

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月6日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCインデックスバランス（株式40）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

DCインデックスバランス（株式40）（以下「ファンド」といいます。）

当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

2020年2月7日から2021年2月5日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 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。

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり
一般	年6回			()
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・	なし
	その他		ファンズ	
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)))	()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
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。

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 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。

<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。

- ※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	10%
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	10%
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に調整を行ないます。

○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。

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。

購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。



主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の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なわないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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。

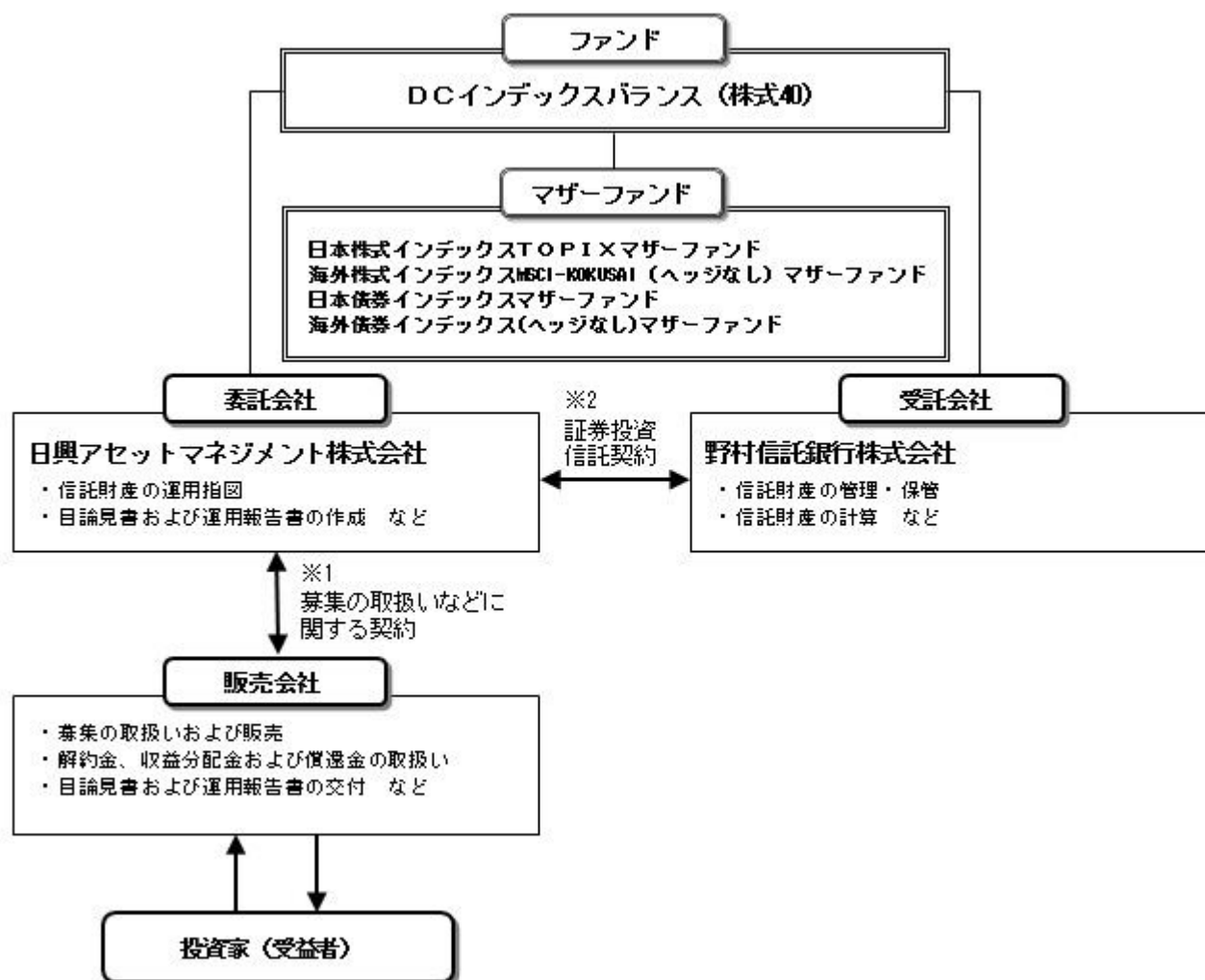
(2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。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です。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11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「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」
- ・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】

< DCインデックスバランス（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「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」
- 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。）

- 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「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証書
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 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。）
- 10) 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。）
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 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
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)～12)の証券または証書の性質を有するもの

- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
 - 15) 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16)に定めるもの以外のもの
 - 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TOPIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))には投資しません。
 - 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券

- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
 - 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
- < 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す。)
- 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す。)
- 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

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、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。 ・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（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。

< 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 >

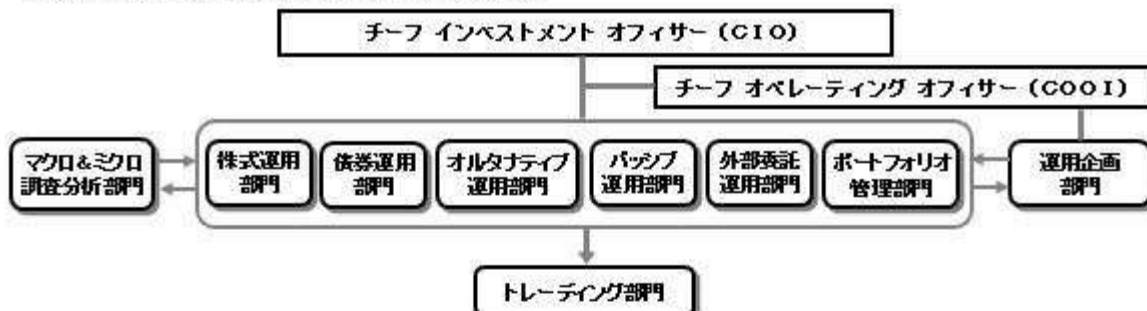
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

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）

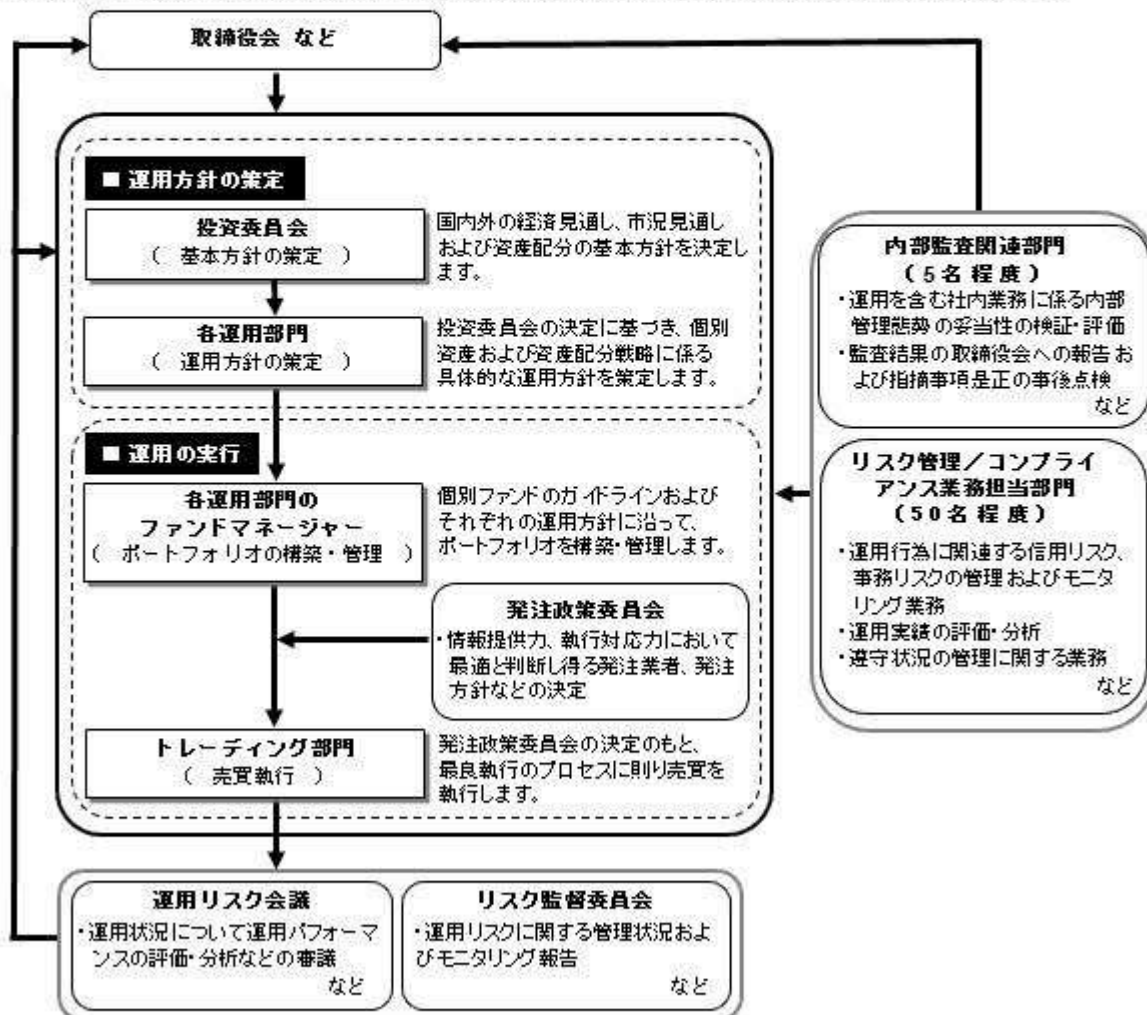
* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は2019年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

を行いません。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は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

<DCインデックスバランス（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) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
- 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。
- 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（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。

- 15) 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。
 - 16) 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。
 - 17) 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。

<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、当該取引の契約期間が、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。

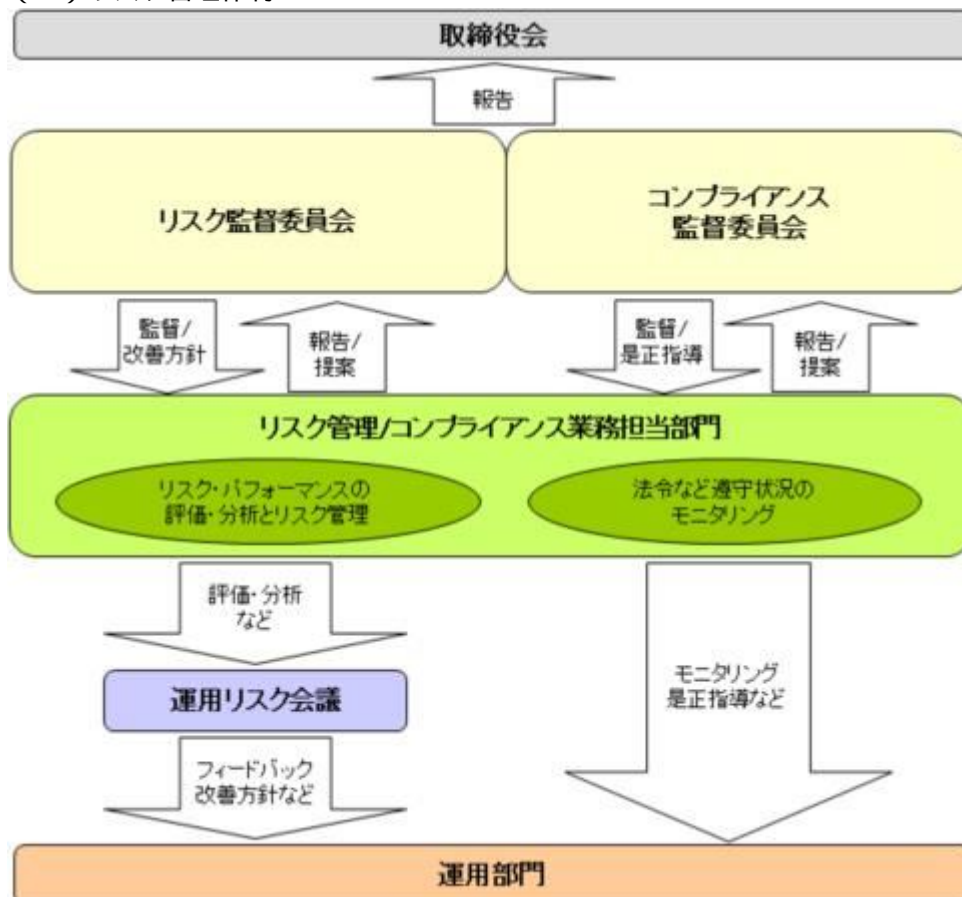
< その他の留意事項 >

- ・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・設定などに伴う資金流入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（２）リスク管理体制



全社的リスク管理

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。

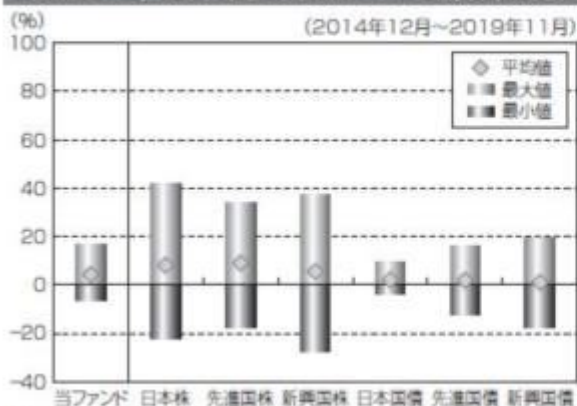
法令など遵守状況のモニタリング

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11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	4.2%	-8.1%	8.0%	5.5%	2.1%	1.8%	1.0%
最大値	16.9%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	16.4%	19.3%
最小値	-6.3%	-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12月から2019年11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)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮し

たものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、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・ディバーシファイド（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】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%（税抜0.14%）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
0.14%	0.04%	0.08%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬(信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。)は、日々計上され、毎計算期間の最初の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。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されません。

確定拠出年金でない場合

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。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。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

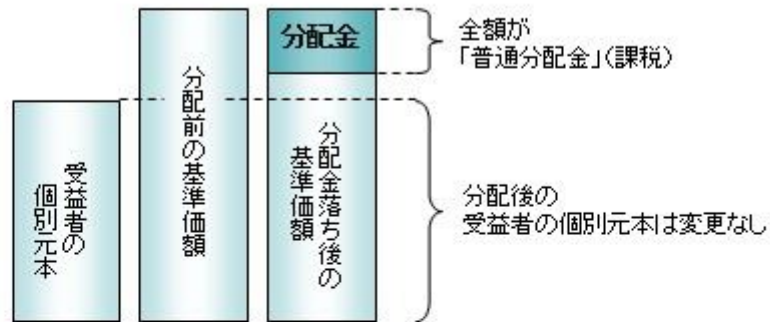
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

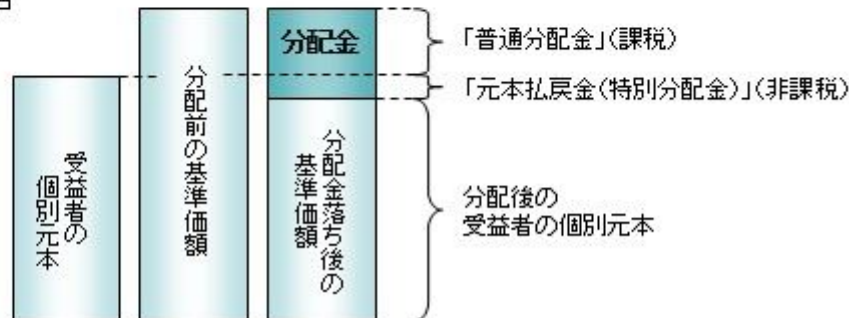
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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2月6日現在のものですので、税法または確定拠出年金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】

【DCインデックスバランス(株式40)】

以下の運用状況は2019年11月29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	7,377,863,946	95.02
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		386,357,203	4.98
合計(純資産総額)		7,764,221,149	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	2,431,466,233	1.4280	3,472,199,039	1.4289	3,474,322,100	44.75
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	1,481,151,300	1.5708	2,326,592,463	1.5755	2,333,553,873	30.06
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	288,569,830	2.6767	772,414,864	2.7480	792,989,892	10.21
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	330,187,864	2.3408	772,935,839	2.3532	776,998,081	10.01

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.02
合計	95.02

【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8計算期間末 (2010年11月 8日)	1,338	1,339	1.1621	1.1631
第9計算期間末 (2011年11月 7日)	1,435	1,436	1.1334	1.1344
第10計算期間末 (2012年11月 6日)	1,609	1,610	1.1729	1.1739
第11計算期間末 (2013年11月 6日)	2,074	2,076	1.4699	1.4709
第12計算期間末 (2014年11月 6日)	2,656	2,657	1.6212	1.6222
第13計算期間末 (2015年11月 6日)	3,050	3,052	1.7361	1.7371
第14計算期間末 (2016年11月 7日)	3,190	3,192	1.6726	1.6736
第15計算期間末 (2017年11月 6日)	4,337	4,339	1.9017	1.9027
第16計算期間末 (2018年11月 6日)	5,809	5,812	1.8653	1.8663
第17計算期間末 (2019年11月 6日)	7,594	7,597	1.9472	1.9482
2018年11月末日	5,996		1.8733	
12月末日	5,846		1.8015	
2019年 1月末日	6,137		1.8416	
2月末日	6,341		1.8712	
3月末日	6,486		1.8813	
4月末日	6,619		1.8956	

5月末日	6,646		1.8497
6月末日	6,866		1.8783
7月末日	7,029		1.8900
8月末日	7,091		1.8746
9月末日	7,308		1.9067
10月末日	7,555		1.9409
11月末日	7,764		1.9555

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.95
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	2.38
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	3.57
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	25.41
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	10.36
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	7.15
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	3.60
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	13.76
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1.86
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	4.44

(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8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	206,736,758	99,558,607
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	199,510,879	84,921,462
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	232,315,742	126,886,432
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	252,340,970	212,819,956
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	402,200,788	175,054,267
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	312,108,595	193,535,396
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	311,896,821	161,785,450
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	655,234,781	281,609,222
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1,071,592,550	237,755,651
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	1,153,119,415	367,851,990

（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11月29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	32,818,292,270	98.72
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		426,091,800	1.28
合計（純資産総額）		33,244,384,070	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	441,220,000	1.33

（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	152,500	7,483.84	1,141,285,600	7,638.00	1,164,795,000	3.50
日本	株式	ソニー	電気機器	86,500	6,370.00	551,005,000	6,904.00	597,196,000	1.80
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	929,000	566.50	526,278,500	578.10	537,054,900	1.62

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	113,800	3,824.00	435,171,200	4,455.00	506,979,000	1.53
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	89,700	5,298.00	475,230,600	5,527.00	495,771,900	1.49
日本	株式	キーエンス	電気機器	12,400	33,605.00	416,702,000	37,440.00	464,256,000	1.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	106,500	3,996.53	425,630,445	4,253.00	452,944,500	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	93,300	3,850.00	359,205,000	3,989.00	372,173,700	1.12
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	93,700	3,535.60	331,285,720	3,962.00	371,239,400	1.12
日本	株式	任天堂	その他製品	8,400	37,140.46	311,979,864	42,350.00	355,740,000	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	107,700	2,950.00	317,715,000	3,067.00	330,315,900	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	100,100	2,936.50	293,943,650	3,139.00	314,213,900	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,834,000	167.33	306,883,220	169.20	310,312,800	0.93
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	99,200	2,846.70	282,392,640	3,003.00	297,897,600	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,300	5,588.46	269,922,618	5,952.00	287,481,600	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	65,700	4,200.77	275,990,589	4,300.00	282,510,000	0.85
日本	株式	花王	化学	32,800	8,342.91	273,647,448	8,612.00	282,473,600	0.85
日本	株式	HOYA	精密機器	27,500	9,139.34	251,331,850	9,990.00	274,725,000	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,400	15,230.00	265,002,000	15,745.00	273,963,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	13,000	21,638.56	281,301,280	20,905.00	271,765,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,600	2,735.67	258,794,382	2,866.00	271,123,600	0.82
日本	株式	信越化学工業	化学	23,000	11,859.19	272,761,370	11,710.00	269,330,000	0.81
日本	株式	第一三共	医薬品	39,200	6,901.49	270,538,408	6,862.00	268,990,400	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	16,500	15,960.42	263,346,930	16,190.00	267,135,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	40,200	5,908.00	237,501,600	6,344.00	255,028,800	0.77
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,400	22,735.00	259,179,000	22,095.00	251,883,000	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,100	9,992.32	240,814,912	10,070.00	242,687,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	118,500	1,819.35	215,592,975	1,939.50	229,830,750	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	120,400	1,771.32	213,266,928	1,867.50	224,847,000	0.68
日本	株式	キヤノン	電気機器	73,700	2,935.01	216,310,237	3,030.00	223,311,000	0.67

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.74
		食料品	3.86
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.05
		医薬品	5.94
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.84

鉄鋼	0.76
非鉄金属	0.75
金属製品	0.58
機械	5.05
電気機器	14.04
輸送用機器	7.73
精密機器	2.32
その他製品	2.30
電気・ガス業	1.52
陸運業	4.50
海運業	0.17
空運業	0.51
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.44
卸売業	4.90
小売業	4.61
銀行業	5.79
証券、商品先物取引業	0.83
保険業	2.26
その他金融業	1.16
不動産業	2.38
サービス業	5.07
合計	98.72

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	26	日本円	434,077,150	441,220,000	1.33

(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11月29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	133,619,373,275	63.29
	カナダ	7,784,820,531	3.69
	ドイツ	6,571,817,878	3.11
	イタリア	1,439,780,958	0.68
	フランス	7,677,684,341	3.64
	オランダ	3,820,573,915	1.81
	スペイン	2,105,798,565	1.00
	ベルギー	749,401,962	0.35
	オーストリア	164,493,308	0.08
	ルクセンブルク	203,702,797	0.10
	フィンランド	807,981,801	0.38
	アイルランド	3,963,702,674	1.88
	ポルトガル	111,546,774	0.05
	イギリス	11,825,732,702	5.60
	スイス	7,680,593,584	3.64
	スウェーデン	1,829,563,015	0.87
	ノルウェー	465,076,496	0.22
	デンマーク	1,361,521,588	0.64
	ケイマン	477,652,041	0.23
	オーストラリア	4,745,969,284	2.25
	バミューダ	419,047,153	0.20
	ニュージーランド	190,616,047	0.09
	香港	2,001,403,990	0.95
	シンガポール	900,673,154	0.43
	イスラエル	437,681,978	0.21
	ジャージー	570,265,321	0.27
	英ヴァージン諸島	24,199,065	0.01
	アラブ首長国連邦	13,305,070	0.01
	マン島	32,698,909	0.02
	小計	201,996,678,176	95.68
投資証券	アメリカ	4,745,333,092	2.25
	カナダ	29,095,557	0.01
	フランス	239,347,990	0.11
	イギリス	131,772,999	0.06
	オーストラリア	419,836,395	0.20
	香港	106,029,000	0.05
	シンガポール	92,944,640	0.04
小計	5,764,359,673	2.73	
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,345,267,192	1.58
合計（純資産総額）		211,106,305,041	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	2,677,860,042	1.27
	買建	ドイツ	627,471,976	0.30

(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		2,756,221,500	1.31

(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	214,672	27,090.13	5,815,492,683	29,344.55	6,299,453,323	2.98
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	343,994	15,476.61	5,323,863,378	16,688.17	5,740,633,516	2.72
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	19,945	193,083.36	3,851,047,649	199,235.95	3,973,761,134	1.88
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	114,280	20,655.62	2,360,524,723	22,131.12	2,529,144,394	1.20
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	151,210	13,827.93	2,090,922,242	14,468.49	2,187,780,917	1.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,902	138,897.10	2,069,844,609	143,851.18	2,143,670,350	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,160	138,783.83	1,965,179,047	143,756.96	2,035,598,593	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	125,301	14,108.86	1,767,854,564	15,091.89	1,891,028,909	0.90
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	81,922	19,498.93	1,597,391,738	20,199.57	1,654,789,763	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	143,093	11,478.37	1,642,474,669	11,439.62	1,636,930,117	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	118,729	13,487.46	1,601,353,761	13,340.02	1,583,847,899	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	420,859	3,480.98	1,465,005,642	3,661.49	1,540,973,208	0.73
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	201,291	7,588.96	1,527,590,524	7,526.77	1,515,071,463	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	62,500	23,262.51	1,453,907,314	24,157.98	1,509,873,750	0.72
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	347,337	4,056.98	1,409,141,516	4,126.02	1,433,122,743	0.68
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	85,592	14,440.82	1,236,018,938	16,596.14	1,420,497,568	0.67
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	45,130	27,029.48	1,219,840,465	30,750.20	1,387,756,761	0.66

アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	42,900	29,690.06	1,273,703,805	31,958.65	1,371,026,171	0.65
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	208,792	6,193.66	1,293,186,773	6,410.35	1,338,430,966	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	196,567	6,608.96	1,299,103,797	6,584.55	1,294,306,419	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	52,030	25,637.99	1,333,944,838	24,431.87	1,271,190,716	0.60
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	198,860	5,660.35	1,125,618,538	5,953.49	1,183,911,101	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	90,281	13,005.26	1,174,128,750	12,935.74	1,167,852,374	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	121,663	9,037.49	1,099,528,433	9,598.55	1,167,788,583	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	192,972	5,884.63	1,135,569,801	5,910.76	1,140,611,565	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	33,198	32,356.33	1,074,165,608	33,891.12	1,125,117,402	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	262,860	4,038.16	1,061,471,793	4,232.30	1,112,503,114	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	215,424	4,989.56	1,074,872,047	4,866.65	1,048,394,330	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	101,823	9,549.15	972,323,416	10,127.85	1,031,248,193	0.49
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	25,382	37,428.88	950,019,944	40,318.08	1,023,353,507	0.48

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	5.12
		素材	4.21
		資本財	7.03
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	1.09
		耐久消費財・アパレル	1.89
		消費者サービス	1.76
		メディア・娯楽	6.00
		小売	4.68
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.71
		家庭用品・パーソナル用品	2.04
		ヘルスケア機器・サービス	4.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.05
		銀行	7.68
各種金融	4.36		

		保険	3.79
		不動産	0.48
		ソフトウェア・サービス	9.63
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.53
		電気通信サービス	2.35
		公益事業	3.48
		半導体・半導体製造装置	3.21
	投資証券		2.73
	合計		98.42

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	155	米ドル	24,153,125	2,646,216,375	24,441,950	2,677,860,042	1.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1912	買建	155	ユーロ	5,157,100	621,894,688	5,203,350	627,471,976	0.30

(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	20,800,000.00	2,258,069,420	2,273,910,000	1.08
	ユーロ	買建	4,000,000.00	481,606,050	482,311,500	0.23

(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11月29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	32,305,158,930	76.37
地方債証券	日本	3,166,066,000	7.49
特殊債券	日本	3,946,421,000	9.33
社債券	日本	2,754,425,000	6.51
	オーストラリア	100,118,000	0.24

