44,916,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	180,598,400	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	68,433,000	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	150,629,700	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	351,543,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,749,440	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	294,712,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,228,200	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	70,162,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,845,500	

第95回利付国債(20年)	82,000,000	98,249,940	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	115,894,800	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,833,950	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	111,696,440	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	139,620,780	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,189,300	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	80,744,400	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	99,517,410	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,418,020	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,673,920	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	92,908,200	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,431,280	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	157,405,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	159,758,820	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,301,720	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	119,111,160	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,732,000	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	97,560,800	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	354,632,300	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	63,819,600	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,065,800	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	68,279,750	
第117回利付国債(20年)	293,000,000	360,668,350	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,245,400	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	36,091,800	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,709,900	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,786,760	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,512,030	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	242,519,550	
第124回利付国債(20年)	180,000,000	221,842,800	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	62,958,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	129,803,100	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,841,450	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,831,000	
第130回利付国債(20年)	170,000,000	207,377,900	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,495,040	

第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,379,050	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,690,300	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	61,302,000	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,408,600	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	216,216,000	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	243,286,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	142,934,400	
第139回利付国債(20年)	150,000,000	180,565,500	
第140回利付国債(20年)	508,000,000	619,343,440	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	238,252,950	
第142回利付国債(20年)	85,000,000	104,969,900	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	113,832,120	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	514,976,600	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	435,538,850	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	165,962,250	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	73,059,600	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	108,487,800	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	138,832,600	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	107,484,300	
第151回利付国債(20年)	200,000,000	233,164,000	
第152回利付国債(20年)	140,000,000	163,462,600	
第153回利付国債(20年)	170,000,000	201,261,300	
第154回利付国債(20年)	120,000,000	140,320,800	
第155回利付国債(20年)	140,000,000	159,383,000	
第156回利付国債(20年)	110,000,000	114,581,500	
第157回利付国債(20年)	50,000,000	50,405,500	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	179,654,300	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	161,011,500	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	152,660,200	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	128,726,400	
第162回利付国債(20年)	70,000,000	75,030,900	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	176,863,500	
第164回利付国債(20年)	285,000,000	300,164,850	
第165回利付国債(20年)	60,000,000	63,121,200	
第166回利付国債(20年)	100,000,000	108,805,000	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	168,073,600	

	第168回利付国債(20年)	100,000,000	103,059,000	
	第169回利付国債(20年)	160,000,000	161,648,000	
国債証券 合計		28,152,000,000	31,964,995,556	
地方債証券	第694回東京都公募公債	200,000,000	203,676,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	102,286,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	101,995,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	204,342,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	102,824,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,697,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	204,676,000	
	平成27年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,714,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,666,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,561,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,679,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,179,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,646,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	103,095,000	
	第9回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,897,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,764,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	102,333,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,772,000	
	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	205,912,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	102,060,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,999,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,032,000	
	平成27年度第1回相模原市公募公債	200,000,000	205,534,000	
平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	102,040,000		
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	102,393,000		
地方債証券 合計		3,100,000,000	3,166,772,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,413,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,417,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,314,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	204,418,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,259,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,520,000	

	第 2 2 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,083,000	
	第 3 1 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,188,000	
	第 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,149,000	
	第 1 7 回道路債券	100,000,000	104,760,000	
	第 8 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,180,000	
	第 1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,335,000	
	第 1 2 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,916,000	
	第 1 4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,197,000	
	第 3 5 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,514,000	
	第 4 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,102,000	
	F 2 2 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,297,000	
	F 2 9 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,284,000	
	第 3 5 回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	102,093,000	
	第 5 2 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,394,000	
	第 3 8 回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,342,000	
	第 3 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,011,000	
	第 1 7 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,946,000	
	第 1 9 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,066,000	
	第 3 1 6 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,040,000	
	第 3 1 8 回信金中金債(5年)	100,000,000	99,999,000	
	第 3 2 0 回信金中金債(5年)	100,000,000	99,951,000	
	第 3 2 2 回信金中金債(5年)	200,000,000	199,980,000	
	第 3 7 回国際協力機構債券	100,000,000	100,336,000	
	特殊債券 合計	3,200,000,000	3,263,504,000	
社債券	第 1 5 回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,989,000	
	第 1 1 回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,223,000	
	第 1 4 回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,415,000	
	第 6 回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,010,000	
	第 5 回不二製油グループ本社株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	201,834,000	

第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,458,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,620,000	
第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,136,000	
第13回株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,873,000	
第9回三菱UFJ信託銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	204,680,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,816,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,740,000	
第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	107,497,000	
第87回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	204,648,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,851,000	
第11回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,345,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	203,638,000	
第26回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,955,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,365,000	
第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,105,000	
第34回東京瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	203,852,000	
社債券 合計	2,700,000,000	2,753,050,000	
合計	37,152,000,000	41,148,321,556	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	346,171,535	197,170,172
金銭信託	7,521,161	-
コール・ローン	30,889,993	42,416,845
国債証券	145,412,931,383	153,398,988,437
派生商品評価勘定	165	-
未収利息	1,305,504,312	1,250,297,032
前払費用	25,047,200	24,113,142
流動資産合計	147,128,065,749	154,912,985,628
資産合計	147,128,065,749	154,912,985,628
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	288,000	36,630
未払解約金	94,343,279	77,116,063
未払利息	48	11
流動負債合計	94,631,327	77,152,704
負債合計	94,631,327	77,152,704
純資産の部		
元本等		
元本	66,172,631,391	66,014,655,688
剰余金		
剰余金又は欠損金()	80,860,803,031	88,821,177,236
元本等合計	147,033,434,422	154,835,832,924
純資産合計	147,033,434,422	154,835,832,924
負債純資産合計	147,128,065,749	154,912,985,628

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

		2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	68,830,787,765円	66,172,631,391円
	期首からの追加設定元本額	3,405,417,219円	2,720,902,002円
	期首からの一部解約元本額	6,063,573,593円	2,878,877,705円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	11,964,377,999円	12,643,238,374円
	DCインデックスバランス(株式20)	174,920,013円	239,828,273円
	DCインデックスバランス(株式40)	255,247,492円	316,392,308円
	DCインデックスバランス(株式60)	331,015,030円	410,335,597円
	DCインデックスバランス(株式80)	268,750,988円	316,679,082円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,997,016,330円	24,749,651,028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	2,370,288,668円	2,264,393,398円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	19,440,325,696円	17,569,671,668円
	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	21,654,534円	-円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	543,560,785円	875,736,013円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	158,267,081円	157,572,835円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,942,188円	2,657,723円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,217,087円	3,073,153円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,154,550円	8,243,513円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	14,261,162円	12,955,389円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	878,532,138円	858,147,704円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,029,476,088円	896,266,419円
	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	2,937,316円	-円
	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	5,673,700円	-円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	59,228,746円	61,561,077円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	85,787,859円	86,960,516円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	84,822,845円	83,907,131円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	63,482,009円	60,614,848円
インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	4,156,011,407円	4,128,997,767円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	252,679,680円	267,771,872円
計	66,172,631,391円	66,014,655,688円
2. 受益権の総数	66,172,631,391口	66,014,655,688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 2017年10月27日 至 2018年10月26日	自 2018年10月27日 至 2019年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年10月28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>	<p>同左</p>