	小計	2,854,543,000	6.75
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		26,507,182	0.06
合計（純資産総額）		42,298,696,112	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	103.06	721,427,000	0.300	2025/12/20	1.71
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	102.61	625,975,900	102.14	623,084,500	0.100	2026/12/20	1.47
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	508,000,000	121.91	619,343,440	121.29	616,173,520	1.700	2032/9/20	1.46
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	100.17	560,967,796	100.17	560,967,796	0.100	2020/6/20	1.33
日本	国債証券	第144回利付国債（20年）	430,000,000	119.76	514,976,600	119.23	512,689,000	1.500	2033/3/20	1.21
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	490,000,000	103.74	508,330,900	103.34	506,375,800	0.500	2024/9/20	1.20
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	490,000,000	102.86	504,043,400	102.28	501,201,400	0.100	2027/12/20	1.18
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	490,000,000	102.75	503,475,000	102.22	500,882,900	0.100	2027/3/20	1.18
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	480,000,000	102.82	493,545,600	102.27	490,900,800	0.100	2028/3/20	1.16
日本	特殊債券	第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	119.66	478,660,000	120.01	480,072,000	2.200	2028/11/28	1.13
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	435,000,000	102.77	447,062,550	102.20	444,604,800	0.100	2028/6/20	1.05
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	420,000,000	103.95	436,590,000	103.52	434,784,000	0.400	2025/9/20	1.03
日本	国債証券	第145回利付国債（20年）	355,000,000	122.68	435,538,850	122.20	433,820,650	1.700	2033/6/20	1.03
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	390,000,000	103.60	404,067,300	103.21	402,522,900	0.400	2025/3/20	0.95
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	390,000,000	102.71	400,592,400	102.13	398,338,200	0.100	2028/9/20	0.94
日本	国債証券	第29回利付国債（30年）	276,000,000	140.30	387,244,560	139.98	386,366,880	2.400	2038/9/20	0.91
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	370,000,000	103.77	383,978,600	103.36	382,454,200	0.400	2025/6/20	0.90
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	370,000,000	102.10	377,781,100	101.89	377,011,500	1.300	2021/3/20	0.89
日本	国債証券	第117回利付国債（20年）	293,000,000	123.09	360,668,350	122.37	358,564,610	2.100	2030/3/20	0.85
日本	国債証券	第113回利付国債（20年）	290,000,000	122.28	354,632,300	121.53	352,442,800	2.100	2029/9/20	0.83
日本	国債証券	第88回利付国債（20年）	300,000,000	117.18	351,543,000	116.50	349,527,000	2.300	2026/6/20	0.83
日本	国債証券	第130回利付国債（20年）	270,000,000	121.66	328,490,900	121.31	327,539,700	1.800	2031/9/20	0.77

日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.30	326,005,320	100.30	326,005,320	0.100	2020/9/20	0.77
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	105.19	310,316,400	104.89	309,431,400	1.400	2022/12/20	0.73
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	105.32	300,164,850	105.20	299,825,700	0.500	2038/3/20	0.71
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	117.88	294,712,500	117.11	292,782,500	2.300	2026/9/20	0.69
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	139.87	279,750,000	139.85	279,704,000	2.200	2041/3/20	0.66
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	133.38	277,434,560	132.97	276,596,320	2.400	2034/3/20	0.65
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	120.29	276,669,500	119.77	275,484,800	1.600	2032/6/20	0.65
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	205,000,000	132.57	271,786,950	132.61	271,862,800	1.700	2044/6/20	0.64

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.37
地方債証券	7.49
特殊債券	9.33
社債券	6.75
合計	99.94

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11月29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	75,183,717,820	48.22
	カナダ	2,915,596,087	1.87
	メキシコ	1,281,588,541	0.82
	ドイツ	9,609,094,914	6.16
	イタリア	13,605,123,724	8.73
	フランス	15,137,288,703	9.71
	オランダ	2,832,241,631	1.82

	スペイン	8,660,223,682	5.55
	ベルギー	3,624,539,688	2.32
	オーストリア	2,115,224,660	1.36
	フィンランド	841,464,474	0.54
	アイルランド	1,077,077,278	0.69
	イギリス	9,842,902,734	6.31
	スウェーデン	521,611,664	0.33
	ノルウェー	357,117,134	0.23
	デンマーク	788,879,668	0.51
	ポーランド	881,036,359	0.57
	オーストラリア	3,099,598,997	1.99
	シンガポール	634,529,952	0.41
	マレーシア	699,022,571	0.45
	南アフリカ	866,847,016	0.56
	小計	154,574,727,297	99.14
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,337,252,166	0.86
合計（純資産総額）		155,911,979,463	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		78,076,500	0.05
	売建		45,211,930	0.03

(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	11,043.51	1,309,761,320	11,038.81	1,309,202,976	2.125	2021/8/15	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	10,805.14	1,188,565,513	10,813.05	1,189,436,422	1.250	2023/7/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,346.89	1,142,088,079	12,286.76	1,136,526,072	8.000	2021/11/15	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	11,028.53	1,069,768,348	11,029.39	1,069,851,454	1.875	2022/7/31	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,840,000	10,923.26	965,616,219	10,924.33	965,710,803	1.500	2022/1/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,650,000	10,999.86	841,489,804	11,004.35	841,833,523	1.750	2023/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	11,179.61	838,470,979	11,163.13	837,235,225	2.750	2021/9/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	13,715.96	702,257,653	13,894.43	711,394,978	3.625	2043/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	11,373.26	693,769,416	11,378.40	694,082,656	2.250	2027/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,309.28	671,771,659	11,300.72	671,263,264	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,038.17	667,809,285	11,033.24	667,511,471	2.125	2021/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,366.63	659,264,845	11,361.92	658,991,793	2.500	2024/5/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,223.00	647,819,060	12,422.22	658,377,695	2.875	2045/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,341.81	657,825,174	11,335.82	657,477,648	2.500	2024/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	13,989.01	629,505,635	14,171.75	637,729,061	3.750	2043/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	12,183.20	615,251,609	12,351.81	623,766,889	2.875	2043/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,907.42	621,723,257	10,906.56	621,674,466	1.625	2026/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	10,924.24	616,127,146	10,902.71	614,913,290	1.625	2026/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,450,000	11,270.77	614,256,980	11,272.05	614,326,960	2.250	2024/11/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,745,000	22,132.02	607,524,152	22,012.49	604,243,087	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,305.22	599,176,793	11,301.37	598,972,630	2.500	2023/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	10,847.72	596,625,076	10,856.71	597,119,384	1.375	2023/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,766.14	588,307,236	11,754.37	587,718,734	3.000	2025/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,088.66	587,699,483	11,087.60	587,642,810	2.000	2023/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,065.56	586,474,680	11,059.13	586,134,409	2.250	2021/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	11,150.29	582,045,502	11,146.23	581,833,269	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	11,369.41	578,703,324	11,371.55	578,812,235	2.250	2027/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,250,000	10,957.06	575,246,139	10,959.85	575,392,179	1.625	2022/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,935.83	572,920,005	11,947.81	573,495,221	2.875	2028/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	14,413.44	566,448,482	14,345.68	563,785,533	4.250	2023/10/25	0.36

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.14
合計	99.14

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	300,000.00	32,817,000	32,859,000	0.02
	ユーロ	買建	375,000.00	45,154,140	45,217,500	0.03
	米ドル	売建	412,781.25	45,154,140	45,211,930	0.03

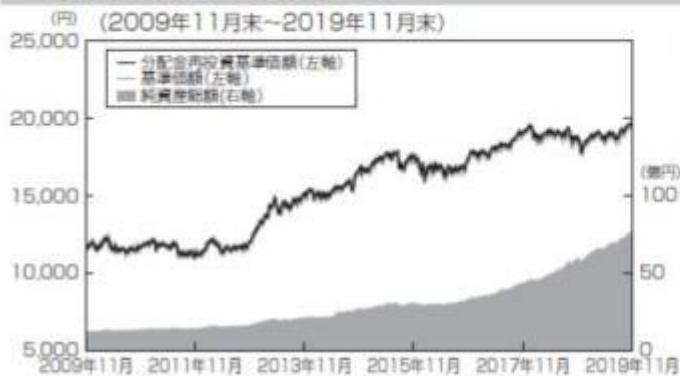
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2019年11月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………19,555円

純資産総額……………77.64億円

※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11月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年11月	2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	140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	30.06%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.21%
日本債券インデックスマザーファンド	44.75%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.01%
現金その他	4.98%

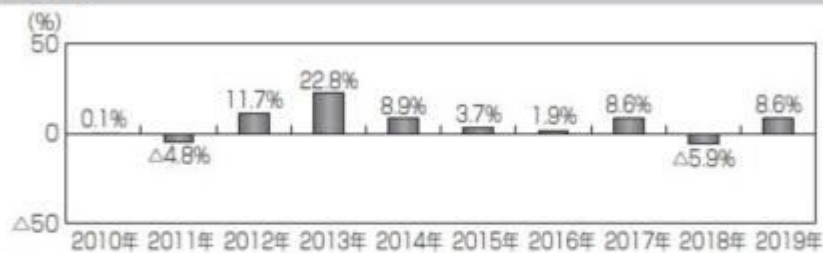
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	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	3.50%	
	2 ソニー	電気機器	1.80%	
	3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.62%	
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	2.98%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.72%	
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.88%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
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	2025/12/20	1.71%
	2 第345回利付国債(10年)	国債証券	2026/12/20	1.47%
	3 第140回利付国債(20年)	国債証券	2032/9/20	1.46%
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	2021/8/15	0.84%
	2 US TREASURY N/B (クーポン1.250%)	国債証券	2023/7/31	0.76%
	3 US TREASURY N/B (クーポン8.000%)	国債証券	2021/11/15	0.73%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
 ※当ファンドには、ベンチマークはありません。
 ※2019年は、2019年11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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

(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です。

(5) 申込単位

1円以上1円単位

(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。

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基づき、運用上の支障をきたさないようするため、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、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(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。

(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。

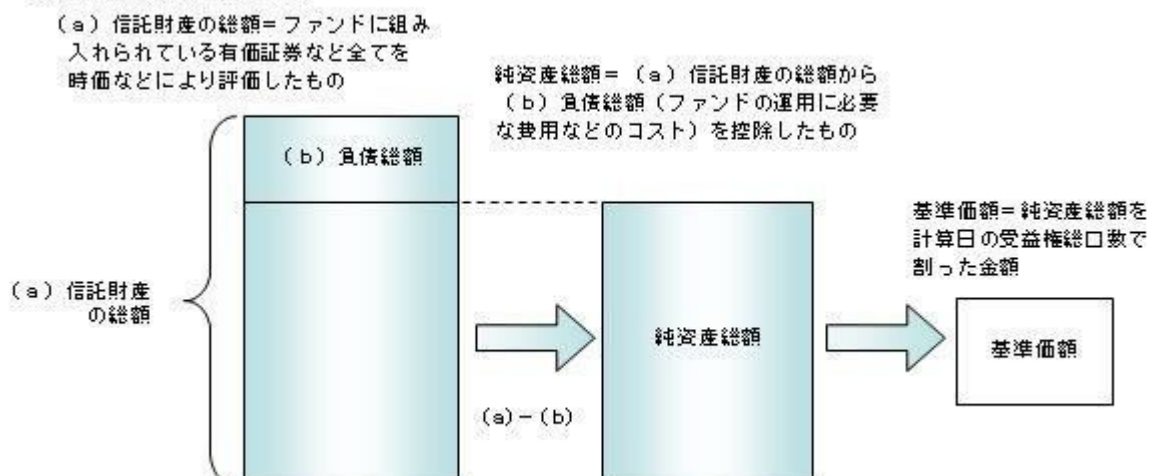
3【資産管理等の概要】

(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(2002年12月10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11月7日から翌年11月6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) 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
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)

- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
- イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
 - ニ) 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。

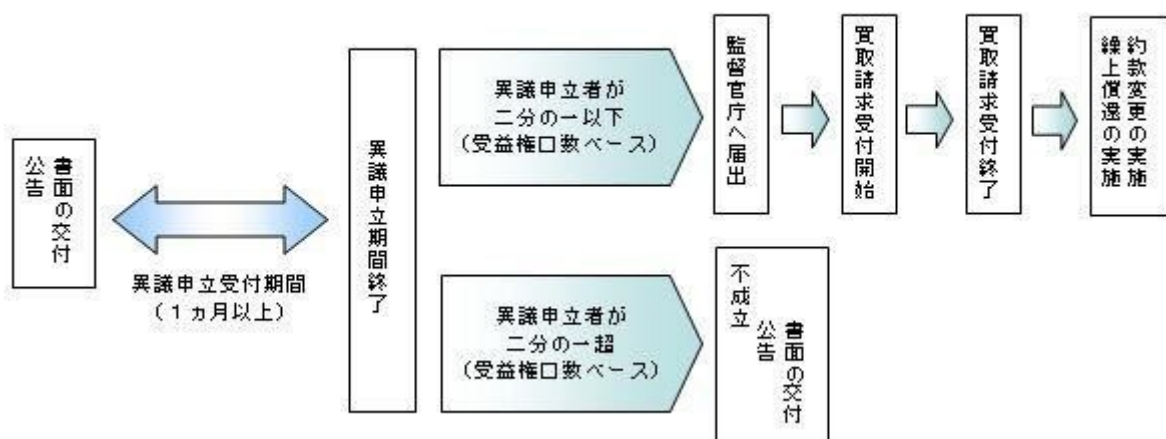
信託約款の変更

- 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なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 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、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

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17期計算期間（2018年11月7日から2019年11月6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】

【DCインデックスバランス(株式40)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 2018年11月 6日現在	第17期 2019年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,844,588	-
コール・ローン	269,652,254	390,820,131
親投資信託受益証券	5,524,358,467	7,221,860,711
未収入金	5,525,150	-
流動資産合計	5,830,380,459	7,612,680,842
資産合計	5,830,380,459	7,612,680,842
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,114,700	3,899,967
未払解約金	12,182,964	7,756,280
未払受託者報酬	859,038	1,141,799
未払委託者報酬	4,295,529	5,709,318
未払利息	460	214
その他未払費用	140,255	152,184
流動負債合計	20,592,946	18,659,762
負債合計	20,592,946	18,659,762
純資産の部		
元本等		
元本	3,114,700,313	3,899,967,738
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,695,087,200	3,694,053,342
(分配準備積立金)	845,642,450	919,971,911
元本等合計	5,809,787,513	7,594,021,080
純資産合計	5,809,787,513	7,594,021,080
負債純資産合計	5,830,380,459	7,612,680,842

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期		第17期	
	自 2017年11月7日	至 2018年11月6日	自 2018年11月7日	至 2019年11月6日
営業収益				
受取利息		103		196
有価証券売買等損益		92,131,038		330,849,399
営業収益合計		92,130,935		330,849,595
営業費用				
支払利息		118,287		132,301
受託者報酬		1,592,445		2,138,808
委託者報酬		7,962,874		10,694,649
その他費用		278,079		303,624
営業費用合計		9,951,685		13,269,382
営業利益又は営業損失()		102,082,620		317,580,213
経常利益又は経常損失()		102,082,620		317,580,213
当期純利益又は当期純損失()		102,082,620		317,580,213
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()		2,329,681		3,168,069
期首剰余金又は期首欠損金()		2,056,652,253		2,695,087,200
剰余金増加額又は欠損金減少額		955,488,358		1,006,459,608
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		955,488,358		1,006,459,608
剰余金減少額又は欠損金増加額		214,185,772		318,005,643
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		214,185,772		318,005,643
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		3,114,700		3,899,967
期末剰余金又は期末欠損金()		2,695,087,200		3,694,053,342

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第16期 2018年11月 6日現在	第17期 2019年11月 6日現在
1.	期首元本額	2,280,863,414円	3,114,700,313円
	期中追加設定元本額	1,071,592,550円	1,153,119,415円
	期中一部解約元本額	237,755,651円	367,851,990円
2.	受益権の総数	3,114,700,313口	3,899,967,738口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2017年11月 7日 至 2018年11月 6日		第17期 自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6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 69,178,273円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 106,630,595円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 55,638,701円
C	信託約款に定める収益調整金 1,955,014,896円	C	信託約款に定める収益調整金 2,774,081,431円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 779,578,877円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 761,602,582円
E	分配対象収益 (A+B+C+D) 2,803,772,046円	E	分配対象収益 (A+B+C+D) 3,697,953,309円
F	分配対象収益(1万口当たり) 9,001円	F	分配対象収益(1万口当たり) 9,481円
G	分配金額 3,114,700円	G	分配金額 3,899,967円
H	分配金額(1万口当たり) 10円	H	分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第16期 自 2017年11月 7日 至 2018年11月 6日	第17期 自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6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16期 2018年11月 6日現在	第17期 2019年11月 6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16期(2018年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

親投資信託受益証券	90,093,338
合計	90,093,338

第17期(2019年11月6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	327,146,266
合計	327,146,266

(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16期 2018年11月6日現在		第17期 2019年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.8653円	1口当たり純資産額	1.9472円
(1万口当たり純資産額)	(18,653円)	(1万口当たり純資産額)	(19,472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	288,800,098	773,031,222	
	日本債券インデックスマザーファンド	2,359,105,762	3,368,803,028	

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	320,858,961	751,130,827	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,482,617,542	2,328,895,634	
合計	4,451,382,363	7,221,860,711	

(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-KOKUSA I(ヘッジなし)マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	21,355,086	-
コール・ローン	186,692,299	96,981,135
株式	29,104,829,140	33,417,562,630
派生商品評価勘定	6,667,980	17,618,570
未収入金	-	1,747,820
未収配当金	260,076,213	319,496,862
前払金	4,330,000	-
流動資産合計	29,583,950,718	33,853,407,017
資産合計	29,583,950,718	33,853,407,017
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,368,240	-
前受金	-	20,140,000
未払金	138,312,730	-
未払解約金	4,407,186	33,457,645
未払利息	319	53
流動負債合計	146,088,475	53,597,698
負債合計	146,088,475	53,597,698
純資産の部		
元本等		

元本	19,628,127,216	21,517,048,675
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,809,735,027	12,282,760,644
元本等合計	29,437,862,243	33,799,809,319
純資産合計	29,437,862,243	33,799,809,319
負債純資産合計	29,583,950,718	33,853,407,017

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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
1. 期首	2017年11月 7日	2018年11月 7日
期首元本額	18,556,735,435円	19,628,127,216円
期首からの追加設定元本額	3,092,609,803円	3,688,070,856円
期首からの一部解約元本額	2,021,218,022円	1,799,149,397円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	403,072,955円	573,098,014円
DCインデックスバランス（株式40）	1,172,259,377円	1,482,617,542円
DCインデックスバランス（株式60）	2,257,628,335円	2,869,213,373円
DCインデックスバランス（株式80）	2,375,984,509円	2,959,007,071円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,491,372,908円	1,363,512,596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	3,341,745,524円	3,585,817,766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	3,526,022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 8 0）	50,973,871円	51,444,028円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 6 0）	42,918,064円	42,485,478円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 4 0）	74,096,214円	63,721,419円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 2 0）	64,755,008円	61,225,049円
国際分散型ファンド 4 0（適格機関投資家向け）	4,374,639,542円	4,300,617,772円
世界アセットバランスファンド 4 0（適格機関投資家向け）	931,845円	- 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 2 0）	262,766,698円	283,866,304円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 4 0）	782,978,350円	809,568,305円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 6 0）	1,136,373,427円	1,180,262,868円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 8 0）	1,106,668,521円	1,150,880,819円
計	19,628,127,216円	21,517,048,675円
2. 受益権の総数	19,628,127,216口	21,517,048,675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	423,200,000円	437,610,000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11月 7日 至 2018年11月 6日	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6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11月 6日現在	2019年11月 6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11月 6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	1,100,685,221
合計	1,100,685,221

(2019年11月 6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	903,790,303
合計	903,790,303

(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11月 6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	313,135,000	-	316,445,000	3,310,000
合計		313,135,000	-	316,445,000	3,310,000

(2019年11月 6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	338,740,000	-	356,370,000	17,630,000
合計		338,740,000	-	356,370,000	17,630,000

(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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額	1.4998円	1口当たり純資産額	1.5708円
(1万口当たり純資産額)	(14,998円)	(1万口当たり純資産額)	(15,708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	700	2,949.00	2,064,300	
日本水産	19,000	636.00	12,084,000	
マルハニチロ	2,700	2,947.00	7,956,900	
カネコ種苗	600	1,494.00	896,400	
サカタのタネ	2,300	3,610.00	8,303,000	
ホクト	1,400	1,906.00	2,668,400	
ホクリヨウ	300	718.00	215,400	
住石ホールディングス	4,000	141.00	564,000	
日鉄鉱業	400	4,510.00	1,804,000	
三井松島ホールディングス	700	1,313.00	919,100	
国際石油開発帝石	76,200	1,062.00	80,924,400	
石油資源開発	2,500	2,878.00	7,195,000	
K&Oエナジーグループ	900	1,676.00	1,508,400	
ヒノキヤグループ	500	2,130.00	1,065,000	
ショーボンドホールディングス	2,700	4,230.00	11,421,000	
ミライト・ホールディングス	5,700	1,734.00	9,883,800	
サンヨーホームズ	200	721.00	144,200	
日本アクア	800	685.00	548,000	
ファーストコーポレーション	700	730.00	511,000	
ベステラ	400	1,233.00	493,200	
スペースバリューホールディングス	2,400	533.00	1,279,200	
ダイセキ環境ソリューション	400	947.00	378,800	
第一カッター興業	300	1,856.00	556,800	
安藤・間	11,300	857.00	9,684,100	
東急建設	5,600	890.00	4,984,000	
コムシスホールディングス	6,700	3,155.00	21,138,500	

ミサワホーム	1,300	1,178.00	1,531,400	
ピーアールホールディングス	2,100	460.00	966,000	
高松コンストラクショングループ	1,200	2,692.00	3,230,400	
東建コーポレーション	600	7,140.00	4,284,000	
ソネック	300	838.00	251,400	
ヤマウラ	900	882.00	793,800	
大成建設	14,600	4,460.00	65,116,000	
大林組	43,900	1,148.00	50,397,200	
清水建設	44,500	1,043.00	46,413,500	
飛島建設	1,300	1,456.00	1,892,800	
長谷工コーポレーション	17,000	1,424.00	24,208,000	
松井建設	1,800	888.00	1,598,400	
銭高組	200	4,260.00	852,000	
鹿島建設	34,400	1,539.00	52,941,600	
不動テトラ	1,200	1,509.00	1,810,800	
大末建設	600	970.00	582,000	
鉄建建設	1,000	2,902.00	2,902,000	
西松建設	3,400	2,306.00	7,840,400	
三井住友建設	10,600	624.00	6,614,400	
大豊建設	1,000	3,090.00	3,090,000	
前田建設工業	11,000	1,059.00	11,649,000	
ナカノフドー建設	1,300	510.00	663,000	
奥村組	2,400	3,125.00	7,500,000	
東鉄工業	1,900	3,400.00	6,460,000	
イチケン	400	1,758.00	703,200	
富士ピー・エス	800	619.00	495,200	
浅沼組	500	4,245.00	2,122,500	
戸田建設	18,300	697.00	12,755,100	
熊谷組	2,000	3,365.00	6,730,000	
北野建設	300	2,912.00	873,600	
植木組	200	2,616.00	523,200	
矢作建設工業	2,000	772.00	1,544,000	
ピーエス三菱	1,500	774.00	1,161,000	
日本ハウスホールディングス	3,100	510.00	1,581,000	
大東建託	5,200	13,845.00	71,994,000	
新日本建設	1,900	886.00	1,683,400	

N I P P O	3,600	2,221.00	7,995,600
東亜道路工業	300	3,495.00	1,048,500
前田道路	4,700	2,414.00	11,345,800
日本道路	400	6,560.00	2,624,000
東亜建設工業	1,400	1,578.00	2,209,200
日本国土開発	2,600	648.00	1,684,800
若築建設	800	1,660.00	1,328,000
東洋建設	5,000	513.00	2,565,000
五洋建設	17,400	671.00	11,675,400
福田組	500	4,705.00	2,352,500
住友林業	11,100	1,571.00	17,438,100
日本基礎技術	1,600	395.00	632,000
バコーポレーション	2,100	431.00	905,100
大和ハウス工業	43,400	3,691.00	160,189,400
ライト工業	2,500	1,711.00	4,277,500
積水ハウス	48,000	2,347.50	112,680,000
日特建設	1,200	723.00	867,600
北陸電気工事	800	1,019.00	815,200
ユアテック	2,600	706.00	1,835,600
四電工	300	2,779.00	833,700
中電工	1,800	2,543.00	4,577,400
関電工	6,300	1,050.00	6,615,000
きんでん	10,400	1,683.00	17,503,200
東京エネシス	1,500	972.00	1,458,000
トーエネック	400	3,795.00	1,518,000
住友電設	1,200	2,360.00	2,832,000
日本電設工業	2,300	2,372.00	5,455,600
協和エクシオ	6,700	2,783.00	18,646,100
新日本空調	1,200	2,174.00	2,608,800
九電工	3,100	3,750.00	11,625,000
三機工業	3,200	1,359.00	4,348,800
日揮ホールディングス	13,500	1,624.00	21,924,000
中外炉工業	500	1,812.00	906,000
ヤマト	1,500	752.00	1,128,000
太平電業	1,100	2,561.00	2,817,100
高砂熱学工業	3,800	2,000.00	7,600,000

三晃金属工業	200	2,628.00	525,600	
朝日工業社	300	3,300.00	990,000	
明星工業	2,900	912.00	2,644,800	
大気社	2,100	3,695.00	7,759,500	
ダイダン	1,100	2,661.00	2,927,100	
日比谷総合設備	1,400	1,993.00	2,790,200	
東芝プラントシステム	3,400	2,064.00	7,017,600	
OSJBホールディングス	7,200	267.00	1,922,400	
東洋エンジニアリング	1,900	709.00	1,347,100	
レイズネクスト	2,400	1,118.00	2,683,200	
日本製粉	4,100	1,746.00	7,158,600	
日清製粉グループ本社	15,900	2,159.00	34,328,100	
日東富士製粉	100	6,400.00	640,000	
昭和産業	1,300	3,215.00	4,179,500	
鳥越製粉	1,200	946.00	1,135,200	
中部飼料	1,700	1,343.00	2,283,100	
フィード・ワン	9,300	172.00	1,599,600	
東洋精糖	200	1,155.00	231,000	
日本甜菜製糖	700	2,132.00	1,492,400	
三井製糖	1,200	2,285.00	2,742,000	
塩水港精糖	1,500	217.00	325,500	
日新製糖	700	2,032.00	1,422,400	
森永製菓	3,300	5,300.00	17,490,000	
中村屋	400	4,680.00	1,872,000	
江崎グリコ	4,200	5,070.00	21,294,000	
名糖産業	700	1,313.00	919,100	
井村屋グループ	600	2,107.00	1,264,200	
不二家	800	2,142.00	1,713,600	
山崎製パン	10,500	1,884.00	19,782,000	
第一屋製パン	200	980.00	196,000	
モロゾフ	200	5,070.00	1,014,000	
亀田製菓	800	5,040.00	4,032,000	
寿スピリッツ	1,300	7,640.00	9,932,000	
カルビー	6,400	3,500.00	22,400,000	
森永乳業	2,600	4,195.00	10,907,000	
六甲バター	900	1,849.00	1,664,100	

ヤクルト本社	9,600	6,280.00	60,288,000
明治ホールディングス	9,300	8,060.00	74,958,000
雪印メグミルク	3,400	2,595.00	8,823,000
プリマハム	2,200	2,596.00	5,711,200
日本ハム	5,300	4,825.00	25,572,500
林兼産業	400	670.00	268,000
丸大食品	1,500	2,328.00	3,492,000
S Foods	1,100	2,978.00	3,275,800
伊藤ハム米久ホールディングス	8,900	710.00	6,319,000
サッポロホールディングス	4,800	2,638.00	12,662,400
アサヒグループホールディングス	29,400	5,181.00	152,321,400
キリンホールディングス	59,500	2,286.50	136,046,750
宝ホールディングス	10,500	1,090.00	11,445,000
オエノンホールディングス	3,700	401.00	1,483,700
養命酒製造	400	1,992.00	796,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,900	2,515.00	24,898,500
サントリー食品インターナショナル	9,400	4,755.00	44,697,000
ダイドーグループホールディングス	700	4,360.00	3,052,000
伊藤園	4,300	5,310.00	22,833,000
キーコーヒー	1,400	2,346.00	3,284,400
ユニカフェ	400	1,034.00	413,600
ジャパンフーズ	100	1,215.00	121,500
日清オイリオグループ	1,800	4,105.00	7,389,000
不二製油グループ本社	3,400	3,185.00	10,829,000
J - オイルミルズ	700	4,530.00	3,171,000
キッコーマン	10,000	5,510.00	55,100,000
味の素	30,900	1,961.00	60,594,900
キューピー	7,800	2,510.00	19,578,000
ハウス食品グループ本社	5,200	4,105.00	21,346,000
カゴメ	5,300	2,631.00	13,944,300
焼津水産化学工業	700	1,058.00	740,600
アリアケジャパン	1,300	8,430.00	10,959,000
ピエトロ	200	1,637.00	327,400
エバラ食品工業	300	2,199.00	659,700
やまみ	100	2,004.00	200,400