(有価証券に関する注記)

(2018年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,390,395,352
合計	4,390,395,352

(2019年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	10,733,716,333
合計	10,733,716,333

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2018年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	74,206,815	-	74,494,650	287,835
	米ドル	67,176,000	-	67,464,000	288,000
	ユーロ	7,030,815	-	7,030,650	165
合計		74,206,815	-	74,494,650	287,835

(2019年10月28日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	65,990,610	-	66,027,240	36,630
	米ドル	63,060,900	-	63,096,900	36,000
	英ポンド	2,929,710	-	2,930,340	630
合計		65,990,610	-	66,027,240	36,630

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2,220円	1口当たり純資産額	2,345円
(1万口当たり純資産額)	(22,220円)	(1万口当たり純資産額)	(23,455円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-20/09/30	6,000,000.00	6,018,163.80	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,690,605.47	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/10/15	2,000,000.00	1,999,882.82	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	2,001,601.40	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,286,145.11	
		US TREASURY N/B-2.875%-20/10/31	4,550,000.00	4,604,119.97	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,534,384.70	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,401,339.80	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	2,006,718.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,119,650.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-20/11/30	3,400,000.00	3,439,378.80	
		US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,405,531.04	
		US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,024,140.40	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,001,601.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,907,347.49	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,413,406.16	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,992,695.32	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,510,000.00	4,621,957.14	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,518,164.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,379,905.65	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,985,117.18			

US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	342,662.88	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,262,087.30	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,215,023.80	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,990,859.38	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,415,005.87	
US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	3,030,000.00	3,073,437.77	
US TREASURY N/B-2.0%-21/05/31	3,400,000.00	3,417,265.54	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,050,223.05	
US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,928,833.83	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	6,095,375.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,864,580.08	
US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	3,047,988.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,353,000.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,953,125.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	11,860,000.00	11,954,740.05	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,356,773.43	
US TREASURY N/B-2.75%-21/09/15	7,500,000.00	7,653,075.75	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,421,046.80	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,484,766.28	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,856,405.93	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,983,984.38	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,424,316.17	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,029,140.40	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	601,335.90	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,151,870.17	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	8,840,000.00	8,813,583.60	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,521,191.25	
US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,077,421.60	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,506,591.75	
US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,035,664.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,805,097.60	
US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,029,570.20	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,009,316.20	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,822,784.80	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,006,484.20	

US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	500,000.00	506,103.50	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,442,310.02	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,010,781.10	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,533,349.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,012,812.40	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,970,758.03	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,764,223.70	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	5,000,000.00	5,002,050.50	
US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,000,000.00	1,993,789.06	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,913,841.69	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	5,250,000.00	5,250,512.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,563,936.23	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	2,015,195.20	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,022,382.70	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,426,390.40	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,000,546.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,448,029.34	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,960,708.96	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,007,890.60	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,617,308.85	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,300,000.00	5,364,179.29	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,087,587.87	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	588,380.22	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,991,640.62	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,191,861.37	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,159,750.78	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,736,617.12	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	7,650,000.00	7,680,629.83	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,499,941.41	
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,350,349.52	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,963,671.88	
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,035,488.20	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	11,000,000.00	10,848,535.17	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,468,937.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,832,295.72	

US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	5,500,000.00	5,445,646.91	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	380,000.00	397,901.53	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,699,335.94	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,173,828.00	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	2,966,153.68	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,898,202.02	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,561,035.00	
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,119,179.50	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,050,078.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	5,800,000.00	6,004,245.84	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,451,980.18	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	3,500,000.00	3,570,751.80	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,680,682.73	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,327,615.36	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,030,898.40	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,079,570.20	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	6,017,386.32	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,580,000.00	3,639,433.36	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	4,100,000.00	4,165,263.39	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	1,660,000.00	1,668,137.81	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,249,438.16	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,000,000.00	4,020,468.40	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,774,481.25	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,435,198.40	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,100,000.00	2,063,496.09	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,454,000.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,121,337.50	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,450,000.00	5,606,580.68	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,227,679.68	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,956,369.01	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,563,515.55	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,056,392.51	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,174,506.95	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,618,796.60	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,339,218.64	

US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,915,031.04	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,223,559.52	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	4,000,000.00	4,231,406.00	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	4,000,000.00	4,262,343.60	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	5,312,573.04	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	5,000,000.00	5,369,726.50	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,131,541.24	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,410,337.50	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,109,062.40	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,450,000.00	1,529,608.33	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,262,445.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,700,000.00	5,674,728.53	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,570,000.00	1,645,372.24	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,139,458.02	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,082,812.40	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,640,000.00	3,622,368.75	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	4,000,000.00	4,104,531.20	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,021,679.60	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	4,200,000.00	4,245,362.94	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,945,470.48	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,230,076.08	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,138,929.65	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,976,905.92	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	3,170,906.81	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	5,282,067.58	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,860,000.00	5,129,577.93	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	6,332,323.99	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,307,265.60	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,580,000.00	2,807,211.31	
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	651,679.65	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,800,000.00	5,229,280.80	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	2,000,000.00	2,579,570.20	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	3,560,000.00	3,958,413.84	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,297,207.00	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	3,710,000.00	3,975,424.15	

US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,100,000.00	4,308,042.61	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,440,000.00	1,417,443.74	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,510,748.35	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,985,714.02	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,250,000.00	1,806,152.25	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,587,086.63	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,220,000.00	1,681,336.29	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,488,466.63	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,526,245.17	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,392,475.57	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,369,488.96	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,178,610.52	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,851,750.00	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,715,462.76	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,160,205.05	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,196,929.64	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,482,845.28	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	579,042.95	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	871,500.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,177,343.60	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,314,804.60	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,050,000.00	5,615,659.08	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	6,409,799.68	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,745,761.55	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,763,769.40	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	4,108,289.02	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	4,704,328.12	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,755,232.36	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,437,220.60	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,648,812.48	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,912,915.85	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,453,540.65	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,915,554.60	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,603,515.50	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,130,179.68	