ニチレイ	6,700	2,605.00	17,453,500
東洋水産	7,200	4,830.00	34,776,000
イトアンド	500	1,772.00	886,000
大冷	200	1,995.00	399,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	949.00	759,200
日清食品ホールディングス	6,000	8,350.00	50,100,000
永谷園ホールディングス	700	2,148.00	1,503,600
一正蒲鉾	500	1,093.00	546,500
フジッコ	1,500	1,988.00	2,982,000
ロック・フィールド	1,500	1,488.00	2,232,000
日本たばこ産業	81,000	2,429.00	196,749,000
ケンコーマヨネーズ	800	2,562.00	2,049,600
わらべや日洋ホールディングス	900	1,903.00	1,712,700
なとり	800	1,710.00	1,368,000
イフジ産業	100	758.00	75,800
ピクルスコーポレーション	300	2,577.00	773,100
北の達人コーポレーション	4,900	620.00	3,038,000
ユーグレナ	6,000	922.00	5,532,000
ミヨシ油脂	500	1,287.00	643,500
理研ビタミン	700	4,040.00	2,828,000
片倉工業	2,000	1,416.00	2,832,000
グンゼ	1,000	5,260.00	5,260,000
東洋紡	5,400	1,500.00	8,100,000
ユニチカ	3,900	358.00	1,396,200
富士紡ホールディングス	700	3,470.00	2,429,000
倉敷紡績	1,400	2,586.00	3,620,400
シキボウ	700	949.00	664,300
日本毛織	4,500	1,098.00	4,941,000
ダイトウボウ	2,100	86.00	180,600
トーア紡コーポレーション	500	534.00	267,000
ダイドーリミテッド	1,800	284.00	511,200
帝国繊維	1,500	2,108.00	3,162,000
帝人	11,200	2,175.00	24,360,000
東レ	99,100	787.20	78,011,520
サカイオーベックス	400	1,907.00	762,800
住江織物	400	2,949.00	1,179,600

日本フェルト	800	491.00	392,800	
イチカワ	200	1,563.00	312,600	
日東製網	100	1,630.00	163,000	
アツギ	1,100	837.00	920,700	
ダイニック	500	790.00	395,000	
セーレン	3,400	1,496.00	5,086,400	
ソトー	500	990.00	495,000	
東海染工	200	1,132.00	226,400	
小松マテーレ	2,300	854.00	1,964,200	
ワコールホールディングス	3,600	2,968.00	10,684,800	
ホギメディカル	1,500	3,630.00	5,445,000	
レナウン	3,500	114.00	399,000	
クラウドディアホールディングス	300	486.00	145,800	
T S Iホールディングス	4,500	579.00	2,605,500	
マツオカコーポレーション	400	1,994.00	797,600	
ワールド	1,900	2,577.00	4,896,300	
三陽商会	700	1,512.00	1,058,400	
ナイガイ	400	472.00	188,800	
オンワードホールディングス	8,200	633.00	5,190,600	
ルックホールディングス	500	1,156.00	578,000	
キムラタン	6,300	34.00	214,200	
ゴールドウイン	2,500	7,870.00	19,675,000	
デサント	2,700	1,527.00	4,122,900	
キング	600	568.00	340,800	
ヤマトインターナショナル	800	396.00	316,800	
特種東海製紙	900	4,100.00	3,690,000	
王子ホールディングス	57,200	629.00	35,978,800	
日本製紙	6,100	1,921.00	11,718,100	
三菱製紙	1,600	507.00	811,200	
北越コーポレーション	9,100	589.00	5,359,900	
中越パルプ工業	600	1,683.00	1,009,800	
巴川製紙所	400	992.00	396,800	
大王製紙	6,000	1,502.00	9,012,000	
阿波製紙	400	440.00	176,000	
レンゴー	12,900	811.00	10,461,900	
トーモク	800	1,876.00	1,500,800	

ザ・バック	1,000	3,900.00	3,900,000	
クラレ	21,500	1,370.00	29,455,000	
旭化成	91,300	1,243.50	113,531,550	
共和レザー	700	817.00	571,900	
昭和電工	9,700	3,145.00	30,506,500	
住友化学	100,500	516.00	51,858,000	
住友精化	600	3,410.00	2,046,000	
日産化学	7,700	4,480.00	34,496,000	
ラサ工業	500	1,544.00	772,000	
クレハ	1,200	6,940.00	8,328,000	
多木化学	400	4,510.00	1,804,000	
テイカ	1,000	2,194.00	2,194,000	
石原産業	2,500	1,233.00	3,082,500	
片倉コープアグリ	400	1,206.00	482,400	
日本曹達	2,000	3,005.00	6,010,000	
東ソー	21,100	1,610.00	33,971,000	
トクヤマ	3,900	3,145.00	12,265,500	
セントラル硝子	2,800	2,775.00	7,770,000	
東亜合成	8,600	1,241.00	10,672,600	
大阪ソーダ	1,400	3,085.00	4,319,000	
関東電化工業	3,200	977.00	3,126,400	
デンカ	5,000	3,225.00	16,125,000	
信越化学工業	24,100	12,390.00	298,599,000	
日本カーバイド工業	400	1,472.00	588,800	
堺化学工業	900	2,814.00	2,532,600	
第一稀元素化学工業	1,500	875.00	1,312,500	
エア・ウォーター	11,200	2,083.00	23,329,600	
大陽日酸	13,200	2,580.00	34,056,000	
日本化学工業	400	3,125.00	1,250,000	
東邦アセチレン	200	1,377.00	275,400	
日本パーカライジング	6,900	1,274.00	8,790,600	
高压ガス工業	2,200	886.00	1,949,200	
四国化成工業	2,100	1,316.00	2,763,600	
戸田工業	300	2,267.00	680,100	
ステラ ケミファ	800	3,165.00	2,532,000	
保土谷化学工業	500	4,180.00	2,090,000	

日本触媒	2,100	6,850.00	14,385,000	
大日精化工業	1,200	3,440.00	4,128,000	
カネカ	3,500	3,810.00	13,335,000	
三菱瓦斯化学	12,900	1,678.00	21,646,200	
三井化学	12,400	2,691.00	33,368,400	
J S R	12,800	2,117.00	27,097,600	
東京応化工業	2,400	4,315.00	10,356,000	
大阪有機化学工業	1,200	1,216.00	1,459,200	
三菱ケミカルホールディングス	91,500	876.30	80,181,450	
K Hネオケム	2,400	2,745.00	6,588,000	
ダイセル	18,700	1,109.00	20,738,300	
住友ベークライト	2,200	4,520.00	9,944,000	
積水化学工業	29,400	1,937.00	56,947,800	
日本ゼオン	12,300	1,357.00	16,691,100	
アイカ工業	4,100	3,465.00	14,206,500	
宇部興産	6,800	2,357.00	16,027,600	
積水樹脂	2,500	2,281.00	5,702,500	
タキロンシーアイ	3,000	698.00	2,094,000	
旭有機材	800	1,719.00	1,375,200	
日立化成	6,300	3,490.00	21,987,000	
ニチバン	700	1,893.00	1,325,100	
リケンテクノス	3,500	546.00	1,911,000	
大倉工業	700	2,118.00	1,482,600	
積水化成品工業	1,800	858.00	1,544,400	
群栄化学工業	300	2,578.00	773,400	
タイガースポリマー	800	589.00	471,200	
ミライアル	500	1,447.00	723,500	
ダイキアクシス	500	948.00	474,000	
ダイキョーニシカワ	2,900	892.00	2,586,800	
竹本容器	500	1,009.00	504,500	
森六ホールディングス	700	2,470.00	1,729,000	
日本化薬	8,500	1,344.00	11,424,000	
カーリットホールディングス	1,400	637.00	891,800	
日本精化	1,100	1,303.00	1,433,300	
扶桑化学工業	1,400	3,015.00	4,221,000	
トリケミカル研究所	300	7,600.00	2,280,000	

A D E K A	6,300	1,613.00	10,161,900
日油	5,200	3,805.00	19,786,000
新日本理化	2,400	207.00	496,800
ハリマ化成グループ	1,100	1,253.00	1,378,300
花王	33,500	8,588.00	287,698,000
第一工業製薬	500	3,720.00	1,860,000
石原ケミカル	400	1,739.00	695,600
日華化学	500	911.00	455,500
ニイタカ	200	1,725.00	345,000
三洋化成工業	800	5,410.00	4,328,000
有機合成薬品工業	1,000	292.00	292,000
大日本塗料	1,600	1,129.00	1,806,400
日本ペイントホールディングス	11,300	6,170.00	69,721,000
関西ペイント	15,400	2,670.00	41,118,000
神東塗料	1,100	193.00	212,300
中国塗料	3,900	1,097.00	4,278,300
日本特殊塗料	1,000	1,268.00	1,268,000
藤倉化成	1,800	575.00	1,035,000
太陽ホールディングス	1,000	4,360.00	4,360,000
D I C	5,800	3,245.00	18,821,000
サカタインクス	3,000	1,248.00	3,744,000
東洋インキ S C ホールディングス	2,900	2,768.00	8,027,200
T & K T O K A	1,100	1,051.00	1,156,100
富士フイルムホールディングス	26,800	4,852.00	130,033,600
資生堂	27,800	8,955.00	248,949,000
ライオン	18,200	2,238.00	40,731,600
高砂香料工業	900	2,757.00	2,481,300
マンダム	3,100	2,974.00	9,219,400
ミルボン	1,900	5,930.00	11,267,000
ファンケル	5,700	3,040.00	17,328,000
コーセー	2,600	17,990.00	46,774,000
コタ	700	1,367.00	956,900
ポーラ・オルビスホールディングス	6,000	2,466.00	14,796,000
ノエビアホールディングス	1,300	5,780.00	7,514,000
アジュバンコスメジャパン	300	949.00	284,700
エステー	900	1,743.00	1,568,700

アグロ カネショウ	400	1,591.00	636,400
コニシ	2,300	1,516.00	3,486,800
長谷川香料	1,800	2,055.00	3,699,000
星光PMC	800	868.00	694,400
小林製薬	3,900	8,660.00	33,774,000
荒川化学工業	1,300	1,645.00	2,138,500
メック	1,000	1,828.00	1,828,000
日本高純度化学	400	2,621.00	1,048,400
タカラバイオ	3,700	2,210.00	8,177,000
JCU	1,700	2,773.00	4,714,100
新田ゼラチン	900	715.00	643,500
OATアグリオ	300	1,812.00	543,600
デクセリアルズ	3,600	977.00	3,517,200
アース製薬	1,100	5,690.00	6,259,000
北興化学工業	1,500	624.00	936,000
大成ラミック	500	3,030.00	1,515,000
クミアイ化学工業	5,700	1,029.00	5,865,300
日本農薬	2,500	590.00	1,475,000
アキレス	900	1,819.00	1,637,100
有沢製作所	2,200	1,101.00	2,422,200
日東電工	9,600	6,150.00	59,040,000
レック	1,500	1,084.00	1,626,000
三光合成	1,600	432.00	691,200
きもと	2,500	185.00	462,500
藤森工業	1,300	3,760.00	4,888,000
前澤化成工業	900	1,230.00	1,107,000
未来工業	800	2,219.00	1,775,200
ウェーブロックホールディングス	500	791.00	395,500
JSP	800	1,966.00	1,572,800
エフピコ	1,500	6,790.00	10,185,000
天馬	1,000	2,022.00	2,022,000
信越ポリマー	2,600	979.00	2,545,400
東リ	3,500	306.00	1,071,000
ニフコ	5,000	2,940.00	14,700,000
バルカー	1,100	2,474.00	2,721,400
ユニ・チャーム	26,900	3,692.00	99,314,800

ショーエイコーポレーション	200	743.00	148,600	
協和キリン	14,000	1,985.00	27,790,000	
武田薬品工業	116,300	4,227.00	491,600,100	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	122,900	1,827.50	224,599,750	
大日本住友製薬	10,200	1,833.00	18,696,600	
塩野義製薬	17,900	6,417.00	114,864,300	
田辺三菱製薬	17,000	1,329.00	22,593,000	
わかもと製薬	1,500	268.00	402,000	
あすか製薬	1,600	1,155.00	1,848,000	
日本新薬	3,600	9,510.00	34,236,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,291.00	458,200	
中外製薬	14,600	9,190.00	134,174,000	
科研製薬	2,400	5,430.00	13,032,000	
エーザイ	16,700	7,538.00	125,884,600	
ロート製薬	7,200	3,295.00	23,724,000	
小野薬品工業	32,900	2,109.00	69,386,100	
久光製薬	4,100	5,090.00	20,869,000	
持田製薬	1,900	4,400.00	8,360,000	
参天製薬	25,900	1,928.00	49,935,200	
扶桑薬品工業	500	2,151.00	1,075,500	
日本ケミファ	200	3,045.00	609,000	
ツムラ	4,300	3,025.00	13,007,500	
日医工	3,800	1,277.00	4,852,600	
キッセイ薬品工業	2,500	2,796.00	6,990,000	
生化学工業	2,700	1,285.00	3,469,500	
栄研化学	2,400	1,791.00	4,298,400	
日水製薬	600	1,295.00	777,000	
鳥居薬品	900	2,766.00	2,489,400	
JCRファーマ	1,000	8,320.00	8,320,000	
東和薬品	1,800	2,787.00	5,016,600	
富士製薬工業	900	1,457.00	1,311,300	
沢井製薬	2,900	6,060.00	17,574,000	
ゼリア新薬工業	2,500	2,106.00	5,265,000	
第一三共	40,000	6,880.00	275,200,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,100	1,851.00	5,738,100	

大幸薬品	600	2,786.00	1,671,600
ダイト	800	3,290.00	2,632,000
大塚ホールディングス	26,600	4,449.00	118,343,400
大正製薬ホールディングス	3,000	7,780.00	23,340,000
ペプチドリーム	7,100	5,310.00	37,701,000
日本コークス工業	11,600	87.00	1,009,200
ニチレキ	1,700	1,301.00	2,211,700
ユシロ化学工業	800	1,477.00	1,181,600
ピーピー・カストロール	500	1,517.00	758,500
富士石油	3,700	262.00	969,400
MORESCO	500	1,354.00	677,000
出光興産	15,700	3,280.00	51,496,000
JXTGホールディングス	216,800	521.10	112,974,480
コスモエネルギーホールディングス	4,000	2,389.00	9,556,000
横浜ゴム	8,100	2,496.00	20,217,600
TOYO TIRE	8,000	1,538.00	12,304,000
ブリヂストン	43,000	4,633.00	199,219,000
住友ゴム工業	12,500	1,468.00	18,350,000
藤倉コンポジット	1,200	531.00	637,200
オカモト	800	4,315.00	3,452,000
フコク	600	727.00	436,200
ニッタ	1,600	3,210.00	5,136,000
住友理工	2,700	978.00	2,640,600
三ツ星ベルト	1,800	2,145.00	3,861,000
バンドー化学	2,500	986.00	2,465,000
日東紡績	2,100	3,215.00	6,751,500
A G C	13,800	3,990.00	55,062,000
日本板硝子	6,700	665.00	4,455,500
石塚硝子	300	2,203.00	660,900
日本山村硝子	600	1,322.00	793,200
日本電気硝子	5,600	2,511.00	14,061,600
オハラ	600	1,496.00	897,600
住友大阪セメント	2,600	4,820.00	12,532,000
太平洋セメント	8,800	3,200.00	28,160,000
日本ヒューム	1,400	829.00	1,160,600
日本コンクリート工業	3,000	320.00	960,000

三谷セキサン	700	3,650.00	2,555,000
アジアパイルホールディングス	2,000	590.00	1,180,000
東海カーボン	14,600	1,131.00	16,512,600
日本カーボン	700	4,160.00	2,912,000
東洋炭素	800	2,651.00	2,120,800
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,925.00	3,940,000
TOTO	9,900	4,605.00	45,589,500
日本碍子	17,100	1,833.00	31,344,300
日本特殊陶業	10,900	2,272.00	24,764,800
ダントーホールディングス	1,100	114.00	125,400
MARUWA	500	7,710.00	3,855,000
品川リフラクトリーズ	400	2,981.00	1,192,400
黒崎播磨	300	6,210.00	1,863,000
ヨータイ	1,100	711.00	782,100
イソライト工業	800	583.00	466,400
東京窯業	1,800	326.00	586,800
ニッカトー	700	796.00	557,200
フジミンコーポレーテッド	1,200	2,912.00	3,494,400
クニミネ工業	600	1,121.00	672,600
エーアンドエーマテリアル	200	1,174.00	234,800
ニチアス	3,800	2,470.00	9,386,000
ニチハ	1,900	3,165.00	6,013,500
日本製鉄	61,900	1,622.50	100,432,750
神戸製鋼所	25,300	617.00	15,610,100
合同製鐵	800	2,615.00	2,092,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	37,300	1,409.00	52,555,700
東京製鐵	6,700	865.00	5,795,500
共英製鋼	1,600	2,149.00	3,438,400
大和工業	2,900	2,799.00	8,117,100
東京鐵鋼	600	1,630.00	978,000
大阪製鐵	700	1,481.00	1,036,700
淀川製鋼所	1,900	2,140.00	4,066,000
丸一鋼管	4,500	3,050.00	13,725,000
モリ工業	400	2,354.00	941,600
大同特殊鋼	2,300	5,160.00	11,868,000
日本高周波鋼業	600	447.00	268,200

日本冶金工業	1,100	2,457.00	2,702,700	
山陽特殊製鋼	1,000	1,492.00	1,492,000	
愛知製鋼	800	3,660.00	2,928,000	
日立金属	14,800	1,391.00	20,586,800	
日本金属	300	1,036.00	310,800	
大太平洋金属	900	2,647.00	2,382,300	
新日本電工	9,200	192.00	1,766,400	
栗本鐵工所	700	1,977.00	1,383,900	
虹技	200	1,430.00	286,000	
日本鑄鉄管	200	1,327.00	265,400	
三菱製鋼	1,000	1,195.00	1,195,000	
日垂鋼業	2,100	343.00	720,300	
日本精線	200	2,792.00	558,400	
エンビプロ・ホールディングス	600	670.00	402,000	
シンニッタン	2,100	452.00	949,200	
新家工業	300	1,612.00	483,600	
大紀アルミニウム工業所	2,400	765.00	1,836,000	
日本軽金属ホールディングス	35,000	223.00	7,805,000	
三井金属鉱業	3,700	3,240.00	11,988,000	
東邦亜鉛	700	2,282.00	1,597,400	
三菱マテリアル	9,100	3,200.00	29,120,000	
住友金属鉱山	17,600	3,616.00	63,641,600	
D O W Aホールディングス	3,500	3,770.00	13,195,000	
古河機械金属	2,500	1,601.00	4,002,500	
エス・サイエンス	6,300	53.00	333,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	1,663.00	2,494,500	
東邦チタニウム	2,500	920.00	2,300,000	
U A C J	2,100	2,363.00	4,962,300	
C Kサンエツ	300	2,934.00	880,200	
古河電気工業	4,300	3,040.00	13,072,000	
住友電気工業	51,700	1,570.00	81,169,000	
フジクラ	16,700	474.00	7,915,800	
昭和電線ホールディングス	1,600	1,069.00	1,710,400	
タツタ電線	2,800	592.00	1,657,600	
カナレ電気	300	1,914.00	574,200	
平河ヒューテック	500	1,280.00	640,000	

リョービ	1,700	2,085.00	3,544,500
アーレスティ	1,900	562.00	1,067,800
アサヒホールディングス	2,400	2,608.00	6,259,200
稲葉製作所	800	1,470.00	1,176,000
宮地エンジニアリンググループ	400	2,294.00	917,600
トーカロ	3,800	1,089.00	4,138,200
アルファC o	500	1,353.00	676,500
SUMCO	16,500	1,912.00	31,548,000
川田テクノロジーズ	300	7,190.00	2,157,000
RS Technologies	400	4,515.00	1,806,000
信和	600	1,019.00	611,400
東洋製罐グループホールディングス	8,800	1,973.00	17,362,400
ホッカンホールディングス	800	1,829.00	1,463,200
コロナ	700	1,170.00	819,000
横河ブリッジホールディングス	2,600	1,918.00	4,986,800
駒井ハルテック	300	1,777.00	533,100
高田機工	100	2,612.00	261,200
三和ホールディングス	13,300	1,264.00	16,811,200
文化シャッター	4,100	973.00	3,989,300
三協立山	1,900	1,239.00	2,354,100
アルインコ	1,000	1,222.00	1,222,000
東洋シャッター	300	775.00	232,500
LIXILグループ	20,300	2,132.00	43,279,600
日本フィルコン	1,100	536.00	589,600
ノーリツ	2,900	1,394.00	4,042,600
長府製作所	1,400	2,513.00	3,518,200
リンナイ	2,700	8,100.00	21,870,000
ダイニチ工業	800	699.00	559,200
日東精工	1,900	612.00	1,162,800
三洋工業	200	2,004.00	400,800
岡部	2,800	944.00	2,643,200
ジーテクト	1,700	1,918.00	3,260,600
東プレ	2,600	1,919.00	4,989,400
高周波熱錬	2,600	974.00	2,532,400
東京製綱	1,000	1,165.00	1,165,000
サンコール	800	490.00	392,000

モリテック スチール	1,100	461.00	507,100	
パイオラックス	2,000	2,224.00	4,448,000	
エイチワン	1,300	761.00	989,300	
日本発條	14,700	930.00	13,671,000	
中央発條	200	2,985.00	597,000	
アドバネクス	200	1,680.00	336,000	
立川ブラインド工業	600	1,494.00	896,400	
三益半導体工業	1,200	2,122.00	2,546,400	
日本ドライケミカル	400	1,324.00	529,600	
日本製鋼所	4,200	2,288.00	9,609,600	
三浦工業	6,000	3,635.00	21,810,000	
タクマ	4,700	1,317.00	6,189,900	
ツガミ	2,800	1,044.00	2,923,200	
オークマ	1,600	6,460.00	10,336,000	
東芝機械	1,600	2,455.00	3,928,000	
アマダホールディングス	17,600	1,243.00	21,876,800	
アイダエンジニアリング	3,700	936.00	3,463,200	
滝澤鉄工所	400	1,366.00	546,400	
F U J I	5,900	1,814.00	10,702,600	
牧野フライス製作所	1,600	5,250.00	8,400,000	
オーエスジー	6,400	2,330.00	14,912,000	
ダイジェット工業	100	1,585.00	158,500	
旭ダイヤモンド工業	3,600	659.00	2,372,400	
D M G 森精機	8,700	1,762.00	15,329,400	
ソディック	3,200	967.00	3,094,400	
ディスコ	1,900	23,620.00	44,878,000	
日東工器	800	2,367.00	1,893,600	
日進工具	400	2,212.00	884,800	
パンチ工業	1,200	563.00	675,600	
富士ダイス	600	662.00	397,200	
豊和工業	700	745.00	521,500	
O K K	600	770.00	462,000	
東洋機械金属	1,000	589.00	589,000	
津田駒工業	300	1,317.00	395,100	
島精機製作所	2,200	2,813.00	6,188,600	
オプトラン	1,500	3,400.00	5,100,000	

N C ホールディングス	400	499.00	199,600	
イワキポンプ	600	1,055.00	633,000	
フリー	1,300	972.00	1,263,600	
ヤマシンフィルタ	3,000	873.00	2,619,000	
日阪製作所	1,700	974.00	1,655,800	
やまびこ	2,700	1,265.00	3,415,500	
平田機工	700	7,770.00	5,439,000	
ペガサスマシン製造	1,400	523.00	732,200	
マルマエ	600	1,025.00	615,000	
タツモ	600	1,255.00	753,000	
ナブテスコ	8,200	3,375.00	27,675,000	
三井海洋開発	1,500	2,515.00	3,772,500	
レオン自動機	1,400	1,652.00	2,312,800	
S M C	4,300	49,580.00	213,194,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,200	581.00	697,200	
ホソカワミクロン	500	4,090.00	2,045,000	
ユニオンツール	500	3,440.00	1,720,000	
オイレス工業	1,800	1,739.00	3,130,200	
日精エー・エス・ピー機械	500	3,970.00	1,985,000	
サトーホールディングス	2,000	3,325.00	6,650,000	
技研製作所	1,200	4,025.00	4,830,000	
日本エアータック	400	682.00	272,800	
カワタ	400	1,205.00	482,000	
日精樹脂工業	1,200	1,168.00	1,401,600	
オカダアイヨン	400	1,328.00	531,200	
ワイエイシイホールディングス	600	884.00	530,400	
小松製作所	63,300	2,645.00	167,428,500	
住友重機械工業	8,000	3,365.00	26,920,000	
日立建機	5,600	2,904.00	16,262,400	
日工	1,900	680.00	1,292,000	
巴工業	600	2,370.00	1,422,000	
井関農機	1,400	1,677.00	2,347,800	
T O W A	1,400	1,057.00	1,479,800	
丸山製作所	300	1,279.00	383,700	
北川鉄工所	600	2,155.00	1,293,000	

ローツェ	600	3,640.00	2,184,000	
タカキタ	500	566.00	283,000	
クボタ	74,200	1,782.00	132,224,400	
荏原実業	400	2,189.00	875,600	
三菱化工機	500	2,000.00	1,000,000	
月島機械	2,600	1,745.00	4,537,000	
帝国電機製作所	1,100	1,318.00	1,449,800	
新東工業	3,300	1,066.00	3,517,800	
澁谷工業	1,200	2,940.00	3,528,000	
アイチ コーポレーション	2,400	694.00	1,665,600	
小森コーポレーション	3,500	1,171.00	4,098,500	
鶴見製作所	1,100	2,134.00	2,347,400	
住友精密工業	200	3,435.00	687,000	
酒井重工業	300	3,180.00	954,000	
荏原製作所	6,200	3,315.00	20,553,000	
石井鐵工所	200	2,508.00	501,600	
西島製作所	1,400	1,047.00	1,465,800	
北越工業	1,500	1,282.00	1,923,000	
ダイキン工業	17,800	15,640.00	278,392,000	
オルガノ	500	5,920.00	2,960,000	
トーヨーカネツ	600	2,039.00	1,223,400	
栗田工業	7,600	3,155.00	23,978,000	
椿本チエイン	2,000	3,905.00	7,810,000	
大同工業	700	855.00	598,500	
木村化工機	1,200	422.00	506,400	
アネスト岩田	2,200	1,073.00	2,360,600	
ダイフク	7,100	6,000.00	42,600,000	
サムコ	400	1,145.00	458,000	
加藤製作所	800	2,076.00	1,660,800	
油研工業	200	1,752.00	350,400	
タダノ	6,700	1,033.00	6,921,100	
フジテック	5,100	1,582.00	8,068,200	
C K D	3,900	1,565.00	6,103,500	
キトー	1,100	1,650.00	1,815,000	
平和	3,900	2,253.00	8,786,700	
理想科学工業	1,200	1,821.00	2,185,200	