		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,238,125.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,210,375.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,070,641.35	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,187,304.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,107,636.48	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,155,087.65	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,820,000.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	4,711,476.46	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,634,319.17	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	3,801,638.61	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,377,402.10	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	250,000.00	247,749.02	
米ドル小計			640,580,000.00	675,452,364.75	(73,489,217,284)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-20/11/01	670,000.00	671,587.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-21/02/01	825,000.00	830,346.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,140,000.00	2,112,522.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-21/05/01	890,000.00	891,112.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	973,075.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-21/08/01	640,000.00	638,316.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,470,000.00	1,445,451.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-21/11/01	460,000.00	456,297.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,640,000.00	1,596,589.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,007,420.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,520,000.00	1,493,126.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,144,742.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,295,697.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	820,000.00	832,259.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	812,222.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,165,875.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	950,000.00	947,055.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,067,996.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,096,370.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	539,104.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,060,000.00	1,018,585.80	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,037,000.00	1,074,809.02	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,060,000.00	1,452,369.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	716,360.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	190,000.00	184,243.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,524,976.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	940,000.00	1,416,909.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,165,000.00	1,652,692.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,315,000.00	1,821,748.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,320,438.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	513,000.00	558,067.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	453,315.30	
加ドル小計			31,164,000.00	34,211,682.87	(2,848,122,598)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	24,652,231.43	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	14,200,000.00	14,388,659.78	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	21,362,011.79	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	17,600,000.00	18,469,692.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	6,300,000.00	6,646,026.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	24,608,174.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	10,116,094.73	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	22,100,000.00	23,013,396.31	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	12,150,000.00	13,564,120.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	12,664,350.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	7,000,000.00	7,466,774.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	10,032,369.36	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	9,400,000.00	10,706,412.94	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,500,000.00	16,437,421.40	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	10,870,000.00	11,858,715.09			
メキシコペソ小計			213,070,000.00	225,986,451.57	(1,290,382,638)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,406,510.37	

BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,202,029.20	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,250,000.00	1,429,135.00	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,192,339.44	
BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	504,143.85	
BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,200,000.00	1,373,529.60	
BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	659,528.22	
BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,330,000.00	1,420,316.31	
BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	850,000.00	1,117,089.55	
BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,123,920.24	
BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	1,070,000.00	1,155,931.70	
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,548,807.27	
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,046,359.15	
BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	590,000.00	646,681.70	
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	833,972.25	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	983,269.32	
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	370,000.00	425,542.92	
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	831,326.52	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,475,000.00	2,537,983.82	
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	503,327.92	
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	655,000.00	831,142.60	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,370,000.00	2,412,065.84	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,429,519.78	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	870,000.00	1,077,876.06	
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	567,528.75	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	497,236.77	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	559,183.53	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,700,000.00	1,791,885.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	770,000.00	774,750.13	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,080,000.00	2,265,979.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,760,909.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/10/31	200,000.00	201,808.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-	1,790,000.00	2,044,727.74	

22/01/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,662,322.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,420,000.00	1,454,338.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	1,988,480.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	1,290,000.00	1,319,706.89	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,640,000.00	1,946,698.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,615,823.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,984,323.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	200,000.00	204,270.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,820,000.00	2,088,511.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,900,000.00	2,080,956.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,630,000.00	2,075,434.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,915,801.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,585,000.00	1,788,903.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,750,000.00	2,447,686.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,760,000.00	1,917,836.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,490,000.00	1,650,221.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,705,000.00	1,888,812.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,926,094.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,720,000.00	1,905,152.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	2,100,964.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-	2,110,000.00	3,234,854.08	

29/01/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,710,000.00	1,905,954.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,010,000.00	1,044,020.01	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,770,000.00	2,075,586.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,829,542.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,450,000.00	1,798,928.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	730,000.00	858,147.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,450,333.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,508,572.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,570,000.00	2,741,306.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,180,000.00	2,255,139.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,320,000.00	1,871,567.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	785,000.00	1,084,395.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	605,000.00	1,001,161.26	
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,008,666.00	
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,211,816.40	
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	749,757.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,410,000.00	1,464,744.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,844,769.93	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,666,097.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,119,616.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,634,079.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,701,824.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,039,131.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,854,867.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,040,489.87
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,021,969.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,358,800.06
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,143,155.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,975,849.17
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,876,805.34
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,780,461.03
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,952,162.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,800,000.00	2,909,096.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,673,747.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,752,605.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,420,000.00	2,616,027.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,738,806.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,645,000.00	1,782,221.62
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,310,000.00	1,915,785.92
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	2,170,000.00	2,306,026.01
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,160,000.00	1,233,049.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,167,671.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,854,209.49

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,730,000.00	3,021,066.13
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,005,000.00	3,453,968.18
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,160,000.00	2,158,983.88
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,300,000.00	2,605,040.74
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	2,125,055.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	2,660,000.00	4,265,283.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,700,000.00	2,788,484.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	500,000.00	660,506.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.2%- 20/10/15	380,000.00	381,660.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	1,180,000.00	1,190,654.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,107,150.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 21/04/15	1,170,000.00	1,174,429.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,271,650.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,515,000.00	1,529,856.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,580,000.00	2,756,838.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,270,000.00	2,473,771.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.3%- 21/10/15	880,000.00	921,690.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	777,241.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,110,737.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	1,950,000.00	2,182,941.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,432,752.23

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	1,003,221.53
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	600,000.00	616,476.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,301,699.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,800,000.00	2,081,923.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,364,764.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,327,494.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	935,472.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,234,095.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,573,094.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,991,087.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,460,000.00	1,587,544.14
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,080,000.00	1,101,632.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,190,000.00	2,959,605.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,950,210.57
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	995,000.00	1,065,239.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,743,209.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,050,000.00	1,107,364.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,549,247.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	2,780,000.00	3,452,792.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	675,000.00	711,854.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,480,567.20

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,452,145.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,244,275.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,783,051.27
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,312,510.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	720,000.00	790,146.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,560,000.00	2,266,193.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,535,119.53
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	955,073.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,035,000.00	1,138,150.17
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,880,000.00	4,164,304.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,035,000.00	1,138,891.23
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,760,000.00	2,350,931.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,435,000.00	1,679,202.27
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,200,000.00	1,429,862.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	4,035,357.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	2,159,009.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,680,000.00	4,086,110.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,560,717.47
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,670,917.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	690,000.00	784,709.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	3,055,311.16