SANKYO	3,100	3,800.00	11,780,000	
日本金銭機械	1,500	976.00	1,464,000	
マースグループホールディングス	900	2,012.00	1,810,800	
福島工業	900	3,525.00	3,172,500	
オーイズミ	500	545.00	272,500	
ダイコク電機	600	1,545.00	927,000	
竹内製作所	2,300	1,743.00	4,008,900	
アマノ	3,700	3,115.00	11,525,500	
JUKI	2,000	975.00	1,950,000	
サンデンホールディングス	1,800	721.00	1,297,800	
蛇の目マシン工業	1,300	413.00	536,900	
マックス	2,100	2,005.00	4,210,500	
グローリー	3,900	3,290.00	12,831,000	
新晃工業	1,300	1,871.00	2,432,300	
大和冷機工業	2,000	1,250.00	2,500,000	
セガサミーホールディングス	13,900	1,633.00	22,698,700	
日本ピストンリング	500	1,417.00	708,500	
リケン	600	4,265.00	2,559,000	
T P R	1,900	1,946.00	3,697,400	
ツバキ・ナカシマ	2,800	1,941.00	5,434,800	
ホシザキ	4,100	9,130.00	37,433,000	
大豊工業	1,100	875.00	962,500	
日本精工	26,200	1,066.00	27,929,200	
NTN	32,300	346.00	11,175,800	
ジェイテクト	13,400	1,410.00	18,894,000	
不二越	1,300	5,200.00	6,760,000	
日本トムソン	4,200	500.00	2,100,000	
THK	8,100	3,170.00	25,677,000	
ユーシン精機	1,100	1,055.00	1,160,500	
前澤給装工業	500	2,150.00	1,075,000	
イーグル工業	1,700	1,117.00	1,898,900	
前澤工業	1,000	390.00	390,000	
日本ピラー工業	1,400	1,500.00	2,100,000	
キッツ	5,600	795.00	4,452,000	
マキタ	18,200	3,730.00	67,886,000	
日立造船	11,000	405.00	4,455,000	

三菱重工業	23,400	4,429.00	103,638,600	
I H I	10,100	2,640.00	26,664,000	
スター精密	2,200	1,666.00	3,665,200	
日清紡ホールディングス	9,300	935.00	8,695,500	
イビデン	8,600	2,521.00	21,680,600	
コニカミノルタ	30,500	729.00	22,234,500	
ブラザー工業	17,000	2,148.00	36,516,000	
ミネベアミツミ	25,900	2,149.00	55,659,100	
日立製作所	67,200	4,136.00	277,939,200	
三菱電機	139,800	1,592.00	222,561,600	
富士電機	8,400	3,385.00	28,434,000	
東洋電機製造	600	1,557.00	934,200	
安川電機	15,000	4,245.00	63,675,000	
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,335.00	2,536,500	
明電舎	2,600	2,085.00	5,421,000	
オリジン	400	1,541.00	616,400	
山洋電気	700	5,220.00	3,654,000	
デンヨー	1,200	2,006.00	2,407,200	
東芝テック	1,800	3,970.00	7,146,000	
芝浦メカトロニクス	300	3,685.00	1,105,500	
マブチモーター	3,900	4,555.00	17,764,500	
日本電産	16,800	16,225.00	272,580,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	545.00	490,500	
トレックス・セミコンダクター	800	1,485.00	1,188,000	
東光高岳	800	1,238.00	990,400	
ダブル・スコープ	2,100	672.00	1,411,200	
ダイヘン	1,500	3,395.00	5,092,500	
ヤーマン	2,000	697.00	1,394,000	
JVCケンウッド	11,400	264.00	3,009,600	
ミマキエンジニアリング	1,300	572.00	743,600	
第一精工	500	2,620.00	1,310,000	
日新電機	3,300	1,232.00	4,065,600	
大崎電気工業	2,900	755.00	2,189,500	
オムロン	13,000	6,640.00	86,320,000	
日東工業	2,100	2,280.00	4,788,000	
I D E C	2,000	2,351.00	4,702,000	

正興電機製作所	400	844.00	337,600
不二電機工業	200	1,252.00	250,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,700	2,061.00	9,686,700
サクサホールディングス	300	1,884.00	565,200
メルコホールディングス	500	3,015.00	1,507,500
テクノメディカ	300	2,177.00	653,100
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	200	1,139.00	227,800
日本電気	17,000	4,235.00	71,995,000
富士通	13,400	9,269.00	124,204,600
沖電気工業	5,700	1,451.00	8,270,700
岩崎通信機	700	807.00	564,900
電気興業	700	3,250.00	2,275,000
サンケン電気	1,500	2,562.00	3,843,000
ナカヨ	300	1,704.00	511,200
アイホン	800	1,845.00	1,476,000
ルネサスエレクトロニクス	66,600	749.00	49,883,400
セイコーエプソン	17,300	1,572.00	27,195,600
ワコム	9,400	437.00	4,107,800
アルバック	2,800	4,790.00	13,412,000
アクセル	700	654.00	457,800
E I Z O	1,100	4,175.00	4,592,500
日本信号	3,600	1,332.00	4,795,200
京三製作所	3,300	510.00	1,683,000
能美防災	1,900	2,246.00	4,267,400
ホーチキ	1,000	1,487.00	1,487,000
星和電機	800	578.00	462,400
エレコム	1,500	4,220.00	6,330,000
パナソニック	159,700	1,015.00	162,095,500
シャープ	16,200	1,600.00	25,920,000
アンリツ	9,000	2,179.00	19,611,000
富士通ゼネラル	3,800	1,985.00	7,543,000
ソニー	88,300	6,640.00	586,312,000
T D K	6,700	11,520.00	77,184,000
帝国通信工業	700	1,206.00	844,200
タムラ製作所	4,600	633.00	2,911,800

アルプスアルパイン	12,400	2,388.00	29,611,200
池上通信機	500	1,115.00	557,500
日本電波工業	1,300	472.00	613,600
鈴木	800	792.00	633,600
日本トリム	200	5,060.00	1,012,000
ローランド ディー . ジー .	800	2,197.00	1,757,600
フォスター電機	1,500	1,985.00	2,977,500
S M K	400	3,045.00	1,218,000
ヨコオ	900	3,170.00	2,853,000
ホシデン	3,800	1,195.00	4,541,000
ヒロセ電機	2,200	13,870.00	30,514,000
日本航空電子工業	3,200	2,192.00	7,014,400
T O A	1,500	1,164.00	1,746,000
マクセルホールディングス	3,000	1,481.00	4,443,000
古野電気	1,900	1,149.00	2,183,100
ユニデンホールディングス	400	2,019.00	807,600
スミダコーポレーション	1,100	1,279.00	1,406,900
アイコム	800	2,429.00	1,943,200
リオン	600	2,569.00	1,541,400
本多通信工業	1,200	519.00	622,800
船井電機	1,500	627.00	940,500
横河電機	12,800	1,979.00	25,331,200
新電元工業	500	3,665.00	1,832,500
アズビル	8,800	3,030.00	26,664,000
東亜ディーケーケー	700	849.00	594,300
日本光電工業	5,800	3,090.00	17,922,000
チノー	500	1,484.00	742,000
共和電業	1,500	434.00	651,000
日本電子材料	600	729.00	437,400
堀場製作所	2,800	7,560.00	21,168,000
アドバンテスト	10,400	5,280.00	54,912,000
小野測器	600	522.00	313,200
エスペック	1,200	1,981.00	2,377,200
キーエンス	6,300	74,190.00	467,397,000
日置電機	700	3,815.00	2,670,500
シスメックス	10,000	7,455.00	74,550,000

日本マイクロニクス	2,500	1,034.00	2,585,000	
メガチップス	1,300	2,252.00	2,927,600	
OBARA GROUP	700	3,975.00	2,782,500	
澤藤電機	200	1,816.00	363,200	
原田工業	700	942.00	659,400	
コーセル	1,800	1,217.00	2,190,600	
イリソ電子工業	1,200	5,580.00	6,696,000	
オブテックスグループ	2,300	1,687.00	3,880,100	
千代田インテグレ	700	2,430.00	1,701,000	
アイ・オー・データ機器	600	939.00	563,400	
レーザーテック	2,900	7,910.00	22,939,000	
スタンレー電気	9,900	3,080.00	30,492,000	
岩崎電気	600	1,445.00	867,000	
ウシオ電機	8,100	1,630.00	13,203,000	
岡谷電機産業	1,200	401.00	481,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	521.00	729,400	
エノモト	500	1,218.00	609,000	
日本セラミック	1,400	2,850.00	3,990,000	
遠藤照明	800	692.00	553,600	
古河電池	1,000	726.00	726,000	
双信電機	700	446.00	312,200	
山一電機	1,000	1,667.00	1,667,000	
図研	900	2,376.00	2,138,400	
日本電子	2,800	2,999.00	8,397,200	
カシオ計算機	12,400	1,753.00	21,737,200	
ファナック	13,200	21,655.00	285,846,000	
日本シイエムケイ	3,400	662.00	2,250,800	
エンプラス	700	3,550.00	2,485,000	
大真空	600	1,151.00	690,600	
ローム	6,200	8,840.00	54,808,000	
浜松ホトニクス	10,000	4,275.00	42,750,000	
三井ハイテック	1,600	1,904.00	3,046,400	
新光電気工業	4,700	1,081.00	5,080,700	
京セラ	19,700	7,226.00	142,352,200	
太陽誘電	6,200	2,970.00	18,414,000	
村田製作所	41,100	6,291.00	258,560,100	

双葉電子工業	2,200	1,438.00	3,163,600	
北陸電気工業	600	1,166.00	699,600	
ニチコン	4,700	1,179.00	5,541,300	
日本ケミコン	1,100	1,750.00	1,925,000	
K O A	2,100	1,437.00	3,017,700	
市光工業	2,200	887.00	1,951,400	
小糸製作所	8,400	5,860.00	49,224,000	
ミツバ	2,700	733.00	1,979,100	
S C R E E Nホールディングス	2,400	7,610.00	18,264,000	
キャノン電子	1,500	2,006.00	3,009,000	
キャノン	75,200	2,980.50	224,133,600	代用有価証券 10,000株
リコー	35,600	1,039.00	36,988,400	
象印マホービン	4,100	1,687.00	6,916,700	
M U T O Hホールディングス	200	1,825.00	365,000	
東京エレクトロン	9,300	22,030.00	204,879,000	
トヨタ紡織	4,000	1,697.00	6,788,000	
芦森工業	300	1,550.00	465,000	
ユニプレス	2,700	1,681.00	4,538,700	
豊田自動織機	11,300	6,570.00	74,241,000	
モリタホールディングス	2,400	1,912.00	4,588,800	
三櫻工業	1,800	1,173.00	2,111,400	
デンソー	30,800	5,054.00	155,663,200	
東海理化電機製作所	3,700	2,155.00	7,973,500	
三井E & Sホールディングス	5,100	899.00	4,584,900	
川崎重工業	10,900	2,564.00	27,947,600	
名村造船所	4,500	306.00	1,377,000	
サノヤスホールディングス	1,900	194.00	368,600	
日本車輛製造	500	2,789.00	1,394,500	
三菱ロジスネクスト	1,900	1,061.00	2,015,900	
近畿車輛	200	1,592.00	318,400	
日産自動車	164,900	703.00	115,924,700	
いすゞ自動車	40,500	1,282.50	51,941,250	
トヨタ自動車	155,700	7,649.00	1,190,949,300	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,400	1,045.00	18,183,000	
三菱自動車工業	51,800	528.00	27,350,400	

エフテック	1,000	781.00	781,000
レシップホールディングス	600	670.00	402,000
G M B	300	802.00	240,600
ファルテック	300	801.00	240,300
武蔵精密工業	3,100	1,619.00	5,018,900
日産車体	2,700	1,035.00	2,794,500
新明和工業	3,800	1,362.00	5,175,600
極東開発工業	2,600	1,503.00	3,907,800
日信工業	2,900	2,227.00	6,458,300
トピー工業	1,100	2,169.00	2,385,900
ティラド	500	2,001.00	1,000,500
タチエス	2,300	1,491.00	3,429,300
N O K	7,500	1,743.00	13,072,500
フタバ産業	3,900	801.00	3,123,900
K Y B	1,600	3,560.00	5,696,000
大同メタル工業	2,800	703.00	1,968,400
プレス工業	7,000	479.00	3,353,000
ミクニ	1,800	363.00	653,400
太平洋工業	2,900	1,560.00	4,524,000
ケーヒン	3,200	2,573.00	8,233,600
河西工業	1,900	929.00	1,765,100
アイシン精機	11,500	4,360.00	50,140,000
マツダ	41,100	1,018.00	41,839,800
今仙電機製作所	1,300	954.00	1,240,200
本田技研工業	110,000	3,031.00	333,410,000
スズキ	27,700	5,157.00	142,848,900
S U B A R U	43,400	3,116.00	135,234,400
安永	700	1,354.00	947,800
ヤマハ発動機	18,200	2,213.00	40,276,600
ショーワ	3,300	2,276.00	7,510,800
T B K	1,800	456.00	820,800
エクセディ	1,900	2,504.00	4,757,600
豊田合成	4,500	2,576.00	11,592,000
愛三工業	2,200	914.00	2,010,800
盟和産業	200	1,133.00	226,600
日本プラスト	1,200	731.00	877,200

ヨロズ	1,300	1,423.00	1,849,900
エフ・シー・シー	2,300	2,458.00	5,653,400
シマノ	5,200	18,150.00	94,380,000
テイ・エス テック	3,300	3,295.00	10,873,500
ジャムコ	700	1,550.00	1,085,000
テルモ	39,600	3,577.00	141,649,200
クリエートメディック	500	1,060.00	530,000
日機装	4,200	1,217.00	5,111,400
日本エム・ディ・エム	800	1,976.00	1,580,800
島津製作所	16,700	3,025.00	50,517,500
JMS	1,200	686.00	823,200
長野計器	1,000	771.00	771,000
ブイ・テクノロジー	600	6,410.00	3,846,000
東京計器	900	963.00	866,700
愛知時計電機	200	4,350.00	870,000
インターアクション	800	2,129.00	1,703,200
オーバル	1,200	259.00	310,800
東京精密	2,500	3,525.00	8,812,500
マニー	5,600	2,925.00	16,380,000
ニコン	22,600	1,436.00	32,453,600
トプコン	7,000	1,480.00	10,360,000
オリンパス	77,400	1,476.00	114,242,400
理研計器	1,200	2,200.00	2,640,000
タムロン	1,100	2,436.00	2,679,600
HOYA	28,100	9,311.00	261,639,100
シード	600	885.00	531,000
ノーリツ鋼機	900	1,635.00	1,471,500
エー・アンド・デイ	1,300	844.00	1,097,200
朝日インテック	11,900	2,998.00	35,676,200
シチズン時計	16,300	605.00	9,861,500
リズム時計工業	400	1,006.00	402,400
大研医器	1,000	545.00	545,000
メニコン	1,900	3,790.00	7,201,000
シンシア	200	615.00	123,000
松風	600	1,772.00	1,063,200
セイコーホールディングス	2,000	2,734.00	5,468,000

ニプロ	9,700	1,275.00	12,367,500
中本パックス	400	1,490.00	596,000
スノーピーク	600	1,078.00	646,800
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,185.00	6,277,500
トランザクション	900	941.00	846,900
S H O - B I	400	391.00	156,400
ニホンフラッシュ	700	2,445.00	1,711,500
前田工織	1,500	1,814.00	2,721,000
永大産業	1,800	362.00	651,600
アートネイチャー	1,500	768.00	1,152,000
バンダイナムコホールディングス	14,400	6,753.00	97,243,200
アイフィスジャパン	300	778.00	233,400
共立印刷	2,400	169.00	405,600
S H O E I	700	4,930.00	3,451,000
フランスベッドホールディングス	2,000	1,024.00	2,048,000
パイロットコーポレーション	2,400	4,350.00	10,440,000
萩原工業	800	1,629.00	1,303,200
トッパン・フォームズ	3,000	1,096.00	3,288,000
フジシールインターナショナル	3,100	2,766.00	8,574,600
タカラトミー	6,200	1,190.00	7,378,000
廣済堂	1,000	720.00	720,000
エステールホールディングス	300	654.00	196,200
アーク	5,400	96.00	518,400
タカノ	500	824.00	412,000
プロネクサス	1,200	1,255.00	1,506,000
ホクシン	800	173.00	138,400
ウッドワン	500	1,164.00	582,000
大建工業	900	1,990.00	1,791,000
凸版印刷	19,700	2,057.00	40,522,900
大日本印刷	18,300	2,994.00	54,790,200
共同印刷	400	2,791.00	1,116,400
N I S S H A	2,800	1,216.00	3,404,800
光村印刷	100	1,888.00	188,800
宝印刷	700	1,760.00	1,232,000
アシックス	11,500	1,661.00	19,101,500
ツツミ	400	2,079.00	831,600

小松ウオール工業	400	2,251.00	900,400	
ヤマハ	8,300	5,800.00	48,140,000	
河合楽器製作所	400	3,150.00	1,260,000	
クリナップ	1,300	658.00	855,400	
ピジョン	8,400	5,290.00	44,436,000	
兼松サステック	100	1,797.00	179,700	
キングジム	1,100	876.00	963,600	
リンテック	3,300	2,341.00	7,725,300	
イトーキ	2,900	490.00	1,421,000	
任天堂	8,600	42,210.00	363,006,000	
三菱鉛筆	2,300	1,764.00	4,057,200	
タカラスタANDARD	2,900	1,973.00	5,721,700	
コクヨ	6,700	1,615.00	10,820,500	
ナカバヤシ	1,400	576.00	806,400	
グローブライド	600	2,750.00	1,650,000	
オカムラ	4,900	1,053.00	5,159,700	
美津濃	1,300	2,795.00	3,633,500	
東京電力ホールディングス	111,500	516.00	57,534,000	
中部電力	42,800	1,605.00	68,694,000	
関西電力	53,000	1,270.50	67,336,500	
中国電力	19,300	1,487.00	28,699,100	
北陸電力	12,800	813.00	10,406,400	
東北電力	34,900	1,151.00	40,169,900	
四国電力	12,600	1,148.00	14,464,800	
九州電力	28,800	993.00	28,598,400	
北海道電力	13,100	573.00	7,506,300	
沖縄電力	2,600	2,034.00	5,288,400	
電源開発	11,100	2,665.00	29,581,500	
エフオン	700	759.00	531,300	
イーレックス	2,000	1,525.00	3,050,000	
レノバ	2,300	1,092.00	2,511,600	
東京瓦斯	26,900	2,591.50	69,711,350	
大阪瓦斯	27,100	2,135.00	57,858,500	
東邦瓦斯	6,900	4,255.00	29,359,500	
北海道瓦斯	700	1,623.00	1,136,100	
広島ガス	2,800	363.00	1,016,400	

西部瓦斯	1,600	2,608.00	4,172,800
静岡ガス	4,000	965.00	3,860,000
メタウォーター	700	4,015.00	2,810,500
SBSホールディングス	1,200	1,855.00	2,226,000
東武鉄道	14,700	3,920.00	57,624,000
相鉄ホールディングス	4,500	2,988.00	13,446,000
東急	35,300	2,101.00	74,165,300
京浜急行電鉄	18,000	2,190.00	39,420,000
小田急電鉄	20,800	2,727.00	56,721,600
京王電鉄	7,200	6,960.00	50,112,000
京成電鉄	9,700	4,605.00	44,668,500
富士急行	1,900	4,385.00	8,331,500
東日本旅客鉄道	24,600	10,010.00	246,246,000
西日本旅客鉄道	12,500	9,671.00	120,887,500
東海旅客鉄道	11,600	22,695.00	263,262,000
西武ホールディングス	18,700	1,925.00	35,997,500
鴻池運輸	2,200	1,669.00	3,671,800
西日本鉄道	3,900	2,620.00	10,218,000
ハマキョウレックス	1,100	3,725.00	4,097,500
サカイ引越センター	700	6,430.00	4,501,000
近鉄グループホールディングス	13,200	6,050.00	79,860,000
阪急阪神ホールディングス	17,700	4,570.00	80,889,000
南海電気鉄道	6,300	3,010.00	18,963,000
京阪ホールディングス	5,900	5,340.00	31,506,000
神戸電鉄	300	3,960.00	1,188,000
名古屋鉄道	10,900	3,465.00	37,768,500
山陽電気鉄道	1,000	2,224.00	2,224,000
日本通運	4,600	6,670.00	30,682,000
ヤマトホールディングス	23,100	1,817.00	41,972,700
山九	3,700	5,940.00	21,978,000
丸運	800	279.00	223,200
丸全昭和運輸	1,100	3,140.00	3,454,000
センコーグループホールディングス	7,300	884.00	6,453,200
トナミホールディングス	300	5,170.00	1,551,000
ニッコンホールディングス	4,700	2,713.00	12,751,100
日本石油輸送	100	2,839.00	283,900

福山通運	1,700	4,070.00	6,919,000
セイノーホールディングス	9,900	1,428.00	14,137,200
エスライン	400	983.00	393,200
神奈川中央交通	300	3,980.00	1,194,000
日立物流	2,400	3,145.00	7,548,000
丸和運輸機関	1,400	2,339.00	3,274,600
C & F ロジホールディングス	1,400	1,455.00	2,037,000
九州旅客鉄道	11,800	3,815.00	45,017,000
S Gホールディングス	13,800	2,700.00	37,260,000
日本郵船	11,100	2,049.00	22,743,900
商船三井	8,400	3,075.00	25,830,000
川崎汽船	4,100	1,741.00	7,138,100
N S ユナイテッド海運	700	2,433.00	1,703,100
明治海運	1,400	347.00	485,800
飯野海運	6,300	371.00	2,337,300
共栄タンカー	100	1,534.00	153,400
乾汽船	800	1,154.00	923,200
日本航空	24,200	3,411.00	82,546,200
A N A ホールディングス	24,200	3,755.00	90,871,000
パスコ	200	1,157.00	231,400
ランコム	400	7,000.00	2,800,000
日新	1,200	1,759.00	2,110,800
三菱倉庫	4,100	2,883.00	11,820,300
三井倉庫ホールディングス	1,500	1,935.00	2,902,500
住友倉庫	4,900	1,513.00	7,413,700
澁澤倉庫	700	2,110.00	1,477,000
東陽倉庫	2,400	336.00	806,400
日本トランスシティ	2,900	564.00	1,635,600
ケイヒン	300	1,341.00	402,300
中央倉庫	800	1,256.00	1,004,800
川西倉庫	200	1,144.00	228,800
安田倉庫	1,100	978.00	1,075,800
ファイズホールディングス	300	685.00	205,500
東洋埠頭	400	1,422.00	568,800
宇徳	1,100	544.00	598,400
上組	7,600	2,471.00	18,779,600

サンリツ	300	697.00	209,100	
キムラユニティー	400	1,110.00	444,000	
キューソー流通システム	300	1,985.00	595,500	
近鉄エクスプレス	2,800	1,869.00	5,233,200	
東海運	700	288.00	201,600	
エーアイティー	900	951.00	855,900	
内外トランスライン	400	1,499.00	599,600	
日本コンセプト	400	1,445.00	578,000	
NEC ネットズエスアイ	1,300	3,450.00	4,485,000	
クロスキャット	400	1,035.00	414,000	
システナ	4,900	1,508.00	7,389,200	
デジタルアーツ	700	6,030.00	4,221,000	
日鉄ソリューションズ	2,100	3,525.00	7,402,500	
キューブシステム	700	792.00	554,400	
エイジア	200	1,312.00	262,400	
コア	600	1,389.00	833,400	
ソリトンシステムズ	600	975.00	585,000	
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,797.00	1,078,200	
T I S	4,600	6,250.00	28,750,000	
ネオス	600	794.00	476,400	
電算システム	500	2,940.00	1,470,000	
グリー	9,500	527.00	5,006,500	
コーエーテクモホールディングス	2,800	2,511.00	7,030,800	
三菱総合研究所	600	3,715.00	2,229,000	
ボルテージ	300	555.00	166,500	
電算	200	2,160.00	432,000	
A G S	800	777.00	621,600	
ファインデックス	1,200	1,001.00	1,201,200	
ブレインパッド	300	5,420.00	1,626,000	
K L a b	2,600	925.00	2,405,000	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,700	1,037.00	1,762,900	
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,795.00	359,000	
ネクソン	39,000	1,287.00	50,193,000	
アイスタイル	3,500	822.00	2,877,000	
エムアップ	400	1,951.00	780,400	

エイチーム	900	1,050.00	945,000
エニグモ	1,000	933.00	933,000
テクノスジャパン	1,100	481.00	529,100
e n i s h	600	640.00	384,000
コロブラ	4,500	1,323.00	5,953,500
ブロードリーフ	6,700	596.00	3,993,200
クロス・マーケティンググループ	600	370.00	222,000
デジタルハーツホールディングス	700	870.00	609,000
システム情報	700	980.00	686,000
メディアドゥホールディングス	400	3,340.00	1,336,000
じげん	3,500	601.00	2,103,500
ブイキューブ	900	461.00	414,900
エンカレッジ・テクノロジー	200	775.00	155,000
サイバーリンクス	200	1,207.00	241,400
フィックスターズ	1,500	1,558.00	2,337,000
CARTA HOLDINGS	700	1,216.00	851,200
オブティム	400	2,648.00	1,059,200
セレス	400	1,223.00	489,200
ティーガイア	1,200	2,709.00	3,250,800
セック	200	3,205.00	641,000
日本アジアグループ	1,500	384.00	576,000
豆蔵ホールディングス	1,000	1,730.00	1,730,000
テクマトリックス	1,000	2,275.00	2,275,000
プロシップ	400	1,297.00	518,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,300	2,383.00	7,863,900
GMOペイメントゲートウェイ	2,300	7,860.00	18,078,000
ザッパラス	700	391.00	273,700
システムリサーチ	400	1,938.00	775,200
インターネットイニシアティブ	2,000	2,564.00	5,128,000
さくらインターネット	1,500	626.00	939,000
ヴィンクス	400	1,195.00	478,000
GMOクラウド	300	2,695.00	808,500
SRAホールディングス	700	2,652.00	1,856,400
Minor iソリューションズ	300	2,695.00	808,500
システムインテグレータ	500	767.00	383,500
朝日ネット	1,000	659.00	659,000

e B A S E	800	1,201.00	960,800
アバント	500	2,177.00	1,088,500
アドソル日進	500	2,256.00	1,128,000
フリービット	800	864.00	691,200
コムチュア	1,500	2,054.00	3,081,000
サイバーコム	300	1,946.00	583,800
アステリア	900	668.00	601,200
アイル	400	1,219.00	487,600
マークラインズ	700	2,097.00	1,467,900
メディカル・データ・ビジョン	1,100	1,137.00	1,250,700
g u m i	1,800	730.00	1,314,000
ショーケース	300	697.00	209,100
モバイルファクトリー	300	1,406.00	421,800
テラスカイ	500	2,152.00	1,076,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,613.00	967,800
P C Iホールディングス	300	2,124.00	637,200
パイプドHD	200	1,677.00	335,400
アイビーシー	200	1,070.00	214,000
ネオジャパン	300	989.00	296,700
P R T I M E S	100	2,484.00	248,400
ランドコンピュータ	200	1,141.00	228,200
ダブルスタンダード	200	5,390.00	1,078,000
オープンドア	700	1,972.00	1,380,400
マイネット	400	528.00	211,200
アカツキ	500	5,980.00	2,990,000
ベネフィットジャパン	100	1,676.00	167,600
U b i c o mホールディングス	300	1,438.00	431,400
L I N E	3,100	4,140.00	12,834,000
カナミックネットワーク	900	614.00	552,600
ノムラシステムコーポレーション	300	595.00	178,500
チェンジ	300	2,041.00	612,300
シンクロ・フード	600	503.00	301,800
オークネット	900	1,483.00	1,334,700
エイトレッド	200	1,411.00	282,200
A O I T Y O H o l d i n g s	1,400	668.00	935,200