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	650,000.00	813,379.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	993,904.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,670,312.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	817,281.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,854,508.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	310,000.00	378,036.01
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,811,066.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	2,029,926.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,320,000.00	1,679,979.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,483,422.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,455,000.00	1,916,211.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	785,000.00	1,097,099.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	775,768.75
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	742,595.70
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	319,438.20
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	590,073.00
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	255,252.50
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	578,998.68
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	520,000.00	653,559.92
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	344,271.36
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	433,106.78
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	366,167.13
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	479,344.92
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	420,000.00	446,960.22
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	200,000.00	212,811.60
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	371,370.44
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	330,000.00	379,628.70

FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	539,833.23
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	300,000.00	378,385.35
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,588,283.68
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,473,532.25
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,156,935.90
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,226,449.92
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,115,512.96
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,988,865.00
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	183,705.30
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,269,138.24
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,428,375.64
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,697,308.92
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,542,601.38
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,096,832.24
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,410,000.00	3,590,730.00
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,136,729.91
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,522,578.27
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,430,000.00	4,305,593.25
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	3,000,000.00	3,170,652.00
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,960,000.00	3,081,247.52
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	3,910,000.00	4,294,157.50
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,730,000.00	4,644,969.00
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,108,364.98
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,920,000.00	3,164,202.20
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,232,318.13
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	1,670,000.00	1,769,443.49
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,950,000.00	3,753,456.37
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,965,000.00	4,651,190.83
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,520,000.00	4,382,022.96
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	1,345,000.00	1,551,172.36
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,670,000.00	4,522,680.96
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,585,000.00	2,982,870.27
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,713,330.06
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	1,425,000.00	1,786,066.50
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,745,000.00	5,037,931.44

FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,030,000.00	3,319,935.08	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	2,340,000.00	3,150,599.40	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,000,000.00	1,210,020.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,235,246.72	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	930,000.00	1,942,942.98	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,094,986.20	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	640,000.00	674,897.53	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	495,280.99	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,502.25	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	655,223.83	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	782,286.37	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,261,289.25	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,105,791.01	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	665,065.92	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	200,000.00	220,349.50	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	980,411.33	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	240,000.00	271,602.96	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	400,466.62	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	500,000.00	597,338.00	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	685,000.00	887,885.35	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	283,000.00	329,851.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,558,342.97	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	709,979.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,328,714.51	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	406,091.77	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,151,737.86	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,035,135.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	184,413.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,772,913.26	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,329,600.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,271,042.63	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,331,521.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,777,881.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	906,000.00	991,240.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	495,000.00	519,175.80	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,469,424.64	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,230,000.00	2,077,128.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	445,000.00	479,138.17	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,165,000.00	2,106,194.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,073,000.00	1,815,507.41	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	209,229.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	664,329.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,358,242.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	769,133.21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,056,047.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	459,227.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,168,912.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	945,829.21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	987,342.03	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	936,296.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	1,032,716.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	725,251.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	740,000.00	1,117,206.12	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	550,000.00	595,024.64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	578,015.01	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	758,604.45	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,074,000.00	1,802,215.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	559,000.00	927,735.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	765,000.00	971,241.99	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	641,676.61	
	ユーロ小計		391,680,000.00	482,211,245.99 (58,130,565,704)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	495,000.00	615,616.65	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,052,126.59	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,142,504.04	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,176,724.32	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,191,788.40	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,050,000.00	2,126,154.22	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,721,730.78	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	930,000.00	952,552.50	

UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,038,586.78	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,618,606.11	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,593,799.36	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,410,000.00	1,490,384.10	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,546,147.96	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,350,000.00	1,473,708.60	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,483,700.00	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	200,000.00	204,160.00	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,195,000.00	1,716,474.10	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,784,790.00	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	1,790,000.00	2,689,969.04	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,500,133.62	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	645,000.00	718,504.20	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,321,649.60	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,948,062.32	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,415,000.00	2,257,541.94	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,465,000.00	2,475,492.54	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,406,391.20	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,636,796.00	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,425,000.00	2,454,420.00	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,660,000.00	1,798,112.00	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	400,000.00	459,569.60	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,145,000.00	2,051,136.97	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,327,000.00	2,287,349.90	
UK TREASURY-1.625%-54/10/22	145,000.00	166,490.45	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	3,071,814.51	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,302,321.65	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,394,993.22	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	3,204,658.38	
UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,665,000.00	1,668,192.30	
UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,643,398.90	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	966,480.18	
UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,742,178.10	
英債券小計	51,674,000.00	70,095,211.13	(9,781,786,713)

スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,410,000.00	7,851,269.94	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	7,700,000.00	8,486,555.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,737,453.95	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,494,940.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,690,000.00	5,093,996.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,822,015.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,752,431.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,490,000.00	5,562,082.80	
スウェーデンクローナ小計			40,400,000.00	45,800,745.84	(514,342,375)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,270,000.00	6,518,517.72	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,370,000.00	5,513,244.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,420,000.00	3,676,671.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,352,449.78	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,296,150.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	2,928,664.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,540,000.00	2,677,464.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,600,000.00	1,658,640.00	
ノルウェークローネ小計			28,560,000.00	29,621,802.85	(350,425,927)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,930,000.00	7,467,768.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,234,758.08	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,040,000.00	9,194,675.85	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	4,496,752.00	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,500,000.00	1,630,200.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,770,000.00	19,011,755.64	
デンマーククローネ小計			37,040,000.00	49,035,909.57	(791,439,580)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,240,000.00	1,290,358.88	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,310,000.00	2,330,224.05	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-21/05/25	740,000.00	724,114.43	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,442,162.15	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,060,000.00	1,148,515.30	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,319,113.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,970,000.00	2,203,454.85	

		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,159,850.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,474,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,030,000.00	2,101,963.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	520,000.00	533,104.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,330,000.00	2,512,905.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	3,013,680.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,696,449.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,110,000.00	2,241,453.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,148,991.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,120,000.00	1,197,840.00	
ポーランドズロチ小計			30,855,000.00	32,538,479.31	(917,259,731)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,510,000.00	1,525,527.93	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,080,000.00	2,239,495.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,391,705.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,850,000.00	2,099,938.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,020,000.00	1,067,402.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,920,000.00	2,234,647.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,090,000.00	2,273,524.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,200,000.00	2,485,679.46	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,560,000.00	3,100,507.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,966,963.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,542,761.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,080,000.00	2,287,602.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,900,000.00	2,179,050.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,090,000.00	2,503,410.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,570,000.00	1,822,862.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,490,000.00	1,702,261.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	695,000.00	724,799.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,618,798.82	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	640,000.00	772,240.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,273,336.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	863,696.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	400,000.00	487,815.31	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	1,286,027.02	