マクロミル	2,500	984.00	2,460,000
ビーグリー	300	984.00	295,200
オロ	400	2,886.00	1,154,400
テモナ	200	501.00	100,200
サインポスト	200	1,906.00	381,200
ソルクシーズ	600	902.00	541,200
フェイス	500	751.00	375,500
プロトコーポレーション	1,200	1,179.00	1,414,800
ハイマックス	200	1,956.00	391,200
野村総合研究所	22,900	2,294.00	52,532,600
サイバネットシステム	1,000	733.00	733,000
C Eホールディングス	800	467.00	373,600
日本システム技術	200	1,323.00	264,600
インテージホールディングス	1,800	988.00	1,778,400
東邦システムサイエンス	400	964.00	385,600
ソースネクスト	6,500	486.00	3,159,000
インフォコム	1,500	2,225.00	3,337,500
ラクスル	700	3,590.00	2,513,000
F I G	1,600	328.00	524,800
システムサポート	100	1,352.00	135,200
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,498.00	2,247,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,701.00	510,300
フォーカスシステムズ	900	895.00	805,500
クレスコ	400	3,390.00	1,356,000
フジ・メディア・ホールディングス	13,200	1,457.00	19,232,400
オービック	4,700	13,610.00	63,967,000
ジャストシステム	2,200	4,575.00	10,065,000
T D Cソフト	1,200	868.00	1,041,600
Zホールディングス	188,300	365.00	68,729,500
トレンドマイクロ	6,100	5,310.00	32,391,000
I Dホールディングス	500	1,390.00	695,000
日本オラクル	2,800	9,360.00	26,208,000
アルファシステムズ	400	2,841.00	1,136,400
フューチャー	1,600	1,777.00	2,843,200
C A C Holdings	900	1,405.00	1,264,500

S Bテクノロジー	500	2,002.00	1,001,000	
トーセ	400	881.00	352,400	
オービックビジネスコンサルタント	1,400	4,420.00	6,188,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,300	2,858.00	18,005,400	
アイティフォー	1,700	877.00	1,490,900	
東計電算	200	3,370.00	674,000	
エクスネット	200	986.00	197,200	
大塚商会	7,400	4,110.00	30,414,000	
サイボウズ	1,600	1,096.00	1,753,600	
ソフトブレーン	800	553.00	442,400	
電通国際情報サービス	800	3,680.00	2,944,000	
デジタルガレージ	2,500	3,515.00	8,787,500	
E Mシステムズ	1,000	2,080.00	2,080,000	
ウェザーニューズ	500	3,450.00	1,725,000	
C I J	1,000	956.00	956,000	
ビジネスエンジニアリング	200	3,370.00	674,000	
日本エンタープライズ	1,400	227.00	317,800	
WOWOW	700	2,638.00	1,846,600	
スカラ	1,000	852.00	852,000	
インテリジェント ウェイブ	500	747.00	373,500	
I M A G I C A G R O U P	1,200	647.00	776,400	
ネットワンシステムズ	5,200	2,812.00	14,622,400	
システムソフト	3,500	115.00	402,500	
アルゴグラフィックス	1,200	2,959.00	3,550,800	
マーベラス	2,100	809.00	1,698,900	
エイベックス	2,300	1,368.00	3,146,400	
日本ユニシス	4,200	3,430.00	14,406,000	
兼松エレクトロニクス	700	3,330.00	2,331,000	
東京放送ホールディングス	8,300	1,772.00	14,707,600	
日本テレビホールディングス	11,400	1,420.00	16,188,000	
朝日放送グループホールディングス	1,400	754.00	1,055,600	
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,728.00	6,566,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	9,000	456.00	4,104,000	
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,274.00	2,501,400	
日本BS放送	500	1,085.00	542,500	
ビジョン	1,300	1,564.00	2,033,200	

スマートバリュー	400	785.00	314,000
USEN-NEXT HOLDINGS	500	1,022.00	511,000
コネクシオ	800	1,516.00	1,212,800
クロップス	300	724.00	217,200
日本電信電話	91,600	5,369.00	491,800,400
KDDI	102,200	3,195.00	326,529,000
ソフトバンク	124,600	1,505.50	187,585,300
光通信	1,400	24,170.00	33,838,000
NTTドコモ	101,300	2,996.00	303,494,800
エムティーアイ	1,300	715.00	929,500
GMOインターネット	5,400	1,890.00	10,206,000
アйдママーケティングコミュニケーション	400	758.00	303,200
KADOKAWA	3,700	1,492.00	5,520,400
学研ホールディングス	500	5,750.00	2,875,000
ゼンリン	2,700	1,973.00	5,327,100
昭文社	600	418.00	250,800
インプレスホールディングス	1,200	163.00	195,600
アイネット	700	1,317.00	921,900
松竹	900	15,960.00	14,364,000
東宝	8,200	4,320.00	35,424,000
東映	500	15,010.00	7,505,000
エヌ・ティ・ティ・データ	36,500	1,468.00	53,582,000
ピー・シー・エー	200	3,545.00	709,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,621.00	524,200
DTS	3,100	2,258.00	6,999,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,900	4,880.00	28,792,000
シーイーシー	1,500	1,937.00	2,905,500
カブコン	6,500	2,538.00	16,497,000
アイ・エス・ビー	300	1,835.00	550,500
ジャステック	900	1,155.00	1,039,500
SCSK	3,200	5,520.00	17,664,000
日本システムウエア	500	2,539.00	1,269,500
アイネス	1,400	1,242.00	1,738,800
TKC	1,200	4,645.00	5,574,000
富士ソフト	1,800	4,755.00	8,559,000
NSD	2,300	3,370.00	7,751,000

コナミホールディングス	5,000	4,710.00	23,550,000	
福井コンピュータホールディングス	500	3,105.00	1,552,500	
J B C Cホールディングス	900	1,719.00	1,547,100	
ミロク情報サービス	1,200	2,887.00	3,464,400	
ソフトバンクグループ	108,800	4,322.00	470,233,600	
ハウスイ	200	863.00	172,600	
高千穂交易	600	1,123.00	673,800	
伊藤忠食品	400	5,250.00	2,100,000	
エレマテック	1,300	1,080.00	1,404,000	
J A L U X	400	2,593.00	1,037,200	
あらた	1,100	4,100.00	4,510,000	
トーメンデバイス	200	2,716.00	543,200	
東京エレクトロン デバイス	500	2,085.00	1,042,500	
フィールズ	1,100	538.00	591,800	
双日	76,100	351.00	26,711,100	
アルフレッサ ホールディングス	15,200	2,493.00	37,893,600	
横浜冷凍	3,900	1,093.00	4,262,700	
神栄	200	767.00	153,400	
ラサ商事	800	880.00	704,000	
ラクーンホールディングス	700	666.00	466,200	
アルコニックス	1,500	1,373.00	2,059,500	
神戸物産	4,800	3,085.00	14,808,000	
あい ホールディングス	2,000	1,964.00	3,928,000	
ディーブイエックス	500	933.00	466,500	
ダイワボウホールディングス	1,200	4,820.00	5,784,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,300	1,803.00	5,949,900	
ラクト・ジャパン	500	3,510.00	1,755,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,098.00	2,854,800	
八洲電機	1,100	907.00	997,700	
メディアスホールディングス	800	808.00	646,400	
レスターホールディングス	1,400	1,891.00	2,647,400	
ジューテックホールディングス	400	1,087.00	434,800	
大光	700	739.00	517,300	
O C H Iホールディングス	400	1,395.00	558,000	
T O K A Iホールディングス	7,300	1,090.00	7,957,000	
黒谷	400	462.00	184,800	

C o m i n i x	300	823.00	246,900	
三洋貿易	700	2,264.00	1,584,800	
ビューティガレージ	300	1,600.00	480,000	
ウイン・パートナーズ	1,000	1,490.00	1,490,000	
ミタチ産業	400	771.00	308,400	
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,580.00	10,076,000	
明治電機工業	500	1,549.00	774,500	
デリカフーズホールディングス	600	693.00	415,800	
スターティアホールディングス	400	627.00	250,800	
コメダホールディングス	3,000	2,075.00	6,225,000	
アセンテック	100	1,801.00	180,100	
富士興産	500	718.00	359,000	
協栄産業	200	1,529.00	305,800	
小野建	1,300	1,431.00	1,860,300	
南陽	300	1,795.00	538,500	
佐島電機	1,000	938.00	938,000	
エコートレーディング	400	536.00	214,400	
伯東	900	1,374.00	1,236,600	
コンドーテック	1,100	993.00	1,092,300	
中山福	900	564.00	507,600	
ナガイレーベン	2,000	2,581.00	5,162,000	
三菱食品	1,500	2,798.00	4,197,000	
松田産業	1,000	1,624.00	1,624,000	
第一興商	2,100	5,180.00	10,878,000	
メディバルホールディングス	14,900	2,490.00	37,101,000	
S P K	300	2,755.00	826,500	
萩原電気ホールディングス	500	2,924.00	1,462,000	
アズワン	900	9,260.00	8,334,000	
スズデン	500	1,403.00	701,500	
シモジマ	900	1,264.00	1,137,600	
ドウシシャ	1,300	1,760.00	2,288,000	
小津産業	300	1,866.00	559,800	
高速	800	1,340.00	1,072,000	
たけびし	500	1,445.00	722,500	
リックス	300	1,631.00	489,300	
丸文	1,300	633.00	822,900	

ハビネット	1,200	1,374.00	1,648,800
橋本総業ホールディングス	300	1,735.00	520,500
日本ライフライン	4,000	1,511.00	6,044,000
タカショー	700	482.00	337,400
エクセル	400	1,270.00	508,000
マルカ	500	2,349.00	1,174,500
I D O M	3,800	467.00	1,774,600
進和	800	2,494.00	1,995,200
エスケイジャパン	400	458.00	183,200
ダイトロン	600	1,564.00	938,400
シークス	1,800	1,642.00	2,955,600
田中商事	500	682.00	341,000
オーハシテクニカ	800	1,535.00	1,228,000
白銅	500	1,413.00	706,500
伊藤忠商事	93,300	2,304.50	215,009,850
丸紅	143,400	784.80	112,540,320
高島	200	1,748.00	349,600
長瀬産業	7,700	1,636.00	12,597,200
蝶理	900	1,914.00	1,722,600
豊田通商	15,400	3,720.00	57,288,000
三共生興	2,200	591.00	1,300,200
兼松	5,200	1,382.00	7,186,400
ツカモトコーポレーション	300	1,088.00	326,400
三井物産	121,000	1,890.50	228,750,500
日本紙パルプ商事	800	4,170.00	3,336,000
日立ハイテクノロジーズ	4,700	6,750.00	31,725,000
カメイ	1,900	1,255.00	2,384,500
東都水産	200	2,607.00	521,400
O U G ホールディングス	200	2,838.00	567,600
スターゼン	500	4,530.00	2,265,000
山善	5,400	1,025.00	5,535,000
椿本興業	300	4,210.00	1,263,000
住友商事	86,900	1,656.00	143,906,400
内田洋行	600	4,150.00	2,490,000
三菱商事	96,600	2,840.00	274,344,000
第一実業	700	3,635.00	2,544,500

キヤノンマーケティングジャパン	4,000	2,342.00	9,368,000	
西華産業	800	1,421.00	1,136,800	
佐藤商事	1,200	912.00	1,094,400	
菱洋エレクトロ	1,400	1,950.00	2,730,000	
東京産業	1,300	568.00	738,400	
ユアサ商事	1,300	3,570.00	4,641,000	
神鋼商事	400	2,619.00	1,047,600	
小林産業	900	320.00	288,000	
阪和興業	2,600	3,225.00	8,385,000	
正栄食品工業	900	3,270.00	2,943,000	
カナデン	1,100	1,377.00	1,514,700	
菱電商事	1,000	1,685.00	1,685,000	
フルサト工業	800	1,636.00	1,308,800	
岩谷産業	3,100	3,710.00	11,501,000	
すてきナイスグループ	600	946.00	567,600	
昭光通商	500	653.00	326,500	
二チモウ	200	1,926.00	385,200	
極東貿易	400	2,130.00	852,000	
イワキ	1,900	466.00	885,400	
三愛石油	3,400	1,178.00	4,005,200	
稲畑産業	3,100	1,458.00	4,519,800	
G S Iクレオス	400	1,161.00	464,400	
明和産業	1,400	575.00	805,000	
クワザワ	500	615.00	307,500	
ワキタ	3,000	1,133.00	3,399,000	
東邦ホールディングス	4,400	2,805.00	12,342,000	
サンゲツ	3,800	2,127.00	8,082,600	
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,176.00	2,469,600	
シナネンホールディングス	600	2,011.00	1,206,600	
伊藤忠エネクス	3,100	907.00	2,811,700	
サンリオ	3,800	2,147.00	8,158,600	
サンワテクノス	1,000	1,157.00	1,157,000	
リョーサン	1,500	2,925.00	4,387,500	
新光商事	2,100	913.00	1,917,300	
トーホー	600	1,805.00	1,083,000	
三信電気	800	1,595.00	1,276,000	

東陽テクニカ	1,600	1,216.00	1,945,600
モスフードサービス	1,800	2,812.00	5,061,600
加賀電子	1,400	2,205.00	3,087,000
ソーダニッカ	1,500	648.00	972,000
立花エレテック	1,100	1,780.00	1,958,000
フォーバル	600	999.00	599,400
PALTA C	2,200	5,290.00	11,638,000
三谷産業	1,900	342.00	649,800
太平洋興発	600	849.00	509,400
西本Wismettacホールディングス	300	3,755.00	1,126,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,428.00	142,800
国際紙パルプ商事	3,300	327.00	1,079,100
ヤマタネ	700	1,438.00	1,006,600
丸紅建材リース	100	1,843.00	184,300
日鉄物産	1,000	4,655.00	4,655,000
泉州電業	400	2,874.00	1,149,600
トラスコ中山	2,800	2,706.00	7,576,800
オートバックスセブン	5,100	1,830.00	9,333,000
モリト	1,100	810.00	891,000
加藤産業	2,200	3,610.00	7,942,000
北恵	300	1,083.00	324,900
イノテック	900	959.00	863,100
イエローハット	2,600	1,936.00	5,033,600
J Kホールディングス	1,300	604.00	785,200
日伝	1,300	2,101.00	2,731,300
北沢産業	1,100	276.00	303,600
杉本商事	800	2,017.00	1,613,600
因幡電機産業	2,000	5,110.00	10,220,000
東テク	500	2,478.00	1,239,000
ミスミグループ本社	17,300	2,750.00	47,575,000
アルテック	1,200	241.00	289,200
タキヒヨー	400	1,937.00	774,800
蔵王産業	300	1,471.00	441,300
スズケン	5,800	5,920.00	34,336,000
ジェコス	1,000	951.00	951,000
グローセル	1,400	449.00	628,600

ローソン	3,400	6,100.00	20,740,000
サンエー	1,100	5,260.00	5,786,000
カワチ薬品	1,100	2,316.00	2,547,600
エービーシー・マート	2,200	7,520.00	16,544,000
ハードオフコーポレーション	600	819.00	491,400
アスクル	1,400	2,867.00	4,013,800
ゲオホールディングス	2,500	1,372.00	3,430,000
アダストリア	1,900	2,702.00	5,133,800
ジーフット	900	627.00	564,300
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	668.00	133,600
くら寿司	700	4,560.00	3,192,000
キャンドウ	700	1,607.00	1,124,900
パルグループホールディングス	700	3,545.00	2,481,500
エディオン	6,300	1,191.00	7,503,300
サーラコーポレーション	2,900	651.00	1,887,900
ワッツ	700	619.00	433,300
ハローズ	500	2,669.00	1,334,500
フジオフードシステム	600	3,075.00	1,845,000
あみやき亭	300	3,480.00	1,044,000
ひらまつ	2,600	322.00	837,200
大黒天物産	300	3,420.00	1,026,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,365.00	1,774,500
ファーマライズホールディングス	400	654.00	261,600
アルペン	1,000	1,769.00	1,769,000
ハブ	400	1,046.00	418,400
クオールホールディングス	2,000	1,564.00	3,128,000
ジズホールディングス	700	6,830.00	4,781,000
ビックカメラ	8,200	1,217.00	9,979,400
DCMホールディングス	7,400	1,090.00	8,066,000
ペッパーフードサービス	1,100	1,651.00	1,816,100
MonotaRO	9,800	3,125.00	30,625,000
東京一番フーズ	400	627.00	250,800
DDホールディングス	600	1,567.00	940,200
きちりホールディングス	400	825.00	330,000
アークランドサービスホールディングス	1,000	1,953.00	1,953,000
J.フロント リテイリング	16,400	1,431.00	23,468,400

ドトール・日レスホールディングス	2,200	2,146.00	4,721,200
マツモトキヨシホールディングス	5,700	4,015.00	22,885,500
ブロンコビリー	700	2,674.00	1,871,800
Z O Z O	13,500	2,562.00	34,587,000
トレジャー・ファクトリー	400	1,191.00	476,400
物語コーポレーション	300	9,270.00	2,781,000
ココカラファイン	1,400	6,450.00	9,030,000
三越伊勢丹ホールディングス	24,000	926.00	22,224,000
H a m e e	500	1,236.00	618,000
ウエルシアホールディングス	4,100	6,400.00	26,240,000
クリエイトSDホールディングス	2,000	2,794.00	5,588,000
丸善CHIホールディングス	1,600	377.00	603,200
ミサワ	300	801.00	240,300
ティーライフ	200	861.00	172,200
エー・ピーカンパニー	300	568.00	170,400
チムニー	400	2,432.00	972,800
シュッピン	1,000	955.00	955,000
ネクステージ	2,000	1,107.00	2,214,000
ジョイフル本田	4,000	1,469.00	5,876,000
鳥貴族	500	2,015.00	1,007,500
麒麟堂ホールディングス	600	2,168.00	1,300,800
ホットランド	900	1,214.00	1,092,600
すかいらーくホールディングス	15,400	1,990.00	30,646,000
S F Pホールディングス	600	2,280.00	1,368,000
綿半ホールディングス	500	2,115.00	1,057,500
ヨシックス	200	2,942.00	588,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,000	987.00	3,948,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	701.00	490,700
B E E N O S	500	1,331.00	665,500
あさひ	1,000	1,223.00	1,223,000
日本調剤	400	3,915.00	1,566,000
コスモス薬品	600	22,770.00	13,662,000
トーエル	700	803.00	562,100
オンリー	300	807.00	242,100
セブン&アイ・ホールディングス	53,900	4,174.00	224,978,600

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,700	1,812.00	6,704,400
ツルハホールディングス	3,000	12,530.00	37,590,000
サンマルクホールディングス	1,100	2,424.00	2,666,400
フェリシモ	300	1,049.00	314,700
トリドールホールディングス	1,700	2,477.00	4,210,900
T O K Y O B A S E	1,300	763.00	991,900
ウイルプラスホールディングス	300	831.00	249,300
ジャパンミート	700	2,300.00	1,610,000
サツドラホールディングス	200	1,780.00	356,000
デファクトスタンダード	200	328.00	65,600
アレンザホールディングス	700	836.00	585,200
串カツ田中ホールディングス	200	2,378.00	475,600
パロックジャパンリミテッド	1,000	927.00	927,000
クスリのアオキホールディングス	1,400	8,240.00	11,536,000
力の源ホールディングス	600	875.00	525,000
スシローグローバルホールディングス	1,500	7,590.00	11,385,000
L I X I L ビバ	1,300	2,037.00	2,648,100
メディカルシステムネットワーク	1,400	548.00	767,200
はるやまホールディングス	700	845.00	591,500
ノジマ	2,500	2,281.00	5,702,500
カッパ・クリエイト	1,900	1,473.00	2,798,700
ライトオン	1,000	568.00	568,000
ジーンズメイト	500	337.00	168,500
良品計画	18,300	2,540.00	46,482,000
三城ホールディングス	1,600	288.00	460,800
アドヴァン	2,100	1,243.00	2,610,300
アルピス	500	2,342.00	1,171,000
コナカ	1,600	428.00	684,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,669.00	333,800
G - 7ホールディングス	400	3,985.00	1,594,000
イオン北海道	1,400	804.00	1,125,600
コジマ	2,400	438.00	1,051,200
ヒマラヤ	500	845.00	422,500
コーナン商事	2,000	2,610.00	5,220,000
エコス	500	1,691.00	845,500

ワタミ	1,700	1,412.00	2,400,400
マルシェ	400	778.00	311,200
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	33,000	1,687.00	55,671,000
西松屋チェーン	3,000	962.00	2,886,000
ゼンショーホールディングス	6,600	2,296.00	15,153,600
幸楽苑ホールディングス	900	2,008.00	1,807,200
ハークスレイ	300	1,057.00	317,100
サイゼリヤ	2,300	2,462.00	5,662,600
V Tホールディングス	5,700	490.00	2,793,000
魚力	400	1,527.00	610,800
ポブラ	400	521.00	208,400
フジ・コーポレーション	400	2,224.00	889,600
ユナイテッドアローズ	1,500	3,375.00	5,062,500
ハイデイ日高	2,000	2,163.00	4,326,000
京都きもの友禅	900	364.00	327,600
コロワイド	4,600	2,133.00	9,811,800
ピーシーデポコーポレーション	1,900	492.00	934,800
壱番屋	1,000	5,100.00	5,100,000
P L A N T	400	686.00	274,400
スギホールディングス	2,800	6,090.00	17,052,000
薬王堂ホールディングス	600	2,675.00	1,605,000
ヴィア・ホールディングス	1,700	680.00	1,156,000
スクロール	2,200	342.00	752,400
ヨンドシーホールディングス	1,400	2,638.00	3,693,200
ファミリーマート	10,900	2,766.00	30,149,400
木曽路	1,800	2,767.00	4,980,600
S R Sホールディングス	1,700	1,051.00	1,786,700
千趣会	2,600	364.00	946,400
タカキュー	1,200	200.00	240,000
ケーヨー	2,800	547.00	1,531,600
上新電機	1,600	2,291.00	3,665,600
日本瓦斯	2,200	3,140.00	6,908,000
ロイヤルホールディングス	2,400	2,530.00	6,072,000
東天紅	100	1,295.00	129,500
いなげや	1,700	1,481.00	2,517,700

島忠	2,900	3,040.00	8,816,000
チヨダ	1,500	1,605.00	2,407,500
ライフコーポレーション	1,100	2,523.00	2,775,300
リンガーハット	1,700	2,433.00	4,136,100
MrMaxHD	1,900	493.00	936,700
テンアライド	1,300	445.00	578,500
AOKIホールディングス	2,800	1,153.00	3,228,400
オークワ	2,200	1,418.00	3,119,600
コメリ	2,100	2,379.00	4,995,900
青山商事	2,800	1,970.00	5,516,000
しまむら	1,600	9,430.00	15,088,000
はせがわ	700	407.00	284,900
高島屋	10,000	1,313.00	13,130,000
松屋	2,800	869.00	2,433,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,500	1,261.00	8,196,500
近鉄百貨店	500	3,445.00	1,722,500
パルコ	1,400	1,325.00	1,855,000
丸井グループ	12,500	2,493.00	31,162,500
アクシアル リテイリング	1,100	4,105.00	4,515,500
イオン	53,000	2,236.00	118,508,000
イズミ	2,800	4,245.00	11,886,000
平和堂	2,800	2,112.00	5,913,600
フジ	1,700	2,005.00	3,408,500
ヤオコー	1,600	5,200.00	8,320,000
ゼビオホールディングス	1,700	1,239.00	2,106,300
ケーズホールディングス	13,300	1,243.00	16,531,900
Olympicグループ	800	612.00	489,600
日産東京販売ホールディングス	2,000	308.00	616,000
Genky DrugStores	700	2,491.00	1,743,700
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,231.00	246,200
総合メディカルホールディングス	1,200	1,926.00	2,311,200
ブックオフグループホールディングス	800	1,150.00	920,000
アインホールディングス	1,900	6,500.00	12,350,000
元気寿司	400	3,010.00	1,204,000
ヤマダ電機	41,900	533.00	22,332,700
アークランドサカモト	2,200	1,329.00	2,923,800

ニトリホールディングス	6,000	16,745.00	100,470,000	
愛眼	1,100	257.00	282,700	
ケーユーホールディングス	700	927.00	648,900	
吉野家ホールディングス	4,500	2,561.00	11,524,500	
松屋フーズホールディングス	700	4,080.00	2,856,000	
サガミホールディングス	1,800	1,388.00	2,498,400	
関西スーパーマーケット	1,200	1,055.00	1,266,000	
王将フードサービス	1,000	6,450.00	6,450,000	
プレナス	1,500	1,865.00	2,797,500	
ミニストップ	1,000	1,486.00	1,486,000	
アークス	2,700	2,342.00	6,323,400	
パローホールディングス	3,100	1,949.00	6,041,900	
藤久	100	800.00	80,000	
ベルク	700	5,260.00	3,682,000	
大庄	700	1,590.00	1,113,000	
ファーストリテイリング	1,800	68,660.00	123,588,000	
サンドラッグ	5,200	3,725.00	19,370,000	
サックスパー ホールディングス	1,200	929.00	1,114,800	
ヤマザワ	300	1,705.00	511,500	
やまや	300	2,158.00	647,400	
ペルーナ	3,000	745.00	2,235,000	
島根銀行	300	720.00	216,000	
じもとホールディングス	9,200	107.00	984,400	
めぶきフィナンシャルグループ	71,600	284.00	20,334,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,900	1,563.00	2,969,700	
九州フィナンシャルグループ	22,500	459.00	10,327,500	
ゆうちょ銀行	39,000	1,087.00	42,393,000	
富山第一銀行	3,300	342.00	1,128,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,000	460.00	37,260,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,300	843.00	7,839,900	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,100	747.00	6,050,700	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,704.00	2,215,200	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,877.00	6,904,800	
新生銀行	10,100	1,767.00	17,846,700	
あおぞら銀行	8,200	2,831.00	23,214,200	

三菱UFJフィナンシャル・グループ	948,700	582.50	552,617,750	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	151,300	484.30	73,274,590	
三井住友トラスト・ホールディングス	26,100	4,123.00	107,610,300	
三井住友フィナンシャルグループ	95,300	3,957.00	377,102,100	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	47,400	616.00	29,198,400	
群馬銀行	27,000	382.00	10,314,000	
武蔵野銀行	2,000	1,978.00	3,956,000	
千葉興業銀行	3,800	337.00	1,280,600	
筑波銀行	5,700	237.00	1,350,900	
七十七銀行	4,700	1,783.00	8,380,100	
青森銀行	1,100	2,986.00	3,284,600	
秋田銀行	900	2,268.00	2,041,200	
山形銀行	1,600	1,573.00	2,516,800	
岩手銀行	900	2,830.00	2,547,000	
東邦銀行	12,300	279.00	3,431,700	
東北銀行	700	1,020.00	714,000	
みちのく銀行	900	1,664.00	1,497,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	11,600	2,157.00	25,021,200	
静岡銀行	34,100	848.00	28,916,800	
十六銀行	1,700	2,509.00	4,265,300	
スルガ銀行	14,100	469.00	6,612,900	
八十二銀行	33,200	490.00	16,268,000	
山梨中央銀行	1,600	1,133.00	1,812,800	
大垣共立銀行	2,700	2,685.00	7,249,500	
福井銀行	1,200	1,614.00	1,936,800	
北國銀行	1,400	3,175.00	4,445,000	
清水銀行	500	2,014.00	1,007,000	
富山銀行	200	2,670.00	534,000	
滋賀銀行	2,800	2,688.00	7,526,400	
南都銀行	2,300	2,799.00	6,437,700	
百五銀行	12,400	359.00	4,451,600	
京都銀行	4,900	4,475.00	21,927,500	
紀陽銀行	4,900	1,741.00	8,530,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,200	1,118.00	10,285,600	
広島銀行	20,300	568.00	11,530,400	