豪ドル小計			35,747,000.00	41,450,053.92 (3,076,008,501)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	616,466.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	370,000.00	367,817.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	310,000.00	311,302.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	470,000.00	490,304.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	320,000.00	321,760.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	595,000.00	619,454.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	100,000.00	101,773.45
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	575,853.30
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	260,000.00	270,530.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	300,000.00	308,850.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	608,310.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	415,000.00	446,208.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	350,000.00	386,949.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	366,795.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	532,182.17
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	220,000.00	232,870.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	143,782.99
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	429,000.00
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	510,000.00	586,607.10		
シンガポールドル小計			7,193,000.00	7,716,815.01 (615,956,174)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,015,743.76
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	467,954.91
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	858,627.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	650,000.00	660,821.39
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	773,199.07
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	816,120.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	630,000.00	651,420.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	328,694.97
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,011,360.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	480,000.00	493,200.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	461,925.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	650,000.00	668,362.50

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	300,000.00	310,725.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	759,632.36	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	628,892.82	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,281,303.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	440,000.00	498,042.07	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	666,648.55	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	920,000.00	1,009,028.03	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	700,000.00	793,812.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,780,000.00	1,811,328.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	855,519.98	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,765,622.42	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	976,660.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,341,813.54	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	461,859.61	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	650,021.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	610,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	847,827.07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,298,528.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,089,184.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	468,287.95	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	987,845.09	
マレーシアリングット小計			26,145,000.00	27,320,212.22	(710,325,517)
南アフリカ ランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,654,852.04	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	7,980,000.00	8,100,650.01	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	17,250,000.00	19,411,545.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	10,000,000.00	9,434,220.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	8,231,203.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	8,920,000.00	8,320,836.01	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	7,810,000.00	7,452,330.50	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	6,108,432.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	9,500,000.00	8,641,848.85	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	7,560,000.00	7,075,367.71	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,319,998.43	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	10,650,000.00	9,625,369.35	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	18,100,000.00	16,327,067.89	
南アフリカランド小計		127,770,000.00	118,703,722.46 (883,155,695)	
合計			153,398,988,437 (153,398,988,437)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 208銘柄	100.0%	47.9%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 282銘柄	100.0%	37.9%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	97,169,128	96,178,592
金銭信託	15,003,438	-
コール・ローン	61,620,281	297,712,670
国債証券	24,012,612,135	23,973,158,706
派生商品評価勘定	264,684,285	1,455,095
未収利息	239,886,562	220,287,789
前払費用	5,213,463	11,051,223
流動資産合計	24,696,189,292	24,599,844,075
資産合計	24,696,189,292	24,599,844,075
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	35,464,965	474,286,479
未払解約金	52,361,625	16,423,458
未払利息	96	81
流動負債合計	87,826,686	490,710,018
負債合計	87,826,686	490,710,018
純資産の部		
元本等		
元本	16,823,343,930	15,247,027,897
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,785,018,676	8,862,106,160
元本等合計	24,608,362,606	24,109,134,057
純資産合計	24,608,362,606	24,109,134,057
負債純資産合計	24,696,189,292	24,599,844,075

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
1.	期首	2017年10月27日	2018年10月27日
	期首元本額	17,017,756,688円	16,823,343,930円
	期首からの追加設定元本額	1,122,522,227円	967,758,629円
	期首からの一部解約元本額	1,316,934,985円	2,544,074,662円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用)	2,098,854,047円	2,705,219,686円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,183,255,079円	1,154,074,686円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,492,130円	3,867,213円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	4,928,627円	4,521,317円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	12,564,634円	12,098,418円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	21,827,881円	18,993,425円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	12,532,569,503円	10,322,751,712円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	90,510,867円	91,313,946円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	131,366,819円	127,872,002円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	129,222,482円	122,465,334円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	97,118,078円	88,146,677円
	インデックスファンド海外債券(ヘッジあり)1年決算型	516,633,783円	595,703,481円
	計	16,823,343,930円	15,247,027,897円
2.	受益権の総数	16,823,343,930口	15,247,027,897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 2017年10月27日 至 2018年10月26日	自 2018年10月27日 至 2019年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2018年10月26日現在	2019年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2018年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	769,222,652
合計	769,222,652

(2019年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,559,176,705
合計	1,559,176,705

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2018年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	24,558,872,960	-	24,329,653,640	229,219,320
	米ドル	10,966,235,039	-	10,965,771,870	463,169
	加ドル	459,678,639	-	467,942,660	8,264,021
	メキシコペソ	205,498,855	-	204,640,020	858,835

ユーロ	9,811,796,484	-	9,603,928,590	207,867,894
英ポンド	1,640,076,901	-	1,632,914,200	7,162,701
スウェーデンク ローナ	151,195,334	-	149,079,540	2,115,794
ノルウェークロー ネ	73,886,258	-	73,140,870	745,388
デンマーククロー ネ	161,826,504	-	159,759,390	2,067,114
ポーランドズロチ	119,597,310	-	115,427,450	4,169,860
豪ドル	520,463,981	-	511,688,540	8,775,441
シンガポールドル	81,104,893	-	80,668,020	436,873
マレーシアリン ギット	232,876,513	-	232,294,470	582,043
南アフリカランド	134,636,249	-	132,398,020	2,238,229
合計	24,558,872,960	-	24,329,653,640	229,219,320

(2019年10月28日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	24,026,651,496	-	24,499,482,880	472,831,384
	米ドル	11,438,125,712	-	11,632,287,900	194,162,188
	加ドル	452,990,587	-	465,369,050	12,378,463
	メキシコペソ	180,962,448	-	192,296,270	11,333,822
	ユーロ	9,119,065,833	-	9,265,762,240	146,696,407
	英ポンド	1,472,061,140	-	1,555,166,410	83,105,270
	スウェーデンク ローナ	136,358,623	-	138,039,160	1,680,537
	ノルウェークロー ネ	65,400,697	-	64,613,250	787,447
	デンマーククロー ネ	127,734,454	-	129,375,210	1,640,756
	ポーランドズロチ	108,510,083	-	111,916,350	3,406,267
	豪ドル	482,062,080	-	491,516,030	9,453,950
	シンガポールドル	72,311,384	-	74,188,450	1,877,066
	マレーシアリン ギット	238,513,997	-	241,947,580	3,433,583