山陰合同銀行	8,100	668.00	5,410,800
中国銀行	11,900	1,103.00	13,125,700
鳥取銀行	500	1,424.00	712,000
伊予銀行	19,600	589.00	11,544,400
百十四銀行	1,500	2,298.00	3,447,000
四国銀行	2,100	1,045.00	2,194,500
阿波銀行	2,200	2,653.00	5,836,600
大分銀行	800	3,070.00	2,456,000
宮崎銀行	900	2,803.00	2,522,700
佐賀銀行	800	1,674.00	1,339,200
沖縄銀行	1,300	3,840.00	4,992,000
琉球銀行	3,200	1,223.00	3,913,600
セブン銀行	46,000	326.00	14,996,000
みずほフィナンシャルグループ	1,872,800	171.60	321,372,480
高知銀行	500	859.00	429,500
山口フィナンシャルグループ	17,100	793.00	13,560,300
長野銀行	500	1,670.00	835,000
名古屋銀行	1,100	3,335.00	3,668,500
北洋銀行	20,700	246.00	5,092,200
愛知銀行	500	3,815.00	1,907,500
中京銀行	600	2,260.00	1,356,000
大光銀行	500	1,811.00	905,500
愛媛銀行	2,000	1,165.00	2,330,000
トマト銀行	500	1,086.00	543,000
京葉銀行	5,900	694.00	4,094,600
栃木銀行	6,600	237.00	1,564,200
北日本銀行	400	1,972.00	788,800
東和銀行	2,500	956.00	2,390,000
福島銀行	1,200	238.00	285,600
大東銀行	700	598.00	418,600
トモニホールディングス	10,600	392.00	4,155,200
フィデアホールディングス	13,600	135.00	1,836,000
池田泉州ホールディングス	15,800	203.00	3,207,400
F P G	4,300	1,182.00	5,082,600
マーキュリアインベストメント	600	773.00	463,800
S B Iホールディングス	15,400	2,435.00	37,499,000

ジャフコ	2,100	4,265.00	8,956,500
大和証券グループ本社	110,600	510.10	56,417,060
野村ホールディングス	242,600	514.80	124,890,480
岡三証券グループ	11,800	398.00	4,696,400
丸三証券	4,200	540.00	2,268,000
東洋証券	5,100	174.00	887,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,900	314.00	4,992,600
光世証券	400	680.00	272,000
水戸証券	4,000	255.00	1,020,000
いちよし証券	2,700	715.00	1,930,500
松井証券	7,800	917.00	7,152,600
だいこう証券ビジネス	700	601.00	420,700
マネックスグループ	10,400	278.00	2,891,200
極東証券	1,900	831.00	1,578,900
岩井コスモホールディングス	1,300	1,197.00	1,556,100
藍澤證券	2,600	775.00	2,015,000
マネーパートナーズグループ	1,600	256.00	409,600
スパークス・グループ	4,800	248.00	1,190,400
かんぽ生命保険	4,900	1,767.00	8,658,300
S O M P Oホールディングス	25,900	4,394.00	113,804,600
アニコム ホールディングス	1,100	3,915.00	4,306,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	36,000	3,556.00	128,016,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,300	2,428.00	27,436,400
第一生命ホールディングス	78,000	1,845.50	143,949,000
東京海上ホールディングス	49,300	5,914.00	291,560,200
T & Dホールディングス	42,600	1,300.00	55,380,000
アドバンスクリエイト	300	1,969.00	590,700
全国保証	3,800	4,530.00	17,214,000
ジェイリース	400	334.00	133,600
イントラスト	500	739.00	369,500
日本モーゲージサービス	300	1,413.00	423,900
C a s a	500	1,236.00	618,000
アルヒ	2,200	2,572.00	5,658,400
プレミアグループ	700	1,958.00	1,370,600
クレディセゾン	9,700	1,631.00	15,820,700

芙蓉総合リース	1,400	7,440.00	10,416,000
みずほリース	2,100	3,140.00	6,594,000
東京センチュリー	2,800	5,390.00	15,092,000
日本証券金融	6,000	535.00	3,210,000
アイフル	21,000	254.00	5,334,000
リコーリース	1,100	3,775.00	4,152,500
イオンフィナンシャルサービス	8,400	1,679.00	14,103,600
アコム	27,600	427.00	11,785,200
ジャックス	1,500	2,498.00	3,747,000
オリエントコーポレーション	37,200	156.00	5,803,200
日立キャピタル	3,300	2,549.00	8,411,700
アプラスフィナンシャル	6,500	100.00	650,000
オリックス	86,200	1,708.50	147,272,700
三菱UFJリース	34,900	678.00	23,662,200
九州リースサービス	700	610.00	427,000
日本取引所グループ	39,600	1,842.00	72,943,200
イー・ギャランティ	1,500	1,472.00	2,208,000
アサックス	700	640.00	448,000
NECキャピタルソリューション	600	2,348.00	1,408,800
いちご	17,600	435.00	7,656,000
日本駐車場開発	15,200	165.00	2,508,000
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,953.00	1,367,100
ヒューリック	29,400	1,186.00	34,868,400
三栄建築設計	600	1,566.00	939,600
野村不動産ホールディングス	8,400	2,556.00	21,470,400
三重交通グループホールディングス	2,900	615.00	1,783,500
サムティ	2,000	2,108.00	4,216,000
ディア・ライフ	1,800	511.00	919,800
コーセーアールイー	400	802.00	320,800
エー・ディー・ワークス	26,600	30.00	798,000
日本商業開発	900	1,545.00	1,390,500
プレサンスコーポレーション	2,200	1,818.00	3,999,600
ユニゾホールディングス	2,100	5,030.00	10,563,000
THEグローバル社	800	473.00	378,400
ハウスコム	200	1,613.00	322,600
日本管理センター	900	1,433.00	1,289,700

サンセイランディック	400	947.00	378,800	
エストラスト	200	824.00	164,800	
フージャースホールディングス	2,800	674.00	1,887,200	
オープンハウス	4,000	2,807.00	11,228,000	
東急不動産ホールディングス	37,500	734.00	27,525,000	
飯田グループホールディングス	11,500	1,840.00	21,160,000	
イーランド	300	778.00	233,400	
ムゲンエステート	1,000	690.00	690,000	
ビーロッド	300	2,037.00	611,100	
ファーストブラザーズ	300	1,261.00	378,300	
ハウズドゥ	800	1,650.00	1,320,000	
シーアールイー	400	1,059.00	423,600	
プロパティエージェント	200	1,168.00	233,600	
ケイアイスター不動産	400	1,939.00	775,600	
アグレ都市デザイン	300	510.00	153,000	
グッドコムアセット	300	1,752.00	525,600	
ジェイ・エス・ビー	100	5,180.00	518,000	
テンポイノベーション	200	1,627.00	325,400	
グローバル・リンク・マネジメント	300	677.00	203,100	
パーク24	7,400	2,589.00	19,158,600	
パラカ	400	2,009.00	803,600	
三井不動産	68,800	2,827.00	194,497,600	
三菱地所	96,600	2,103.00	203,149,800	
平和不動産	2,500	2,651.00	6,627,500	
東京建物	15,100	1,559.00	23,540,900	
ダイビル	3,600	1,165.00	4,194,000	
京阪神ビルディング	2,200	1,314.00	2,890,800	
住友不動産	31,000	3,982.00	123,442,000	
テーオーシー	2,800	829.00	2,321,200	
東京楽天地	200	5,980.00	1,196,000	
レオパレス21	18,100	293.00	5,303,300	
スターツコーポレーション	1,900	2,785.00	5,291,500	
フジ住宅	1,500	723.00	1,084,500	
空港施設	1,400	579.00	810,600	
明和地所	800	588.00	470,400	
ゴールドクレスト	1,100	2,324.00	2,556,400	

エスリード	500	2,065.00	1,032,500
日神不動産	2,100	516.00	1,083,600
日本エスコン	2,600	900.00	2,340,000
タカラレーベン	6,300	489.00	3,080,700
サンヨーハウジング名古屋	800	968.00	774,400
イオンモール	6,900	1,740.00	12,006,000
毎日コムネット	300	819.00	245,700
ファースト住建	600	1,336.00	801,600
カチタス	1,700	4,725.00	8,032,500
トーセイ	1,900	1,405.00	2,669,500
サンフロンティア不動産	1,900	1,332.00	2,530,800
エフ・ジェー・ネクスト	1,200	1,089.00	1,306,800
インテリックス	400	748.00	299,200
ランドビジネス	600	779.00	467,400
グランディハウス	1,100	499.00	548,900
日本空港ビルデング	4,300	5,380.00	23,134,000
日本工営	900	3,495.00	3,145,500
L I F U L L	4,600	667.00	3,068,200
ジェイエイシーリクルートメント	900	2,050.00	1,845,000
日本M&Aセンター	10,100	3,400.00	34,340,000
メンバーズ	400	2,375.00	950,000
中広	200	549.00	109,800
アイティメディア	400	789.00	315,600
タケエイ	1,300	1,254.00	1,630,200
E・Jホールディングス	200	1,471.00	294,200
トラスト・テック	1,500	1,406.00	2,109,000
コシダカホールディングス	3,200	1,559.00	4,988,800
アルトナー	300	756.00	226,800
パソナグループ	1,700	1,501.00	2,551,700
C D S	400	1,433.00	573,200
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	882.00	1,411,200
エス・エム・エス	4,100	2,778.00	11,389,800
サニーサイドアップ	300	971.00	291,300
パーソルホールディングス	13,300	2,091.00	27,810,300
リニカル	600	983.00	589,800

クックパッド	4,600	325.00	1,495,000
エスクリ	400	868.00	347,200
アイ・ケイ・ケイ	700	709.00	496,300
学情	500	1,468.00	734,000
スタジオアリス	700	1,955.00	1,368,500
シミックホールディングス	700	1,867.00	1,306,900
エブコ	200	1,405.00	281,000
N J S	300	1,692.00	507,600
総合警備保障	5,300	5,670.00	30,051,000
カカクコム	10,000	2,550.00	25,500,000
アイロムグループ	500	1,531.00	765,500
セントケア・ホールディング	900	520.00	468,000
サイネックス	200	696.00	139,200
ルネサンス	700	1,765.00	1,235,500
ディップ	1,900	3,045.00	5,785,500
オプトホールディング	700	1,680.00	1,176,000
新日本科学	1,400	629.00	880,600
ツクイ	3,100	446.00	1,382,600
キャリアデザインセンター	400	1,464.00	585,600
ベネフィット・ワン	3,700	1,978.00	7,318,600
エムスリー	29,400	2,626.00	77,204,400
ツカダ・グローバルホールディング	900	609.00	548,100
プラス	200	655.00	131,000
アウトソーシング	7,600	1,183.00	8,990,800
ウェルネット	1,200	853.00	1,023,600
ワールドホールディングス	500	1,792.00	896,000
ディー・エヌ・エー	6,500	1,827.00	11,875,500
博報堂D Yホールディングス	18,600	1,679.00	31,229,400
ぐるなび	2,400	994.00	2,385,600
タカミヤ	1,400	702.00	982,800
ジャパンベストレスキューシステム	900	1,094.00	984,600
ファンコミュニケーションズ	3,700	508.00	1,879,600
ライク	500	1,775.00	887,500
ビジネス・ブレークスルー	600	367.00	220,200
エスプール	2,600	658.00	1,710,800
W D Bホールディングス	600	2,785.00	1,671,000

ティア	800	611.00	488,800
C D G	200	1,431.00	286,200
バリューコマース	800	1,646.00	1,316,800
インフォマート	7,300	1,794.00	13,096,200
J Pホールディングス	4,100	297.00	1,217,700
エコナックホールディングス	2,400	142.00	340,800
E P Sホールディングス	2,000	1,338.00	2,676,000
レグス	300	1,392.00	417,600
プレステージ・インターナショナル	5,000	877.00	4,385,000
アミューズ	700	2,869.00	2,008,300
ドリームインキュベータ	400	1,655.00	662,000
クイック	800	1,630.00	1,304,000
T A C	900	234.00	210,600
ケネディクス	12,700	592.00	7,518,400
電通	13,700	4,035.00	55,279,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,229.00	614,500
ぴあ	400	4,760.00	1,904,000
イオンファンタジー	500	2,972.00	1,486,000
シーティーエス	1,500	741.00	1,111,500
ネクシィーズグループ	500	2,177.00	1,088,500
みらかホールディングス	3,700	2,658.00	9,834,600
アルプス技研	1,200	1,647.00	1,976,400
ダイオーズ	300	1,325.00	397,500
日本空調サービス	1,400	733.00	1,026,200
オリエンタルランド	14,200	15,895.00	225,709,000
ダスキン	3,400	2,941.00	9,999,400
明光ネットワークジャパン	1,600	986.00	1,577,600
ファルコホールディングス	700	1,700.00	1,190,000
秀英予備校	300	434.00	130,200
田谷	300	604.00	181,200
ラウンドワン	3,700	1,411.00	5,220,700
リゾートトラスト	6,100	1,749.00	10,668,900
ビー・エム・エル	1,700	3,165.00	5,380,500
ワタベウェディング	200	596.00	119,200
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,425.00	3,420,000
リソー教育	6,100	422.00	2,574,200

早稲田アカデミー	500	940.00	470,000
ユー・エス・エス	14,900	2,027.00	30,202,300
東京個別指導学院	500	805.00	402,500
サイバーエージェント	7,700	3,580.00	27,566,000
楽天	62,300	1,045.00	65,103,500
クリーク・アンド・リバー社	700	1,149.00	804,300
テー・オー・ダブリュー	1,100	791.00	870,100
山田コンサルティンググループ	600	2,067.00	1,240,200
セントラルスポーツ	500	3,335.00	1,667,500
フルキャストホールディングス	1,300	2,274.00	2,956,200
エン・ジャパン	2,400	5,020.00	12,048,000
リソルホールディングス	100	4,010.00	401,000
テクノプロ・ホールディングス	2,700	6,780.00	18,306,000
アトラ	300	413.00	123,900
インターワークス	300	515.00	154,500
アイ・アールジャパンホールディングス	600	3,665.00	2,199,000
K e e P e r 技研	500	1,487.00	743,500
ファーストロジック	300	653.00	195,900
三機サービス	300	983.00	294,900
G u n o s y	900	1,654.00	1,488,600
デザインワン・ジャパン	300	310.00	93,000
イー・ガーディアン	700	1,817.00	1,271,900
リブセンス	800	358.00	286,400
ジャパンマテリアル	4,100	1,577.00	6,465,700
ベクトル	1,700	985.00	1,674,500
ウチヤマホールディングス	700	531.00	371,700
チャーム・ケア・コーポレーション	400	2,126.00	850,400
ライクキッズ	300	916.00	274,800
キャリアリンク	400	579.00	231,600
I B J	900	979.00	881,100
アサンテ	500	2,078.00	1,039,000
N・フィールド	900	650.00	585,000
バリューHR	200	3,280.00	656,000
M&Aキャピタルパートナーズ	500	8,180.00	4,090,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,355.00	677,500
E R Iホールディングス	400	799.00	319,600

アピスト	200	2,676.00	535,200
シグマクシス	900	1,871.00	1,683,900
ウィルグループ	900	1,007.00	906,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	230.00	437,000
リクルートホールディングス	95,700	3,667.00	350,931,900
エラン	800	1,812.00	1,449,600
土木管理総合試験所	600	466.00	279,600
ネットマーケティング	500	931.00	465,500
日本郵政	109,500	1,014.50	111,087,750
ベルシステム24ホールディングス	2,200	1,724.00	3,792,800
鎌倉新書	1,000	1,515.00	1,515,000
S M N	200	966.00	193,200
一蔵	200	725.00	145,000
L I T A L I C O	500	2,255.00	1,127,500
グローバルキッズCOMPANY	200	865.00	173,000
エボラブルアジア	600	1,939.00	1,163,400
アトラエ	300	3,255.00	976,500
ストライク	500	4,245.00	2,122,500
ソラスト	3,700	1,262.00	4,669,400
セラク	400	752.00	300,800
インソース	700	2,942.00	2,059,400
ベйкаレント・コンサルティング	800	5,540.00	4,432,000
Orchestra Holdings	300	1,060.00	318,000
アイモバイル	400	657.00	262,800
キャリアインデックス	500	445.00	222,500
MS - Japan	400	1,337.00	534,800
船場	200	1,003.00	200,600
グレイステクノロジー	600	2,974.00	1,784,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	2,981.00	4,173,400
フルテック	200	1,380.00	276,000
グリーンズ	500	1,269.00	634,500
ツナググループ・ホールディングス	200	585.00	117,000
GameWith	300	830.00	249,000
ソウルドアウト	200	1,365.00	273,000
MS & Consulting	200	1,030.00	206,000

日総工産	900	1,290.00	1,161,000
キュービーネットホールディングス	800	2,360.00	1,888,000
R P Aホールディングス	800	1,251.00	1,000,800
スプリックス	400	1,574.00	629,600
アドバンテッジリスクマネジメント	700	997.00	697,900
リログループ	7,300	2,663.00	19,439,900
東祥	800	2,200.00	1,760,000
エイチ・アイ・エス	2,100	2,861.00	6,008,100
ラックランド	300	2,455.00	736,500
共立メンテナンス	2,200	4,850.00	10,670,000
イチネンホールディングス	1,500	1,471.00	2,206,500
建設技術研究所	900	1,908.00	1,717,200
スペース	900	1,285.00	1,156,500
長大	500	1,353.00	676,500
燦ホールディングス	600	1,171.00	702,600
スバル興業	100	7,190.00	719,000
東京テアトル	500	1,418.00	709,000
タナベ経営	300	1,249.00	374,700
ナガワ	400	7,030.00	2,812,000
よみうりランド	300	4,650.00	1,395,000
東京都競馬	900	3,385.00	3,046,500
常磐興産	500	1,764.00	882,000
カナモト	2,200	2,949.00	6,487,800
東京ドーム	5,400	971.00	5,243,400
西尾レントオール	1,400	2,954.00	4,135,600
トランス・コスモス	1,300	2,872.00	3,733,600
乃村工藝社	5,700	1,359.00	7,746,300
藤田観光	600	2,969.00	1,781,400
K N T - C Tホールディングス	800	1,513.00	1,210,400
日本管財	1,400	1,922.00	2,690,800
トーカイ	1,300	2,650.00	3,445,000
白洋舎	200	3,010.00	602,000
セコム	14,200	9,750.00	138,450,000
セントラル警備保障	600	6,130.00	3,678,000
丹青社	2,500	1,160.00	2,900,000
メイテック	1,700	5,660.00	9,622,000

応用地質	1,500	1,260.00	1,890,000	
船井総研ホールディングス	2,700	2,729.00	7,368,300	
進学会ホールディングス	500	552.00	276,000	
オオバ	1,100	777.00	854,700	
いであ	300	2,049.00	614,700	
学究社	400	1,285.00	514,000	
ベネッセホールディングス	4,400	3,025.00	13,310,000	
イオンディライト	1,600	3,765.00	6,024,000	
ナック	800	1,073.00	858,400	
ニチイ学館	1,900	1,910.00	3,629,000	
ダイセキ	2,200	3,120.00	6,864,000	
ステップ	500	1,499.00	749,500	
合 計	16,313,100		33,417,562,630	

(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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	532,995,500	3,385,904,342
金銭信託	169,360,343	-
コール・ローン	1,480,596,771	2,246,438,511
出資金	8,528,855	20,426,058

株式	89,054,235,192	187,851,868,008
投資証券	2,259,877,763	5,220,260,729
派生商品評価勘定	36,739,920	53,527,984
未収入金	44,517,666	394,306
未収配当金	61,260,913	119,754,780
差入委託証拠金	265,668,129	463,621,612
流動資産合計	93,913,781,052	199,362,196,330
資産合計	93,913,781,052	199,362,196,330
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	70,072,665	1,070,934
未払金	25,305,560	3,240,224,432
未払解約金	6,830,202	50,156,950
未払利息	2,530	1,230
流動負債合計	102,210,957	3,291,453,546
負債合計	102,210,957	3,291,453,546
純資産の部		
元本等		
元本	38,317,225,037	73,251,955,905
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	55,494,345,058	122,818,786,879
元本等合計	93,811,570,095	196,070,742,784
純資産合計	93,811,570,095	196,070,742,784
負債純資産合計	93,913,781,052	199,362,196,330

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 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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
1.	期首	2017年11月 7日	2018年11月 7日
	期首元本額	34,958,724,833円	38,317,225,037円
	期首からの追加設定元本額	6,642,172,570円	38,499,125,495円
	期首からの一部解約元本額	3,283,672,366円	3,564,394,627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）	17,394,970,643円	18,595,869,724円
	DCインデックスバランス（株式20）	83,139,293円	110,317,988円
	DCインデックスバランス（株式40）	239,509,487円	288,800,098円
	DCインデックスバランス（株式60）	461,502,750円	561,418,014円
	DCインデックスバランス（株式80）	486,117,038円	581,624,073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	2,077,599,404円	2,057,388,555円
	日興五大陸株式ファンド	5,393,219,533円	5,056,376,911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	19,578,773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	75,570,864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）	2,729,057,561円	6,841,725,259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	30,194,406,371円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,284,001円	4,906,163円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,328,393円	4,124,497円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,489,900円	6,185,915円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	6,648,070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	4,123,233,076円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	27,105,667円	27,634,168円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	79,670,246円	78,393,098円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	115,894,010円	114,845,746円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	113,856,935円	110,709,565円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,293,346,258円	4,270,778,006円
	計	38,317,225,037円	73,251,955,905円
2.	受益権の総数	38,317,225,037口	73,251,955,905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11月 7日 至 2018年11月 6日	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6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11月 6日現在	2019年11月 6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11月 6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	369,182
株式	1,376,743,345
投資証券	4,797,712
合計	1,372,314,815

(2019年11月 6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	363,504
株式	3,073,358,088
投資証券	144,037,547
合計	2,929,684,045

(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11月 6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	2,461,737,935	-	2,414,772,125	46,965,810
合計		2,461,737,935	-	2,414,772,125	46,965,810

(2019年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,324,462,820	-	4,359,015,160	34,552,340
合計		4,324,462,820	-	4,359,015,160	34,552,340

(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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,631,779,935	-	1,645,413,000	13,633,065
	米ドル	1,245,058,300	-	1,257,820,500	12,762,200
	ユーロ	386,721,635	-	387,592,500	870,865
合計		1,631,779,935	-	1,645,413,000	13,633,065

(2019年11月 6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	3,700,387,290	-	3,718,292,000	17,904,710
	米ドル	3,023,475,500	-	3,040,664,000	17,188,500

	ユーロ	669,399,550	-	670,117,000	717,450
	豪ドル	7,512,240	-	7,511,000	1,240
	合計	3,700,387,290	-	3,718,292,000	17,904,710

(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11月 6日現在		2019年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2,4483円	1口当たり純資産額	2,6767円
(1万口当たり純資産額)	(24,483円)	(1万口当たり純資産額)	(26,767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	23.96	377,465.84	
	BAKER HUGHES CO	28,145	22.63	636,921.35	
	CABOT OIL & GAS CORP	17,770	18.11	321,814.70	
	CHENIERE ENERGY INC	10,290	62.04	638,391.60	
	CHEVRON CORP	86,231	121.94	10,515,008.14	

CIMAREX ENERGY CO	5,005	46.17	231,080.85
CONCHO RESOURCES INC	9,175	72.71	667,114.25
CONOCOPHILLIPS	51,410	58.51	3,007,999.10
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,310	31.93	105,688.30
DEVON ENERGY CORPORATION	18,101	22.98	415,960.98
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,280	90.23	656,874.40
EOG RESOURCES INC	26,832	74.01	1,985,836.32
EXXON MOBIL CORP	191,461	73.09	13,993,884.49
HALLIBURTON CO	40,547	21.05	853,514.35
HELMERICH & PAYNE	4,280	41.49	177,577.20
HESS CORP	12,950	69.70	902,615.00
HOLLYFRONTIER CORP	7,740	55.89	432,588.60
KINDER MORGAN INC	91,070	20.52	1,868,756.40
MARATHON OIL CORP	36,877	12.64	466,125.28
MARATHON PETROLEUM CORP	29,562	66.44	1,964,099.28
NATIONAL OILWELL VARCO INC	16,021	24.15	386,907.15
NOBLE ENERGY INC	19,222	21.67	416,540.74
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,131	41.91	1,681,890.21
ONEOK INC	19,190	71.84	1,378,609.60
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	15,880	17.08	271,230.40
PHILLIPS 66	20,215	118.92	2,403,967.80
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,620	135.86	1,035,253.20
SCHLUMBERGER LTD	63,571	36.72	2,334,327.12
TARGA RESOURCES CORP	12,250	40.61	497,472.50
TECHNIPFMC PLC	17,311	21.09	365,088.99
VALERO ENERGY CORP	18,762	101.09	1,896,650.58
WILLIAMS COS INC	51,814	22.95	1,189,131.30
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,765	216.58	2,114,903.70
ALBEMARLE CORP	4,530	67.37	305,186.10
AMCOR PLC	71,820	10.00	718,200.00
AVERY DENNISON CORP	3,270	133.31	435,923.70
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,870	29.81	294,224.70
BALL CORP	15,170	64.71	981,650.70
CELANESE CORP	5,540	124.48	689,619.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,120	47.73	387,567.60

CORTEVA INC	31,502	25.66	808,341.32
CROWN HOLDINGS INC	6,965	75.28	524,325.20
DOW INC	34,015	54.20	1,843,613.00
DUPONT DE NEMOURS INC	34,012	72.38	2,461,788.56
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,125	81.34	498,207.50
ECOLAB INC	11,880	192.97	2,292,483.60
FMC CORP	5,320	96.88	515,401.60
FREEMONT-MCMORAN INC	70,748	10.91	771,860.68
INTERNATIONAL PAPER CO	16,760	45.24	758,222.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,355	134.46	585,573.30
LINDE PLC	24,620	200.31	4,931,632.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,300	97.37	1,197,651.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,865	253.30	725,704.50
MOSAIC CO/THE	17,490	21.65	378,658.50
NEWMONT GOLDCORP CORP	36,652	37.55	1,376,282.60
NUCOR CORP	13,279	55.47	736,586.13
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,710	113.23	420,083.30
PPG INDUSTRIES INC	10,354	128.89	1,334,527.06
SEALED AIR CORP	7,116	41.79	297,377.64
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,877	564.91	2,190,156.07
STEEL DYNAMICS INC	9,050	31.43	284,441.50
VULCAN MATERIALS CO	5,583	141.03	787,370.49
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,360	74.68	101,564.80
WESTROCK CO	13,449	39.62	532,849.38
3M CO	26,156	175.27	4,584,362.12
ACUITY BRANDS INC	1,510	131.82	199,048.20
AERCAP HOLDINGS NV	6,440	59.05	380,282.00
ALLEGION PLC	4,710	117.10	551,541.00
AMETEK INC	9,833	96.25	946,426.25
ARCONIC INC	17,563	29.51	518,284.13
BOEING CO/THE	24,192	358.29	8,667,751.68
CATERPILLAR INC	25,966	146.37	3,800,643.42
CUMMINS INC	6,375	179.93	1,147,053.75
DEERE & CO	13,390	178.92	2,395,738.80
DOVER CORP	6,500	109.50	711,750.00