	南アフリカランド	132,554,458	-	137,004,980	4,450,522
	合計	24,026,651,496	-	24,499,482,880	472,831,384

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2018年10月26日現在		2019年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.4628円	1口当たり純資産額	1.5812円
(1万口当たり純資産額)	(14,628円)	(1万口当たり純資産額)	(15,812円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	4,600,000.00	4,588,320.32	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	1,110,000.00	1,120,904.86	

US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,000,000.00	999,687.50	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,000,000.00	2,011,171.80	
US TREASURY N/B-2.5%-21/01/31	2,600,000.00	2,626,355.42	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,900,000.00	1,947,165.98	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	1,800,000.00	1,807,523.28	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	950,000.00	957,959.95	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	2,450,000.00	2,503,880.64	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	1,000,000.00	990,917.97	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	300,000.00	303,000.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	300,000.00	297,187.50	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	2,420,000.00	2,439,331.44	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	700,000.00	706,138.65	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	1,670,000.00	1,882,011.67	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,500,000.00	1,510,927.65	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,050,000.00	2,067,376.82	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	2,700,000.00	2,707,646.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,350,000.00	2,357,618.93	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	500,000.00	503,261.70	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,550,000.00	2,551,045.75	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	1,000,000.00	1,007,597.60	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	1,700,000.00	1,712,683.53	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,100,000.00	1,112,267.53	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	1,600,000.00	1,606,312.48	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	700,000.00	708,476.51	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,400,000.00	2,389,968.74	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,050,000.00	2,058,207.99	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	600,000.00	594,550.78	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	580,000.00	678,452.68	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	1,000,000.00	1,031,875.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/08/31	300,000.00	312,404.28	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,440,000.00	1,502,578.08	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	2,080,000.00	2,175,793.56	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	1,300,000.00	1,326,863.20	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	2,200,000.00	2,282,456.88	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,000,000.00	1,015,917.90	

US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,230,000.00	4,371,440.62	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	2,300,000.00	2,366,079.92	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	850,000.00	864,775.38	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	1,000,000.00	1,017,734.30	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,400,000.00	2,388,375.00	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	887,730.85	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	4,300,000.00	4,384,404.27	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	700,000.00	725,798.78	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,130,000.00	2,830,570.20	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,200,000.00	3,321,874.88	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,400,000.00	1,525,206.90	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	270,854.87	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	1,600,000.00	1,714,468.64	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	544,031.24	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	527,779.66	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	230,602.33	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	476,874.02	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	136,712.89	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	315,144.91	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	450,078.12	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	275,156.24	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	253,351.56	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	405,371.08	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	400,000.00	463,234.36	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	700,000.00	762,070.26	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	500,000.00	578,701.15	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	750,000.00	834,008.77	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	890,000.00	1,114,203.46	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	255,367.18	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	550,000.00	690,024.39	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	144,998.43	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,150,000.00	1,308,641.58	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,400,000.00	2,499,796.80	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	513,114.25	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	780,951.15	

		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	228,386.70	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,450,000.00	1,509,840.77	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,350,000.00	2,328,335.93	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	335,718.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,550,000.00	1,695,161.06	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	900,000.00	984,814.38	
米ドル小計			101,060,000.00	105,707,627.00	(11,500,989,817)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	650,000.00	641,654.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,100,000.00	1,126,719.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	770,985.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	450,000.00	655,668.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	657,676.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	710,000.00	1,070,218.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	283,724.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	100,000.00	138,536.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	135,318.00	
加ドル小計			4,540,000.00	5,480,499.30	(456,251,566)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	6,000,000.00	5,988,396.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	4,991,124.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	5,722,831.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	6,698,331.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,660,577.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	5,125,410.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	2,000,000.00	2,120,957.60	
メキシコペソ小計			31,000,000.00	33,307,628.72	(190,186,559)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	200,000.00	218,912.12	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	350,000.00	389,546.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	420,000.00	463,687.56	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	350,000.00	400,612.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	150,000.00	163,360.50	

BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000.00	564,750.30	
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	300,000.00	333,588.90	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	253,266.34	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	447,373.42	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	550,000.00	968,347.60	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	220,000.00	385,882.64	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	80,000.00	115,892.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	620,000.00	653,511.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	650,000.00	708,118.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	500,000.00	571,153.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	600,000.00	728,942.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	500,000.00	547,620.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	600,000.00	763,963.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,100,000.00	1,538,545.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	500,000.00	553,823.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	650,000.00	938,575.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	930,000.00	1,425,788.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	780,000.00	1,225,166.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	400,000.00	698,422.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	150,000.00	286,670.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	400,000.00	567,141.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	100,000.00	165,481.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	550,000.00	571,354.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	250,000.00	266,585.25	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	300,000.00	317,942.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	300,000.00	319,092.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	500,000.00	536,613.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	500,000.00	539,205.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	200,000.00	220,593.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	570,000.00	737,370.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	500,000.00	549,527.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	250,000.00	269,924.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	500,000.00	530,171.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	500,000.00	547,334.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	650,000.00	695,255.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	400,000.00	423,564.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	560,000.00	846,723.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	200,000.00	292,486.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	350,000.00	592,722.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	470,000.00	785,115.73
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	260,000.00	447,896.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	250,000.00	465,298.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	190,000.00	380,736.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	150,000.00	261,277.35
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	300,000.00	481,047.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	450,000.00	738,128.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	200,000.00	210,715.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	200,000.00	211,941.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,580,000.00	1,688,296.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	800,000.00	895,565.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	750,000.00	867,468.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	850,000.00	979,582.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	600,000.00	702,736.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	581,109.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	700,000.00	827,362.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	200,000.00	232,427.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	450,000.00	558,905.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	500,000.00	558,517.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	950,000.00	1,184,544.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	500,000.00	726,344.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	200,000.00	219,932.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	400,000.00	578,375.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	550,000.00	734,666.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	750,000.00	1,054,536.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	650,000.00	991,034.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	383,752.50	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	250,000.00	367,224.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	560,000.00	758,441.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	600,000.00	925,786.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	500,000.00	772,271.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	150,000.00	232,434.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	500,000.00	636,356.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	250,000.00	285,209.10	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	107,286.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	251,369.20	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	300,000.00	378,430.20	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	152,065.70	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	430,000.00	443,379.88	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	530,000.00	564,916.93	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	500,000.00	539,088.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	350,000.00	382,076.80	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	1,500,000.00	1,630,290.00	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	200,000.00	264,403.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	850,000.00	922,189.65	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	750,000.00	896,433.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	650,000.00	733,341.05	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	750,000.00	835,406.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	421,200.00	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	950,000.00	1,318,756.18	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	600,000.00	651,324.18	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	502,110.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	350,000.00	435,855.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	800,000.00	866,904.72	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	755,495.76	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	150,000.00	190,853.71	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	600,000.00	1,043,338.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	730,000.00	1,236,538.24	

		FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	300,000.00	346,174.50	
		FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,010,000.00	1,689,397.91	
		FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	250,000.00	458,828.00	
		FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	600,000.00	981,261.60	
		FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	320,000.00	638,641.92	
		FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	350,000.00	731,215.10	
		IRISH TREASURY -3.9%-23/03/20	200,000.00	229,903.10	
		IRISH TREASURY -5.4%-25/03/13	300,000.00	392,110.65	
		IRISH TREASURY -1.0%-26/05/15	500,000.00	539,410.25	
		IRISH TREASURY -2.4%-30/05/15	100,000.00	124,102.70	
		IRISH TREASURY -2.0%-45/02/18	200,000.00	259,236.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -3.25%-21/07/15	300,000.00	320,207.46	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -3.75%-23/01/15	270,000.00	308,858.53	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -1.75%-23/07/15	150,000.00	163,442.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -2.0%-24/07/15	300,000.00	336,629.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -0.25%-25/07/15	150,000.00	156,423.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -0.5%-26/07/15	200,000.00	212,726.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -5.5%-28/01/15	620,000.00	922,415.54	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -4.0%-37/01/15	350,000.00	591,052.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -3.75%-42/01/15	150,000.00	271,183.78	
		NETHERLANDS GOVERNMENT -2.75%-47/01/15	200,000.00	338,398.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -3.5%-21/09/15	100,000.00	107,797.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -1.75%-23/10/20	350,000.00	382,354.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -1.65%-24/10/21	350,000.00	387,181.55	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -4.85%-26/03/15	550,000.00	735,661.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -6.25%-27/07/15	200,000.00	301,947.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -4.15%-37/03/15	350,000.00	587,314.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -3.15%-44/06/20	250,000.00	414,908.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA -3.8%-62/01/26	80,000.00	175,201.80	
			57,110,000.00	74,686,688.97	
				(9,003,480,355)	
ユーロ小計					
英ポンド	国債証券	UK TREASURY -8.0%-21/06/07	570,000.00	638,458.14	
		UK TREASURY -3.75%-21/09/07	150,000.00	159,016.80	
		UK TREASURY -1.75%-22/09/07	600,000.00	622,289.04	
		UK TREASURY -2.75%-24/09/07	800,000.00	888,630.40	

		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	200,000.00	211,402.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	194,892.60	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	270,000.00	400,599.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	350,000.00	502,733.00	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	396,620.00	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	400,000.00	601,110.40	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	260,000.00	389,242.36	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	279,915.20	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	300,000.00	478,630.80	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	270,000.00	456,234.12	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	500,000.00	722,640.00	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	600,000.00	1,033,440.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	1,088,744.38	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	785,243.68	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	579,155.13	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	300,000.00	327,620.40	
英債券小計			7,430,000.00	10,756,617.45	(1,501,085,965)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	2,100,000.00	2,225,056.26	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	1,950,000.00	2,149,192.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	2,500,000.00	2,690,676.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	1,850,000.00	2,140,134.76	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,629,210.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	1,115,604.00	
スウェーデンクローナ小計			10,600,000.00	11,949,874.02	(134,197,085)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	1,400,000.00	1,455,490.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,437,345.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	483,772.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	1,025,214.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	1,014,200.00	
ノルウェークローネ小計			5,250,000.00	5,416,021.90	(64,071,539)
デンマーク クロー	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	2,450,000.00	2,640,120.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	571,808.20	

ネ		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	4,475,643.60	
デンマーククローネ小計			5,250,000.00	7,687,571.80	(124,077,408)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,000,000.00	1,040,612.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,118,505.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	800,000.00	862,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	800,000.00	831,360.00	
ポーランドズロチ小計			3,600,000.00	3,853,277.00	(108,623,878)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000.00	1,044,379.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	500,000.00	567,551.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	349,163.61	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	900,000.00	979,029.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	200,000.00	225,970.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	180,000.00	218,004.46	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	800,000.00	1,018,699.92	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	650,000.00	778,572.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	753,048.17	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	584,557.74	
豪ドル小計			5,500,000.00	6,518,977.99	(483,773,356)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	101,060.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	208,220.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	450,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	171,600.00	
シンガポールドル小計			850,000.00	931,480.00	(74,350,733)
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	1,000,000.00	1,017,293.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,439,550.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	564,956.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,000,000.00	1,017,600.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	605,356.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,377,228.72	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	600,000.00	624,383.94	
			7,350,000.00	7,646,368.62	

マレーシアリングット小計				(198,805,584)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	6,000,000.00	6,751,842.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,000,000.00	1,886,844.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,100,000.00	1,545,507.07	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,000,000.00	1,819,336.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	6,550,000.00	5,908,414.07	
南アフリカランド小計			18,650,000.00	17,911,943.74 (133,264,861)	
合計				23,973,158,706 (23,973,158,706)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 78銘柄	100.0%	47.8%
加ドル	国債証券 9銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 131銘柄	100.0%	37.6%
英ポンド	国債証券 20銘柄	100.0%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
マレーシアリングット	国債証券 7銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 5銘柄	100.0%	0.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年10月31日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)】

【純資産額計算書】

資産総額	388,947,003円
負債総額	60,867,531円
純資産総額(-)	328,079,472円
発行済口数	211,886,883口
1口当たり純資産額(/)	1.5484円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	33,977,870,298円
負債総額	695,330,626円
純資産総額(-)	33,282,539,672円
発行済口数	21,537,032,789口
1口当たり純資産額(/)	1.5454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	193,749,818,115円
負債総額	3,771,050,540円
純資産総額(-)	189,978,767,575円
発行済口数	71,712,471,830口
1口当たり純資産額(/)	2.6492円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	8,978,647,221円
負債総額	172,106,682円
純資産総額（ - ）	8,806,540,539円
発行済口数	4,952,858,106口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7781円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	41,951,163,952円
負債総額	288,715,203円
純資産総額（ - ）	41,662,448,749円
発行済口数	29,059,361,204口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4337円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	155,732,957,467円
負債総額	192,237,887円
純資産総額（ - ）	155,540,719,580円
発行済口数	66,135,211,957口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3519円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	24,696,988,170円
負債総額	567,472,470円
純資産総額（ - ）	24,129,515,700円
発行済口数	15,275,092,927口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5797円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2019年10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10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10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10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	831	196,697
株式投資信託	784	169,352
単位型	254	9,002
追加型	530	160,350
公社債投資信託	47	27,344
単位型	33	879
追加型	14	26,464