EATON CORP PLC	19,466	90.64	1,764,398.24	
EMERSON ELECTRIC CO	27,820	73.79	2,052,837.80	
FASTENAL CO	24,606	37.28	917,311.68	
FLOWSERVE CORP	5,495	49.44	271,672.80	
FLUOR CORP	4,943	19.15	94,658.45	
FORTIVE CORP	13,514	73.51	993,414.14	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,330	62.00	330,460.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	10,932	179.30	1,960,107.60	
GENERAL ELECTRIC CO	396,043	10.97	4,344,591.71	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	40.91	366,144.50	
HEICO CORP	1,500	122.09	183,135.00	
HEICO CORP-CLASS A	4,070	94.35	384,004.50	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,986	180.68	5,959,910.48	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,230	230.14	513,212.20	
IDEX CORP	3,580	160.54	574,733.20	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,845	176.18	2,615,392.10	
INGERSOLL-RAND PLC	11,216	130.76	1,466,604.16	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,090	97.33	592,739.70	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,370	56.33	640,472.10	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	10,600	32.00	339,200.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	36,944	43.89	1,621,472.16	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,145	193.04	1,958,390.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,330	248.51	330,518.30	
LOCKHEED MARTIN CORP	11,521	373.63	4,304,591.23	
MASCO CORP	11,999	46.56	558,673.44	
MIDDLEBY CORP	3,030	124.74	377,962.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,219	337.85	2,438,939.15	
OWENS CORNING	4,700	63.19	296,993.00	
PACCAR INC	14,754	79.67	1,175,451.18	
PARKER HANNIFIN CORP	5,820	198.66	1,156,201.20	
PENTAIR PLC	5,938	43.15	256,224.70	
RAYTHEON COMPANY	12,732	213.09	2,713,061.88	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,333	181.87	969,912.71	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,580	340.95	1,561,551.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,030	53.66	377,229.80	

SMITH (A.O.) CORP	7,970	51.89	413,563.30
SNAP-ON INC	2,170	168.07	364,711.90
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	3,810	85.08	324,154.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,056	160.00	1,128,960.00
TEXTRON INC	11,916	47.30	563,626.80
TRANSDIGM GROUP INC	2,130	535.47	1,140,551.10
UNITED RENTALS INC	3,670	146.98	539,416.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	37,138	147.85	5,490,853.30
WABCO HOLDINGS INC	2,630	134.76	354,418.80
WABTEC CORP	8,250	77.67	640,777.50
WW GRAINGER INC	2,277	322.47	734,264.19
XYLEM INC	8,868	79.67	706,513.56
CINTAS CORP	3,717	266.99	992,401.83
COPART INC	9,920	82.25	815,920.00
COSTAR GROUP INC	1,535	554.78	851,587.30
EQUIFAX INC	5,844	133.25	778,713.00
IHS MARKIT LTD	18,113	68.49	1,240,559.37
MANPOWERGROUP INC	2,437	93.89	228,809.93
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,295	20.89	319,512.55
REPUBLIC SERVICES INC	10,350	85.72	887,202.00
ROBERT HALF INTL INC	4,995	58.24	290,908.80
ROLLINS INC	8,030	38.68	310,600.40
TRANSUNION	8,850	79.27	701,539.50
VERISK ANALYTICS INC	7,610	138.78	1,056,115.80
WASTE CONNECTIONS INC	11,456	89.84	1,029,207.04
WASTE MANAGEMENT INC	18,854	108.31	2,042,076.74
AMERCO	375	422.05	158,268.75
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,860	31.18	120,354.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,670	76.34	509,187.80
CSX CORP	35,143	73.88	2,596,364.84
DELTA AIR LINES INC	6,135	57.51	352,823.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,947	77.55	616,289.85
FEDEX CORP	11,048	164.85	1,821,262.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	119.89	539,505.00
KANSAS CITY SOUTHERN	5,060	149.76	757,785.60

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,600	38.52	177,192.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,630	193.78	2,253,661.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,940	192.27	565,273.80
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,860	57.88	339,176.80
UBER TECHNOLOGIES INC	7,540	28.02	211,270.80
UNION PACIFIC CORP	32,086	177.77	5,703,928.22
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,925	93.12	272,376.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	31,677	121.39	3,845,271.03
XPO LOGISTICS INC	3,850	83.67	322,129.50
APTIV PLC	11,340	95.23	1,079,908.20
AUTOLIV INC	4,250	84.55	359,337.50
BORGWARNER INC	9,890	45.06	445,643.40
FORD MOTOR COMPANY	177,695	9.02	1,602,808.90
GENERAL MOTORS CORP	57,955	38.23	2,215,619.65
HARLEY-DAVIDSON INC	6,229	39.45	245,734.05
LEAR CORP	2,710	126.43	342,625.30
TESLA INC	5,860	317.22	1,858,909.20
CAPRI HOLDINGS LTD	5,890	34.09	200,790.10
DR HORTON INC	15,026	50.71	761,968.46
GARMIN LTD	5,265	93.29	491,171.85
HANESBRANDS INC	12,690	15.92	202,024.80
HASBRO INC	5,168	95.79	495,042.72
LEGGETT & PLATT INC	4,778	54.00	258,012.00
LENNAR CORP-CL A	13,220	58.36	771,519.20
LULULEMON ATHLETICA INC	5,190	194.34	1,008,624.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,488	148.70	369,965.60
NEWELL BRANDS INC	19,156	19.97	382,545.32
NIKE INC -CL B	56,988	89.88	5,122,081.44
NVR INC	140	3,390.44	474,661.60
POLARIS INC	3,190	103.08	328,825.20
PULTE GROUP INC	11,880	38.28	454,766.40
PVH CORP	3,580	94.95	339,921.00
RALPH LAUREN CORP	2,895	102.06	295,463.70
ROKU INC	3,700	139.57	516,409.00
TAPESTRY INC	10,656	26.95	287,179.20

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,060	17.90	180,074.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	9,412	16.31	153,509.72
VF CORP	15,350	86.20	1,323,170.00
WHIRLPOOL CORP	3,114	157.77	491,295.78
ARAMARK	12,490	43.52	543,564.80
CARNIVAL CORP	19,417	44.86	871,046.62
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,135	740.76	840,762.60
DARDEN RESTAURANTS INC	5,483	112.77	618,317.91
DOMINO'S PIZZA INC	2,000	276.31	552,620.00
H&R BLOCK INC	7,790	25.02	194,905.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,420	100.15	1,243,863.00
LAS VEGAS SANDS CORP	15,420	63.73	982,716.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,863	133.69	1,719,654.47
MCDONALD'S CORP	34,431	192.18	6,616,949.58
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,700	22.33	194,271.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,750	30.39	691,372.50
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,670	52.49	560,068.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,988	113.51	906,717.88
STARBUCKS CORP	54,724	81.89	4,481,348.36
VAIL RESORTS INC	1,690	236.74	400,090.60
WYNN RESORTS LTD	4,590	126.60	581,094.00
YUM! BRANDS INC	13,264	97.93	1,298,943.52
ACTIVISION BLIZZARD INC	33,790	55.54	1,876,696.60
ALPHABET INC-CL A	13,520	1,291.44	17,460,268.80
ALPHABET INC-CL C	14,182	1,292.03	18,323,569.46
ALTICE USA INC- A	8,400	31.35	263,340.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	16,958	37.49	635,755.42
CHARTER COMMUNICATION-A	7,141	473.25	3,379,478.25
COMCAST CORP-CLASS A	204,674	44.28	9,062,964.72
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,730	27.95	160,153.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	17,930	26.13	468,510.90
DISH NETWORK CORP-A	9,729	34.64	337,012.56
ELECTRONIC ARTS INC	12,584	98.26	1,236,503.84
FACEBOOK INC-CLASS A	108,600	194.32	21,103,152.00
FOX CORP - CLASS A	17,524	32.83	575,400.54

FOX CORP- CLASS B	7,746	32.15	249,033.90
IAC/INTERACTIVECORP	3,470	222.05	770,513.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17,186	22.40	384,966.40
LIBERTY BROADBAND-C	5,240	118.00	618,320.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	25.40	192,659.00
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,871	24.06	502,260.61
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,470	41.50	310,005.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	8,020	46.30	371,326.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,315	46.05	152,655.75
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,820	61.95	484,449.00
NETFLIX INC	19,820	288.03	5,708,754.60
NEWS CORP - CLASS A	18,680	13.75	256,850.00
OMNICOM GROUP	10,017	79.00	791,343.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,730	6.83	462,595.90
SNAP INC - A	27,720	14.83	411,087.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,240	117.25	614,390.00
THE WALT DISNEY CO.	81,312	131.45	10,688,462.40
TRIPADVISOR INC	5,300	40.98	217,194.00
TWITTER INC	33,560	29.81	1,000,423.60
VIACOM INC-CLASS B	18,508	22.39	414,394.12
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	33.36	225,847.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,368	168.14	566,295.52
AMAZON.COM INC	18,925	1,801.71	34,097,361.75
AUTOZONE INC	1,047	1,151.06	1,205,159.82
BEST BUY CO INC	11,264	74.84	842,997.76
BOOKING HOLDINGS INC	1,963	2,025.43	3,975,919.09
BURLINGTON STORES INC	3,090	198.53	613,457.70
CARMAX INC	7,439	95.49	710,350.11
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	11,860	159.69	1,893,923.40
DOLLAR TREE INC	10,406	113.28	1,178,791.68
EBAY INC	35,127	35.48	1,246,305.96
EXPEDIA INC	6,602	135.02	891,402.04
GAP INC/THE	8,676	17.93	155,560.68
GENUINE PARTS CO	7,321	107.24	785,104.04
GRUBHUB INC	3,200	35.64	114,048.00

HOME DEPOT INC	49,770	232.20	11,556,594.00
KOHL'S CORP	7,462	55.30	412,648.60
L BRANDS INC	8,828	17.76	156,785.28
LKQ CORP	12,100	35.69	431,849.00
LOWE'S COS INC	36,082	112.20	4,048,400.40
MACY'S INC	13,499	16.71	225,568.29
MERCADOLIBRE INC	1,970	485.06	955,568.20
NORDSTROM INC	3,980	36.49	145,230.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,595	433.72	1,559,223.40
QURATE RETAIL INC	16,340	9.75	159,315.00
ROSS STORES INC	16,062	112.06	1,799,907.72
TARGET CORP	23,310	110.06	2,565,498.60
TIFFANY & CO	4,790	124.30	595,397.00
TJX COMPANIES INC	55,096	59.22	3,262,785.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,990	97.57	584,444.30
ULTA BEAUTY INC	2,610	245.42	640,546.20
WAYFAIR INC- CLASS A	2,530	81.50	206,195.00
COSTCO WHOLESALE CORP	19,909	299.18	5,956,374.62
KROGER CO	36,870	27.83	1,026,092.10
SYSCO CORP	22,546	80.08	1,805,483.68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,462	61.21	2,109,419.02
WALMART INC	64,882	118.86	7,711,874.52
ALTRIA GROUP INC	84,918	46.25	3,927,457.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,953	42.97	1,115,200.41
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	13,770	65.13	896,840.10
BUNGE LTD	6,327	55.59	351,717.93
CAMPBELL SOUP CO	6,865	46.49	319,153.85
COCA-COLA CO/THE	183,022	52.42	9,594,013.24
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,720	51.98	609,205.60
CONAGRA BRANDS INC	22,860	27.61	631,164.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,500	191.72	1,437,900.00
GENERAL MILLS INC	27,759	51.59	1,432,086.81
HERSHEY CO/THE	6,445	140.29	904,169.05
HORMEL FOODS CORP	14,400	41.62	599,328.00
INGREDION INC	3,120	83.69	261,112.80

JM SMUCKER CO/THE	5,690	107.44	611,333.60
KELLOGG CO	11,938	63.52	758,301.76
KRAFT HEINZ CO/THE	30,041	32.91	988,649.31
LAMB WESTON HOLDING INC	6,370	76.86	489,598.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,135	159.02	816,567.70
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,870	54.38	482,350.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	65,435	51.70	3,382,989.50
MONSTER BEVERAGE CORP	17,370	56.47	980,883.90
PEPSICO INC	63,221	134.01	8,472,246.21
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	70,388	84.20	5,926,669.60
TYSON FOODS INC-CL A	13,586	81.93	1,113,100.98
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,360	67.27	764,187.20
CLOROX COMPANY	5,406	147.83	799,168.98
COLGATE-PALMOLIVE CO	37,150	65.96	2,450,414.00
COTY INC-CL A	10,350	11.46	118,611.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,040	184.00	1,847,360.00
KIMBERLY-CLARK CORP	15,833	130.37	2,064,148.21
PROCTER & GAMBLE CO	113,359	118.90	13,478,385.10
ABBOTT LABORATORIES	79,586	82.34	6,553,111.24
ABIOMED INC	1,570	217.54	341,537.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,500	257.91	902,685.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,464	86.13	642,874.32
ANTHEM INC	11,671	273.00	3,186,183.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,229	77.48	1,722,302.92
BECTON DICKINSON AND CO	12,257	246.68	3,023,556.76
BOSTON SCIENTIFIC CORP	63,218	40.59	2,566,018.62
CARDINAL HEALTH INC	14,485	51.50	745,977.50
CENTENE CORP	19,720	51.84	1,022,284.80
CERNER CORP	13,960	67.21	938,251.60
CIGNA CORP	17,250	181.85	3,136,912.50
COOPER COS INC/THE	2,200	290.94	640,068.00
CVS HEALTH CORP	58,978	67.32	3,970,398.96
DANAHER CORP	29,249	133.47	3,903,864.03
DAVITA INC	5,038	62.44	314,572.72
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	54.90	631,459.80

DEXCOM INC	4,250	153.56	652,630.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,480	232.41	2,203,246.80
HCA HEALTHCARE INC	12,005	134.34	1,612,751.70
HENRY SCHEIN INC	6,170	67.73	417,894.10
HOLOGIC INC	12,828	48.10	617,090.94
HUMANA INC	6,215	294.75	1,831,871.25
IDEXX LABORATORIES INC	3,840	264.15	1,014,336.00
INTUITIVE SURGICAL INC	5,245	563.37	2,954,875.65
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,735	165.14	781,937.90
MCKESSON CORP	8,314	137.77	1,145,419.78
MEDTRONIC PLC	60,418	105.53	6,375,911.54
QUEST DIAGNOSTICS	6,386	100.82	643,836.52
RESMED INC	6,140	144.38	886,493.20
STERIS PLC	3,420	145.48	497,541.60
STRYKER CORP	15,223	198.37	3,019,786.51
TELEFLEX INC	2,300	336.22	773,306.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,970	250.30	10,755,391.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,380	139.86	472,726.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,684	123.74	579,598.16
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,230	140.68	735,756.40
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,170	292.20	634,074.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,012	140.31	1,264,473.72
ABBVIE INC	67,016	81.84	5,484,589.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,880	75.55	1,124,184.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,850	107.23	1,056,215.50
ALKERMES PLC	8,550	20.15	172,282.50
ALLERGAN PLC	14,915	178.41	2,660,985.15
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,420	92.05	498,911.00
AMGEN INC	27,611	215.08	5,938,573.88
BEIGENE LTD-ADR	1,840	190.07	349,728.80
BIOGEN INC	8,843	292.18	2,583,747.74
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,430	74.65	629,299.50
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	74,251	56.39	4,187,013.89
CELGENE CORP	32,034	107.69	3,449,741.46
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	14,986	27.43	411,065.98

ELI LILLY & CO	39,644	111.25	4,410,395.00
EXACT SCIENCES CORP	5,500	84.23	463,265.00
GILEAD SCIENCES INC	57,734	65.39	3,775,226.26
ILLUMINA INC	6,740	300.87	2,027,863.80
INCYTE CORP	8,180	84.13	688,183.40
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,140	54.39	333,954.60
IQVIA HOLDINGS INC	7,013	139.89	981,048.57
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,330	127.80	297,774.00
JOHNSON & JOHNSON	120,061	130.42	15,658,355.62
MERCK & CO. INC.	116,563	82.92	9,665,403.96
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,125	714.40	803,700.00
MYLAN NV	26,285	17.79	467,610.15
NEKTAR THERAPEUTICS	9,130	18.54	169,270.20
PERKINELMER INC	4,880	87.08	424,950.40
PERRIGO CO PLC	5,039	54.15	272,861.85
PFIZER INC	251,370	37.48	9,421,347.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,450	332.60	1,147,470.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,680	93.50	344,080.00
SEATTLE GENETICS INC	4,870	106.32	517,778.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	44,220	8.54	377,638.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,134	292.63	5,306,552.42
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,280	197.14	2,223,739.20
WATERS CORP	2,826	213.58	603,577.08
ZOETIS INC	21,770	120.25	2,617,842.50
BANK OF AMERICA CORP	408,749	32.82	13,415,142.18
BB&T CORP	34,718	55.36	1,921,988.48
CIT GROUP INC	4,145	45.92	190,338.40
CITIGROUP INC	104,737	74.83	7,837,469.71
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,180	37.90	764,822.00
COMERICA INC	7,850	71.17	558,684.50
EAST WEST BANCORP INC	7,460	45.81	341,742.60
FIFTH THIRD BANCORP	33,759	30.35	1,024,585.65
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,410	109.81	813,692.10
HUNTINGTON BANCSHARES INC	41,490	14.87	616,956.30
JPMORGAN CHASE & CO	146,740	129.10	18,944,134.00

KEYCORP	47,768	19.19	916,667.92
M & T BANK CORP	5,603	166.18	931,106.54
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	16,360	16.95	277,302.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,490	151.03	3,094,604.70
REGIONS FINANCIAL CORP	50,584	17.20	870,044.80
SIGNATURE BANK	2,310	124.48	287,548.80
SUNTRUST BANKS INC	20,427	71.42	1,458,896.34
SVB FINANCIAL GROUP	2,610	239.53	625,173.30
US BANCORP	68,661	58.59	4,022,847.99
WELLS FARGO & CO	193,290	53.30	10,302,357.00
ZIONS BANCORP NA	9,240	50.71	468,560.40
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,200	87.17	191,774.00
ALLY FINANCIAL INC	20,430	32.52	664,383.60
AMERICAN EXPRESS CO	32,224	118.77	3,827,244.48
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,910	158.29	935,493.90
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,900	22.51	267,869.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	38,872	49.17	1,911,336.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,820	220.88	12,992,161.60
BLACKROCK INC	5,090	482.44	2,455,619.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,085	97.30	2,051,570.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,210	115.26	600,504.60
CME GROUP INC	16,270	196.95	3,204,376.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,180	83.10	1,178,358.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,630	43.53	462,723.90
EATON VANCE CORP	5,440	47.72	259,596.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	255.30	446,775.00
FRANKLIN RESOURCES INC	11,655	28.99	337,878.45
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,958	218.64	3,270,417.12
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,650	89.41	2,203,956.50
INVESCO LTD	15,877	18.12	287,691.24
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	11,015	19.63	216,224.45
KKR & CO INC -A	22,350	29.36	656,196.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,690	343.73	580,903.70
MOODY'S CORP	7,567	213.06	1,612,225.02
MORGAN STANLEY	57,395	48.75	2,798,006.25

MSCI INC	3,820	238.47	910,955.40
NASDAQ INC	5,765	98.42	567,391.30
NORTHERN TRUST CORP	9,520	105.50	1,004,360.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,000	88.12	528,720.00
S&P GLOBAL INC	11,202	251.19	2,813,830.38
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,854	43.42	2,338,340.68
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,385	62.63	337,262.55
STATE STREET CORP	16,607	70.26	1,166,807.82
SYNCHRONY FINANCIAL	28,360	36.28	1,028,900.80
T ROWE PRICE GROUP INC	11,055	119.13	1,316,982.15
TD AMERITRADE HOLDING CORP	10,670	39.80	424,666.00
VOYA FINANCIAL INC	6,040	56.16	339,206.40
AFLAC INC	33,434	52.94	1,769,995.96
ALLEGHANY CORP	630	756.23	476,424.90
ALLSTATE CORP	15,303	105.84	1,619,669.52
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,240	106.68	345,643.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,515	54.81	2,111,007.15
AON PLC	10,652	193.13	2,057,220.76
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,425	40.54	706,409.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,160	89.98	734,236.80
ASSURANT INC	3,300	126.18	416,394.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,320	43.95	277,764.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,804	41.05	197,204.20
CHUBB LTD	20,805	148.83	3,096,408.15
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,310	110.03	804,319.30
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	181.87	216,425.30
EVEREST RE GROUP LTD	1,694	259.18	439,050.92
FNF GROUP	12,811	46.28	592,893.08
GLOBE LIFE INC	5,426	98.13	532,453.38
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,522	60.39	937,373.58
LINCOLN NATIONAL CORP	10,013	61.08	611,594.04
LOEWS CORP	13,585	50.49	685,906.65
MARKEL CORP	635	1,168.92	742,264.20
MARSH & MCLENNAN COS	22,223	101.70	2,260,079.10
METLIFE INC	35,305	48.38	1,708,055.90

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,440	56.27	756,268.80	
PROGRESSIVE CORP	26,760	68.90	1,843,764.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,772	92.05	1,635,912.60	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,440	165.17	403,014.80	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,887	183.94	347,094.78	
TRAVELERS COS INC/THE	11,754	131.27	1,542,947.58	
UNUM GROUP	8,138	29.93	243,570.34	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,488	185.01	1,015,334.88	
MR BERKLEY CORP	7,244	67.63	489,911.72	
CBRE GROUP INC - A	14,560	55.54	808,662.40	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	56,500	5.44	307,360.00	
JONES LANG LASALLE INC	2,120	161.65	342,698.00	
ACCENTURE PLC-CL A	28,848	186.88	5,391,114.24	
ADOBE INC	22,049	289.29	6,378,555.21	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,540	87.79	574,146.60	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,040	103.88	211,915.20	
ANSYS INC	3,630	217.96	791,194.80	
AUTODESK INC	10,180	151.73	1,544,611.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,791	157.01	3,107,384.91	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,770	123.40	588,618.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	12,030	67.20	808,416.00	
CDK GLOBAL INC	5,890	52.81	311,050.90	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,460	113.39	619,109.40	
CITRIX SYSTEMS INC	6,758	108.79	735,202.82	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,358	61.92	1,632,087.36	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,090	106.59	222,773.10	
DOCUSIGN INC	4,660	66.00	307,560.00	
DROPBOX INC-CLASS A	10,440	20.87	217,882.80	
DXC TECHNOLOGY CO	14,753	29.64	437,278.92	
EPAM SYSTEMS INC	2,340	177.81	416,075.40	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27,868	132.19	3,683,870.92	
FISERV INC	26,154	104.00	2,720,016.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,120	291.73	1,201,927.60	
FORTINET INC	7,370	91.64	675,386.80	
GARTNER INC	3,900	157.73	615,147.00	

GLOBAL PAYMENTS INC	13,439	166.53	2,237,996.67
GODADDY INC-CLASS A	8,370	62.16	520,279.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,202	137.89	5,543,453.78
INTUIT INC	11,786	253.16	2,983,743.76
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,950	145.64	575,278.00
LEIDOS HOLDINGS INC	5,260	83.18	437,526.80
MASTERCARD INC	41,060	269.00	11,045,140.00
MICROSOFT CORP	328,924	144.46	47,516,361.04
MONGODB INC	1,660	125.06	207,599.60
NORTONLIFELOCK INC	27,555	24.19	666,555.45
OKTA INC	5,090	106.80	543,612.00
ORACLE CORP	108,333	55.67	6,030,898.11
PALO ALTO NETWORKS INC	4,550	233.52	1,062,516.00
PAYCHEX INC	14,212	82.59	1,173,769.08
PAYCOM SOFTWARE INC	2,200	212.80	468,160.00
PAYPAL HOLDINGS INC	50,607	100.99	5,110,800.93
PTC INC	5,940	73.17	434,629.80
SABRE CORP	10,440	22.30	232,812.00
SALESFORCE.COM INC	37,645	158.15	5,953,556.75
SERVICENOW INC	8,200	241.86	1,983,252.00
SPLUNK INC	6,340	123.37	782,165.80
SQUARE INC - A	15,390	61.06	939,713.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,590	57.91	671,176.90
SYNOPSYS INC	6,467	135.63	877,119.21
TWILIO INC - A	5,300	91.33	484,049.00
VERISIGN INC	4,810	186.56	897,353.60
VISA INC-CLASS A SHARES	78,552	176.37	13,854,216.24
VMWARE INC	3,795	163.25	619,533.75
WESTERN UNION CO	19,111	26.51	506,632.61
WIX.COM LTD	1,980	127.92	253,281.60
WORKDAY INC-CLASS A	6,830	161.38	1,102,225.40
AMPHENOL CORP-CL A	12,830	104.41	1,339,580.30
APPLE INC	207,982	257.13	53,478,411.66
ARISTA NETWORKS INC	2,530	188.78	477,613.40
ARROW ELECTRONICS INC	3,320	82.58	274,165.60

CDW CORP/DE	7,170	135.81	973,757.70
CISCO SYSTEMS INC	193,820	47.76	9,256,843.20
COGNEX CORP	8,270	54.51	450,797.70
CORNING INC	36,988	30.05	1,111,489.40
DELL TECHNOLOGIES -C	5,742	54.43	312,537.06
F5 NETWORKS INC	2,825	146.38	413,523.50
FLEX LTD	28,486	11.79	335,849.94
FLIR SYSTEMS INC	5,685	53.58	304,602.30
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	60,245	16.83	1,013,923.35
HP INC	64,795	18.40	1,192,228.00
IPG PHOTONICS CORP	1,840	153.10	281,704.00
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	25.34	467,599.02
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,960	104.12	828,795.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,955	157.09	1,092,560.95
NETAPP INC	11,346	59.53	675,427.38
SEAGATE TECHNOLOGY	11,144	57.67	642,674.48
TE CONNECTIVITY LTD	15,575	94.56	1,472,772.00
TRIMBLE INC	13,610	40.98	557,737.80
WESTERN DIGITAL CORP	13,408	54.14	725,909.12
XEROX HOLDINGS CORP	8,148	36.37	296,342.76
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,600	241.32	627,432.00
AT&T INC	329,847	39.17	12,920,106.99
CENTURYLINK INC	47,846	13.67	654,054.82
SPRINT CORP	33,770	6.14	207,347.80
T-MOBILE US INC	15,642	81.47	1,274,353.74
VERIZON COMMUNICATIONS INC	186,647	59.50	11,105,496.50
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	10,290	34.23	352,226.70
AES CORP	34,668	17.19	595,942.92
ALLIANT ENERGY CORP	12,110	51.71	626,208.10
AMEREN CORPORATION	10,652	74.96	798,473.92
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,428	91.40	2,049,919.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,305	120.09	997,347.45
ATMOS ENERGY CORP	5,480	107.92	591,401.60
CENTERPOINT ENERGY INC	25,212	28.74	724,592.88
CMS ENERGY CORP	12,590	60.73	764,590.70

CONSOLIDATED EDISON INC	14,846	88.32	1,311,198.72
DOMINION ENERGY INC	36,481	81.35	2,967,729.35
DTE ENERGY COMPANY	7,808	123.71	965,927.68
DUKE ENERGY CORP	33,086	93.15	3,081,960.90
EDISON INTERNATIONAL	15,789	66.14	1,044,284.46
ENTERGY CORP	8,637	116.58	1,006,901.46
EVERGY INC	10,050	62.53	628,426.50
EVERSOURCE ENERGY	14,260	81.08	1,156,200.80
EXELON CORP	43,196	44.78	1,934,316.88
FIRSTENERGY CORP	25,835	47.32	1,222,512.20
NEXTERA ENERGY INC	21,575	227.11	4,899,898.25
NISOURCE INC	17,890	26.94	481,956.60
NRG ENERGY INC	11,980	39.61	474,527.80
OGE ENERGY CORP	7,900	42.80	338,120.00
PINNACLE WEST CAPITAL	5,629	90.78	511,000.62
PPL CORP	31,448	33.57	1,055,709.36
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,458	61.92	1,390,599.36
SEMPRA ENERGY	12,287	143.35	1,761,341.45
SOUTHERN CO	47,295	61.36	2,902,021.20
UGI CORP	9,220	47.30	436,106.00
VISTRA ENERGY CORP	14,940	26.36	393,818.40
WEC ENERGY GROUP INC	13,890	91.00	1,263,990.00
XCEL ENERGY INC	22,784	60.54	1,379,343.36
ADVANCED MICRO DEVICES	46,950	36.15	1,697,242.50
ANALOG DEVICES INC	16,210	113.45	1,839,024.50
APPLIED MATERIALS INC	42,313	55.88	2,364,450.44
BROADCOM INC	17,900	314.04	5,621,316.00
INTEL CORP	202,342	57.55	11,644,782.10
KLA CORP	7,269	171.98	1,250,122.62
LAM RESEARCH CORP	6,867	277.95	1,908,682.65
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	27,664	27.04	748,034.56
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,590	60.87	827,223.30
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,844	100.02	1,084,616.88
MICRON TECHNOLOGY INC	49,867	48.68	2,427,525.56
NVIDIA CORP	26,165	209.61	5,484,445.65