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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間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	1,120	1	1,865
有価証券償還益		1		1
デリバティブ収益		-	1	142
時効成立分配金・償還金		1		21
為替差益		79		58
その他		41		48
営業外収益合計		1,272		2,176
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

(3) 【株主資本等変動計算書】

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	5,943	5,943	113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756

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

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						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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"> <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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>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 of 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	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
<p>(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)</p> <p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。</p> <p>この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」1,014百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,504百万円に含めて表示しております。</p>	

(貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1,260百万円	1,281百万円
	建物	612百万円	655百万円
	器具備品		

<p>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。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 3,189百万円 未収収益 592百万円 その他 345百万円 (流動負債) 預り金 419百万円 未払手数料 376百万円 未払費用 677百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 1,347百万円 未収収益 127百万円 (流動負債) 未払手数料 350百万円 未払費用 767百万円 その他 162百万円</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

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

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

- (注) 1 2016年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
 3 2009年度ストックオプション(1)1,494,900株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)及び2016年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-

2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

- (注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
 3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 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せぬ。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ぬ。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、次表には含められておりませぬ。

(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 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額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 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900

貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

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

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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日

権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

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

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

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円
営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

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、記載していません。

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、記載していません。

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、記載を省略していません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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、記載していません。

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、記載を省略していません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		23,147
有価証券		10
未収委託者報酬		13,391
未収収益		845
関係会社短期貸付金		2,358
その他	2	2,563
流動資産合計		42,316
固定資産		
有形固定資産	1	268
無形固定資産		83
投資その他の資産		
投資有価証券		17,535
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		498
繰延税金資産		1,879
投資その他の資産合計		45,684
固定資産合計		46,036
資産合計		88,353

(単位:百万円)

		第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,950
未払費用		3,948
未払法人税等		1,788
未払消費税等	3	415
賞与引当金		1,432
役員賞与引当金		27
その他		559
流動負債合計		14,122

固定負債		
退職給付引当金		1,433
その他		494
固定負債合計		1,927
負債合計		16,050
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		49,870
利益剰余金合計		49,870
自己株式		905
株主資本合計		71,547
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		356
繰延ヘッジ損益		398
評価・換算差額等合計		755
純資産合計		72,302
負債純資産合計		88,353

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		37,324
その他営業収益		1,394
営業収益合計		38,718
営業費用及び一般管理費	1	33,922
営業利益		4,796
営業外収益	2	2,859
営業外費用	3	124
経常利益		7,530
特別利益	4	126
特別損失	5	4
税引前中間純利益		7,651
法人税等	6	1,711
中間純利益		5,940

(3) 中間株主資本等変動計算書

第61期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	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	47,142	47,142	833	68,891
当中間期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
中間純利益				5,940	5,940		5,940
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,727	2,727	71	2,655
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	49,870	49,870	905	71,547

	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	493	185	679	69,571
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,212
中間純利益				5,940
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	136	212	75	75
当中間期変動額合計	136	212	75	2,731
当中間期末残高	356	398	755	72,302

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 中間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>2 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、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>
<p>3 引当金の計上基準</p>	<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中間会計期間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中間会計期間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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>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中間会計期間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。</p> <p>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>
<p>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 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、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第61期中間会計期間 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,977百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 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。
4 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396百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	40百万円
無形固定資産	18百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	51百万円
受取配当金	2,711百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	91百万円
デリバティブ費用	2百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	126百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	4百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

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)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	442,200	1,613,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	1,533,000	2,085,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,018,000	2,793,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,018,000	3,338,000	-
合計		15,088,300	-	5,258,600	9,829,700	-

(注) 1 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)、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)、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)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、2016年度ストックオプション(1)1,251,000株及び2016年度ストックオプション(2)937,000株は、当中間会計期間末現在、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)834,000株、2016年度ストックオプション(2)1,856,000株及び2017年度ストックオプション(1)3,338,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	
1年内	898百万円
1年超	6,604百万円
合計	7,503百万円

(金融商品関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、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)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	23,147	23,147	-
(2) 未収委託者報酬	13,391	13,391	-
(3) 未収収益	845	845	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,358	2,358	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	17,529	17,529	-
(6) 未払金	(5,950)	(5,950)	-
(7) 未払費用	(3,948)	(3,948)	-
(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	(64)	(64)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	75	75	-
デリバティブ取引計	11	11	-

(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は、貸借対照表上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86百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、10百万円は、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額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(中間貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額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。

(有価証券関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
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	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	投資信託	12,130	11,325	805
	小計	12,130	11,325	805
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	投資信託	5,399	5,690	291
	小計	5,399	5,690	291
合計		17,529	17,015	513

- (注) 1 減損処理にあたっては、中間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。当中間会計期間については、該当ございません。
- 2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額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。

(デリバティブ取引関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30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	2,129	-	47	47
合計		2,129	-	47	47

(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	1,760	-	17	17
合計		1,760	-	17	17

(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

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	投資有価証券			
	米ドル		2,261	-	10
	豪ドル		71	-	2
	シンガポールドル		913	-	11

	ユーロ		72	-	2
	香港ドル		425	-	1
	人民元		2,091	-	68
合計			5,834	-	75

(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61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,004百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,509百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,047百万円

(ストックオプション等関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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場合、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場合、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61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1株当たり純資産額	369円72銭
1株当たり中間純利益金額	30円36銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等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株当たり中間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61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益(百万円)	5,940
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,940
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,640
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、 2016年度ストックオプション(1)2,085,000株、 2016年度ストックオプション(2)2,793,000株、 2017年度ストックオプション(1)3,338,000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61期中間会計期間 (2019年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	72,302
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	72,302
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,558

(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
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	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。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社きらやか銀行	22,700百万円	
株式会社第三銀行 1	37,461百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社琉球銀行 1	56,967百万円	

ソニー生命保険株式会社 1	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【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 1月25日	有価証券届出書
2019年 1月25日	有価証券報告書
2019年 7月26日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 7月26日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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12月4日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 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」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2018年10月27日から2019年10月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2019年10月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月5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 貞 廣 篤 典
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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を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、中間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 データは中間監査の対象には含まれていません。