	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,927	118.66	1,533,917.82	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,620	21.79	383,939.80	
	QORVO INC	4,760	101.30	482,188.00	
	QUALCOMM INC	55,072	85.46	4,706,453.12	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,620	98.72	850,966.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,362	119.86	5,077,509.32	
	XILINX INC	11,855	95.40	1,130,967.00	
米ドル小計		13,600,822		1,181,171,275.09	(128,853,974,400)
加ドル	CAMECO CORP	19,892	12.92	257,004.64	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	57,474	34.85	2,002,968.90	
	CENOVUS ENERGY INC	38,273	11.92	456,214.16	
	ENBRIDGE INC	91,937	48.60	4,468,138.20	
	ENCANA CORP	48,808	6.35	309,930.80	
	HUSKY ENERGY INC	17,673	10.18	179,911.14	
	IMPERIAL OIL LTD	12,902	34.84	449,505.68	
	INTER PIPELINE LTD	16,700	22.14	369,738.00	
	KEYERA CORP	7,360	30.85	227,056.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,402	46.70	999,473.40	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	11,690	13.60	158,984.00	
	SUNCOR ENERGY INC	71,189	41.58	2,960,038.62	
	TC ENERGY CORP	40,863	65.50	2,676,526.50	
	TOURMALINE OIL CORP	11,075	12.65	140,098.75	
	VERMILION ENERGY INC	6,550	20.14	131,917.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,805	77.71	917,366.55	
	BARRICK GOLD CORP	79,324	21.78	1,727,676.72	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	55.00	440,000.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,400	12.90	430,860.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,525	126.05	1,074,576.25	
	KINROSS GOLD CORP	57,165	6.30	360,139.50	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,760	59.92	524,899.20	
	LUNDIN MINING CORP	35,450	7.50	265,875.00	
	METHANEX CORP	2,760	53.61	147,963.60	
	NUTRIEN LTD	26,108	65.58	1,712,162.64	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	22.82	579,057.50	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,460	60.30	148,338.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,735	35.40	734,019.00
BOMBARDIER INC 'B'	91,096	1.92	174,904.32
CAE INC	14,195	33.33	473,119.35
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,175	26.01	160,611.75
WSP GLOBAL INC	5,830	83.09	484,414.70
THOMSON REUTERS CORP	9,046	87.75	793,786.50
AIR CANADA	4,800	47.06	225,888.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,798	123.33	4,044,977.34
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,205	310.03	1,923,736.15
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,538	74.07	1,002,759.66
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	35.30	351,235.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,278	86.37	887,710.86
STARS GROUP INC/THE	12,310	28.37	349,234.70
QUEBECOR INC -CL B	6,060	30.27	183,436.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,045	26.93	566,741.85
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,560	143.97	368,563.20
DOLLARAMA INC	14,590	45.65	666,033.50
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	39,460	39.20	1,546,832.00
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	34.30	284,347.00
LOBLAW COMPANIES LTD	8,629	68.97	595,142.13
METRO INC	12,760	55.04	702,310.40
WESTON (GEORGE) LTD	2,998	102.98	308,734.04
SAPUTO INC	10,250	38.09	390,422.50
AURORA CANNABIS INC	38,070	4.93	187,685.10
BAUSCH HEALTH COS INC	13,194	34.40	453,873.60
CANOPY GROWTH CORP	8,750	26.17	228,987.50
CRONOS GROUP INC	7,240	10.87	78,698.80
BANK OF MONTREAL	29,361	99.21	2,912,904.81
BANK OF NOVA SCOTIA	55,539	76.38	4,242,068.82
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	20,715	114.28	2,367,310.20
NATIONAL BANK OF CANADA	16,230	68.56	1,112,728.80
ROYAL BANK OF CANADA	65,059	107.90	7,019,866.10
TORONTO-DOMINION BANK	82,930	75.89	6,293,557.70
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	39,903	73.67	2,939,654.01

	CI FINANCIAL CORP	9,570	19.88	190,251.60	
	IGM FINANCIAL INC	3,295	39.60	130,482.00	
	ONEX CORPORATION	3,805	80.36	305,769.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,160	577.74	670,178.40	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	14,894	32.41	482,714.54	
	IA FINANCIAL CORP INC	3,855	64.77	249,688.35	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,255	133.09	832,477.95	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	87,941	25.25	2,220,510.25	
	POWER CORP OF CANADA	12,630	31.04	392,035.20	
	POWER FINANCIAL CORP	9,665	31.70	306,380.50	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,584	60.05	1,536,319.20	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	9,730	21.70	211,141.00	
	BLACKBERRY LTD	27,808	7.29	202,720.32	
	CGI INC	10,470	102.06	1,068,568.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	835	1,263.34	1,054,888.90	
	OPEN TEXT CORP	13,510	53.96	728,999.60	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	4,560	389.15	1,774,524.00	
	BCE INC	6,980	62.64	437,227.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,735	61.99	975,412.65	
	TELUS CORP	7,466	46.82	349,558.12	
	ALTAGAS LTD	11,800	19.57	230,926.00	
	ATCO LTD -CLASS I	3,260	49.30	160,718.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,320	39.45	288,774.00	
	EMERA INC	12,030	53.37	642,041.10	
	FORTIS INC	19,925	53.15	1,059,013.75	
	HYDRO ONE LTD	13,000	24.14	313,820.00	
加ドル小計		1,856,592		85,987,856.97	(7,129,253,221)
ユーロ	ENI SPA	116,266	14.19	1,650,744.66	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,185	14.78	342,674.30	
	NESTE OYJ	19,170	32.90	630,693.00	
	OMV AG	6,310	54.28	342,506.80	
	REPSOL SA	68,969	15.41	1,063,157.13	
	TENARIS SA	19,815	10.17	201,617.62	
	TOTAL SA	108,387	49.30	5,344,021.03	

VOPAK	3,530	48.00	169,440.00
AIR LIQUIDE SA	21,490	119.50	2,568,055.00
AKZO NOBEL	9,927	84.55	839,327.85
ARCELORMITTAL	26,232	14.90	390,856.80
ARKEMA	3,145	97.54	306,763.30
BASF SE	41,825	71.03	2,970,829.75
COVESTRO AG	9,190	46.27	425,221.30
CRH PLC	35,340	33.50	1,183,890.00
EVONIK INDUSTRIES AG	6,800	25.20	171,360.00
FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,920	41.14	120,128.80
HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	68.18	514,418.10
IMERYS SA	830	37.88	31,440.40
KONINKLIJKE DSM NV	7,802	112.75	879,675.50
LANXESS AG	3,295	61.66	203,169.70
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,140	31.50	287,910.00
SOLVAY SA	3,701	103.75	383,978.75
STORA ENSO OYJ-R SHS	27,755	12.55	348,325.25
SYMRISE AG	6,470	86.46	559,396.20
THYSSENKRUPP AG	19,305	13.78	266,022.90
UMICORE	8,650	39.44	341,156.00
UPM-KYMMENE OYJ	25,138	30.55	767,965.90
VOESTALPINE AG	4,239	24.65	104,491.35
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,456	36.74	457,633.44
AIRBUS GROUP SE	26,518	130.12	3,450,522.16
ALSTOM	9,320	38.27	356,676.40
ANDRITZ AG	3,810	42.08	160,324.80
BOUYGUES SA	8,880	38.07	338,061.60
BRENTAG AG	6,625	45.23	299,648.75
CNH INDUSTRIAL NV	47,220	10.42	492,032.40
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,356	37.61	803,305.94
DASSAULT AVIATION SA	135	1,252.00	169,020.00
EIFFAGE	3,680	97.26	357,916.80
FERROVIAL SA	23,945	26.86	643,162.70
GEA GROUP AG	6,580	28.78	189,372.40
HOCHTIEF AG	870	111.10	96,657.00

KINGSPAN GROUP PLC	5,770	46.80	270,036.00
KION GROUP AG	2,380	60.16	143,180.80
KNORR-BREMSE AG	1,770	93.42	165,353.40
KONE OYJ-B	16,024	58.02	929,712.48
LEGRAND SA	12,518	71.62	896,539.16
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	22,040	10.93	240,897.20
METSO OYJ	4,110	35.95	147,754.50
MTU AERO ENGINES AG	2,430	235.10	571,293.00
PRYSMIAN SPA	10,595	21.53	228,110.35
SAFRAN SA	14,520	142.70	2,072,004.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,478	86.62	2,120,284.36
SIEMENS AG-REG	34,726	108.38	3,763,603.88
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	11.73	138,003.60
THALES SA	4,675	87.00	406,725.00
VINCI SA	23,220	101.15	2,348,703.00
WARTSILA OYJ ABP	21,180	9.99	211,588.20
BUREAU VERITAS SA	14,440	22.94	331,253.60
EDENRED	10,346	46.81	484,296.26
RANDSTAD NV	5,235	51.12	267,613.20
SOCIETE BIC SA	955	64.85	61,931.75
TELEPERFORMANCE	2,760	211.80	584,568.00
WOLTERS KLUWER	13,377	63.50	849,439.50
ADP	1,130	173.20	195,716.00
AENA SA	3,010	167.40	503,874.00
ATLANTIA SPA	23,620	22.48	530,977.60
BOLLORE	34,310	3.98	136,553.80
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	15.97	190,681.80
DEUTSCHE POST AG-REG	45,803	32.67	1,496,384.01
FRAPORT AG	1,680	75.70	127,176.00
GETLINK	17,870	15.29	273,232.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,195	72.80	1,033,396.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	59.15	170,352.00
CONTINENTAL AG	5,225	130.26	680,608.50
DAIMLER AG	41,182	53.32	2,195,824.24
FAURECIA	2,770	48.11	133,264.70

FERRARI NV	5,664	149.75	848,184.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	45,947	14.45	663,934.15
MICHELIN (CGDE)-B	7,199	116.15	836,163.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,535	27.11	122,943.85
PEUGEOT SA	29,240	24.41	713,748.40
PIRELLI & C SPA	14,070	5.36	75,527.76
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	6,110	68.36	417,679.60
RENAULT SA	8,677	46.88	406,821.14
VALEO SA	9,660	35.19	339,935.40
VOLKSWAGEN AG	1,521	178.45	271,422.45
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,163	178.20	1,454,646.60
ADIDAS AG	8,241	281.35	2,318,605.35
ESSILORLUXOTTICA	13,165	135.75	1,787,148.75
HERMES INTERNATIONAL	1,507	648.80	977,741.60
HUGO BOSS AG -ORD	3,520	37.72	132,774.40
KERING	3,447	525.80	1,812,432.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,594	400.25	5,040,748.50
MONCLER SPA	8,620	35.03	301,958.60
PUMA SE	3,260	66.70	217,442.00
SEB SA	770	140.90	108,493.00
ACCOR SA	8,656	39.50	341,912.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,650	92.74	338,501.00
SODEXO	3,380	99.54	336,445.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	5,925	16.68	98,829.00
JC DECAUX SA	2,720	25.46	69,251.20
PUBLICIS GROUPE	8,535	39.75	339,266.25
RTL GROUP	1,470	48.36	71,089.20
SES	15,290	17.33	265,052.15
TELENET GROUP HOLDING NV	2,110	43.64	92,080.40
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	51.42	154,260.00
VIVENDI	40,450	25.03	1,012,463.50
DELIVERY HERO SE	5,320	42.16	224,291.20
INDITEX	49,525	28.09	1,391,157.25
PROSUS	21,200	63.29	1,341,748.00
ZALANDO SE	7,390	39.05	288,579.50

CARREFOUR SA	30,103	15.86	477,433.58
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,304	48.88	112,619.52
COLRUYT SA	2,315	49.33	114,198.95
JERONIMO MARTINS	8,855	15.09	133,666.22
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	50,178	23.11	1,159,864.47
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	7,040	15.03	105,811.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,361	71.53	2,457,842.33
DANONE	27,944	73.50	2,053,884.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	24,900	8.34	207,790.50
HEINEKEN HOLDING NV	4,485	85.00	381,225.00
HEINEKEN NV	11,593	89.82	1,041,283.26
KERRY GROUP PLC-A	7,310	111.00	811,410.00
PERNOD-RICARD SA	9,506	163.00	1,549,478.00
REMY COINTREAU	810	118.70	96,147.00
BEIERSDORF AG	4,205	105.20	442,366.00
HENKEL AG & CO KGAA	5,210	87.75	457,177.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,283	94.72	689,845.76
L'OREAL	11,471	263.20	3,019,167.20
UNILEVER NV	66,175	52.99	3,506,613.25
BIOMERIEUX	1,820	73.90	134,498.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	100.30	190,570.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,583	67.78	649,535.74
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,755	48.38	955,746.90
KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,401	39.77	1,646,517.77
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,570	179.40	281,658.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,680	42.70	242,536.00
BAYER AG-REG	42,404	71.64	3,037,822.56
EUROFINS SCIENTIFIC	470	450.60	211,782.00
GRIFOLS SA	12,270	28.70	352,149.00
IPSEN	1,330	98.05	130,406.50
MERCK KGAA	6,470	108.00	698,760.00
ORION OYJ-CLASS B	5,150	40.13	206,669.50
QIAGEN N.V.	10,894	27.46	299,149.24
RECORDATI SPA	4,230	36.60	154,818.00
SANOFI	51,046	82.76	4,224,566.96

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,120	134.80	150,976.00
UCB SA	6,598	73.34	483,897.32
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,560	17.34	287,233.20
AIB GROUP PLC	42,660	2.98	127,468.08
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	294,673	4.95	1,459,810.04
BANCO DE SABADELL SA	227,252	1.04	236,569.33
BANCO SANTANDER SA	764,119	3.78	2,890,662.17
BANK OF IRELAND GROUP PLC	40,719	4.57	186,248.70
BANKIA SA	56,390	1.84	104,011.35
BANKINTER SA	23,710	6.51	154,399.52
BNP PARIBAS	51,172	49.10	2,512,545.20
CAIXABANK S.A	146,150	2.77	404,981.65
COMMERZBANK AG	48,544	5.76	279,807.61
CREDIT AGRICOLE SA	57,392	12.06	692,434.48
ERSTE GROUP BANK AG	11,618	33.68	391,294.24
FINECOBANK SPA	25,930	10.80	280,044.00
ING GROEP NV-CVA	180,555	10.55	1,905,216.36
INTESA SANPAOLO	657,293	2.34	1,538,065.62
KBC GROEP NV	10,999	64.86	713,395.14
MEDIOBANCA SPA	33,950	10.89	369,885.25
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	22.83	177,160.80
SOCIETE GENERALE	37,689	26.97	1,016,472.33
UNICREDIT SPA	93,136	11.96	1,114,092.83
AMUNDI SA	3,300	69.05	227,865.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	86,765	6.93	601,715.27
DEUTSCHE BOERSE AG	8,680	135.15	1,173,102.00
EURAZEO SE	1,877	62.80	117,875.60
EXOR NV	5,564	70.60	392,818.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,452	92.88	413,501.76
NATIXIS	49,540	4.25	210,594.54
WENDEL	1,010	128.80	130,088.00
AEGON NV	86,259	4.13	357,026.00
AGEAS	9,104	53.10	483,422.40
ALLIANZ SE-REG	19,258	221.60	4,267,572.80
ASSICURAZIONI GENERALI	49,318	18.59	916,821.62

AXA	87,402	24.22	2,117,313.45
CNP ASSURANCES	6,040	18.50	111,740.00
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	160.60	490,633.00
MAPFRE SA	59,864	2.55	153,012.38
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,356	249.60	1,586,457.60
NN GROUP NV	15,660	35.26	552,171.60
POSTE ITALIANE SPA	25,780	11.17	287,962.60
SAMPO OYJ-A SHS	21,389	36.77	786,473.53
SCOR SE	7,452	37.68	280,791.36
AROUNDTOWN SA	46,620	7.69	358,507.80
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,830	33.93	571,041.90
VONOVIA SE	23,358	46.75	1,091,986.50
ADYEN NV	480	639.00	306,720.00
AMADEUS IT GROUP SA	20,650	66.98	1,383,137.00
ATOS SE	5,240	68.68	359,883.20
CAP GEMINI SA	6,909	103.80	717,154.20
DASSAULT SYSTEMES SA	6,280	135.75	852,510.00
SAP SE	44,542	120.36	5,361,075.12
WIRECARD AG	5,480	122.50	671,300.00
WORLDLINE SA	3,120	54.80	170,976.00
INGENICO GROUP	2,900	94.86	275,094.00
NOKIA OYJ	240,966	3.23	778,320.18
CELLNEX TELECOM SA	10,780	37.96	409,208.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	150,806	15.63	2,358,002.61
DRILLISCH AG	1,640	23.50	38,540.00
ELISA OYJ	6,135	48.88	299,878.80
ILIAD SA	1,500	91.72	137,580.00
KONINKLIJKE KPN NV	153,006	2.78	425,509.68
ORANGE S.A.	93,914	14.32	1,345,318.05
PROXIMUS	8,290	27.21	225,570.90
TELECOM ITALIA SPA	352,713	0.52	186,020.83
TELECOM ITALIA-RSP	334,757	0.51	173,872.78
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,570	2.86	93,150.20
TELEFONICA SA	217,929	6.86	1,496,300.51
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,700	27.64	185,188.00

	E.ON SE	90,679	8.91	808,221.92	
	EDF	32,475	9.15	297,341.10	
	ENAGAS SA	12,350	22.15	273,552.50	
	ENDESA SA	11,770	24.07	283,303.90	
	ENEL SPA	365,267	6.91	2,523,994.97	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	123,071	3.70	456,470.33	
	ENGIE	77,534	14.71	1,140,912.81	
	FORTUM OYJ	21,025	21.48	451,617.00	
	IBERDROLA SA	270,342	9.04	2,443,891.68	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	24.03	364,102.56	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,720	17.95	300,207.60	
	RWE AG	25,785	26.75	689,748.75	
	SNAM SPA	86,480	4.66	402,996.80	
	SUEZ	12,499	13.43	167,861.57	
	TERNA SPA	54,797	5.90	323,521.48	
	UNIPER SE	7,650	28.05	214,582.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,474	22.96	538,963.04	
	VERBUND AG	2,990	47.26	141,307.40	
	ASML HOLDING NV	19,292	246.50	4,755,478.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	59,585	18.67	1,112,928.63	
	STMICROELECTRONICS NV	33,663	21.30	717,021.90	
ユーロ小計		8,740,071		185,388,295.36	(22,378,221,132)
英債券	BP PLC	922,098	5.16	4,761,714.07	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	197,238	23.29	4,593,673.02	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	169,849	23.24	3,948,140.00	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	29,210	3.74	109,479.08	
	ANGLO AMERICAN PLC	46,624	20.86	972,809.76	
	ANTOFAGASTA PLC	14,940	9.29	138,792.60	
	BHP GROUP PLC	97,061	17.64	1,712,738.40	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	48.86	299,560.66	
	EVRAZ PLC	27,180	3.77	102,468.60	
	FRESNILLO PLC	8,070	7.07	57,087.18	
	GLENCORE PLC	486,213	2.59	1,260,020.98	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,669	32.62	217,542.78	

MONDI PLC	21,700	16.91	366,947.00
RIO TINTO PLC	49,185	43.43	2,136,104.55
ASHTED GROUP PLC	18,690	23.86	445,943.40
BAE SYSTEMS PLC ORD	132,645	5.73	760,055.85
BUNZL PLC	14,996	20.27	303,968.92
DCC PLC	3,950	73.28	289,456.00
FERGUSON PLC	10,352	66.36	686,958.72
MEGGITT PLC	43,785	6.36	278,472.60
MELROSE INDUSTRIES PLC	199,080	2.23	443,948.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,535	7.69	550,104.15
ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT-C	3,290,610	0.00	3,290.61
SMITHS GROUP PLC	21,173	16.67	353,059.77
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	83.30	328,202.00
WEIR GROUP PLC/THE	10,140	14.80	150,072.00
EXPERIAN PLC	43,228	23.68	1,023,639.04
G4S PLC	58,799	2.08	122,301.92
INTERTEK GROUP PLC	6,335	53.56	339,302.60
RELX PLC	86,975	18.29	1,591,207.62
RENTOKIL INITIAL PLC	72,430	4.38	317,605.55
EASYJET PLC	6,550	13.20	86,460.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	49,140	6.30	309,975.12
BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	44.53	297,460.40
BURBERRY GROUP PLC	19,084	20.68	394,657.12
PERSIMMON PLC	16,300	22.77	371,151.00
TAYLOR WIMPEY PLC	146,790	1.70	249,616.39
CARNIVAL PLC	6,090	32.43	197,498.70
COMPASS GROUP PLC	72,388	20.06	1,452,103.28
GVC HOLDINGS PLC	27,190	8.23	223,773.70
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,283	47.73	443,077.59
TUI AG-DI	22,603	10.48	236,879.44
WHITBREAD PLC	5,410	41.82	226,246.20
AUTO TRADER GROUP PLC	48,880	5.42	265,027.36
INFORMA PLC	54,470	7.94	432,927.56
ITV PLC	197,275	1.35	267,110.35
PEARSON PLC	29,059	7.04	204,633.47

WPP PLC	60,674	9.93	602,614.16
KINGFISHER PLC	114,937	2.17	250,217.84
MARKS & SPENCER GROUP PLC	108,264	1.82	197,419.40
NEXT PLC	6,767	65.86	445,674.62
OCADO GROUP PLC	20,770	13.60	282,472.00
SAINSBURY (J) PLC	72,601	2.05	149,340.25
TESCO PLC	449,364	2.38	1,071,283.77
WM MORRISON SUPERMARKETS	86,455	1.98	171,742.85
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,985	23.74	332,003.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	104,087	27.91	2,905,068.17
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,420	23.37	196,775.40
DIAGEO PLC	107,202	31.01	3,324,870.03
IMPERIAL BRANDS PLC	45,752	17.49	800,293.98
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	32,205	58.60	1,887,213.00
UNILEVER PLC	50,387	46.05	2,320,573.28
NMC HEALTH PLC	3,660	23.37	85,534.20
SMITH & NEPHEW PLC	38,156	16.53	630,718.68
ASTRAZENECA PLC	59,393	73.63	4,373,106.59
GLAXOSMITHKLINE PLC	225,831	17.30	3,906,876.30
BARCLAYS PLC	765,191	1.69	1,294,397.09
HSBC HOLDINGS PLC	916,731	5.97	5,481,134.64
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,134,236	0.58	1,820,677.69
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	236,130	2.16	511,221.45
STANDARD CHARTERED PLC	118,990	7.36	876,480.34
3I GROUP PLC	45,549	11.50	523,813.50
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,830	17.94	194,290.20
INVESTEC PLC	36,485	4.66	170,056.58
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,227	69.62	920,863.74
M&G PLC	109,522	2.14	234,596.12
SCHRODERS PLC	6,901	32.53	224,489.53
ST JAMES'S PLACE PLC	20,690	10.66	220,555.40
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	3.12	388,111.43
ADMIRAL GROUP PLC	6,455	20.63	133,166.65
AVIVA PLC	184,725	4.31	797,642.55
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	2.77	204,330.23

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,501	2.70	796,919.70
	PRUDENTIAL PLC	115,282	13.99	1,612,795.18
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	5.35	295,208.85
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	13,079	10.35	135,367.65
	SAGE GROUP PLC/THE	57,710	7.16	413,203.60
	HALMA PLC	18,330	19.03	348,819.90
	BT GROUP PLC	350,552	2.02	710,218.35
	VODAFONE GROUP PLC	1,220,528	1.61	1,977,011.25
	CENTRICA PLC	272,675	0.71	193,599.25
	NATIONAL GRID PLC	153,458	8.91	1,367,310.78
	SEVERN TRENT PLC	11,503	22.38	257,437.14
	SSE PLC	49,417	12.80	632,537.60
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	28,615	8.45	241,968.44
英ボンド小計		16,941,251		81,235,288.76 (11,413,558,070)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,550	20.61	155,605.50
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	460	626.50	288,190.00
	GIVAUDAN-REG	398	2,869.00	1,141,862.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	20,679	51.94	1,074,067.26
	SIKA AG-REG	5,360	173.20	928,352.00
	ABB LTD-REG	85,945	21.29	1,829,769.05
	GEBERIT AG-REG	1,720	511.40	879,608.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	236.80	248,640.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,560	244.70	381,732.00
	ADECCO GROUP AG-REG	6,547	59.68	390,724.96
	SGS SA-REG	258	2,562.00	660,996.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,550	162.35	413,992.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	24,329	79.12	1,924,910.48
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,040	284.50	295,880.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,150	54.85	172,777.50
	DUFREY AG-REG	1,570	92.36	145,005.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	2,082.00	156,150.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	48	7,360.00	353,280.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	82,000.00	492,000.00
	NESTLE SA-REG	138,383	103.78	14,361,387.74

	ALCON INC	17,924	58.20	1,043,176.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,610	223.80	584,118.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	881.00	422,880.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,158	351.60	1,110,352.80	
	NOVARTIS AG-REG	97,313	86.55	8,422,440.15	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	31,808	294.00	9,351,552.00	
	VIFOR PHARMA AG	1,840	156.80	288,512.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	122,418	12.99	1,590,209.82	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,370	47.65	398,830.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,185	80.90	176,766.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	885	767.40	679,149.00	
	UBS GROUP AG-REG	178,702	12.27	2,193,567.05	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	183.50	456,915.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,600	505.20	808,320.00	
	SWISS RE AG	13,529	103.65	1,402,280.85	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,886	386.60	2,662,127.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,291	101.80	436,823.80	
	TEMENOS AG	2,850	142.30	405,555.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,154	510.60	589,232.40	
	スイスフラン小計	803,171		59,317,739.46 (6,516,053,679)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	7,310	315.80	2,308,498.00	
	BOLIDEN AB	14,670	273.85	4,017,379.50	
	ALFA LAVAL AB	13,200	231.20	3,051,840.00	
	ASSA ABLOY AB-B	44,650	229.40	10,242,710.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,255	354.40	10,367,972.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	20,160	311.20	6,273,792.00	
	EPIROC AB-A	29,345	109.80	3,222,081.00	
	EPIROC AB-B	14,810	106.40	1,575,784.00	
	SANDVIK AB	46,040	179.15	8,248,066.00	
	SKANSKA AB-B SHS	19,210	205.50	3,947,655.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	183.35	3,650,315.15	
	VOLVO AB-B SHS-B	72,910	152.75	11,137,002.50	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	155.00	2,267,495.00	
	ELECTROLUX AB - B	8,065	255.60	2,061,414.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	14,680	74.70	1,096,596.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,848	198.68	6,923,600.64	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	423.30	1,790,559.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,100	447.60	3,625,560.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,485	300.90	7,969,336.50	
	NORDEA BANK ABP	137,412	72.26	9,929,391.12	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	69,270	94.76	6,564,025.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	67,010	96.10	6,439,661.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,140	137.75	6,218,035.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,870	214.20	1,257,354.00	
	INVESTOR AB-B SHS	21,495	504.20	10,837,779.00	
	KINNEVIK AB - B	12,405	270.00	3,349,350.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	370.80	1,475,784.00	
	ERICSSON LM-B SHS	129,365	85.36	11,042,596.40	
	HEXAGON AB-B SHS	12,660	538.20	6,813,612.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,330	431.80	1,006,094.00	
	TELE2 AB-B SHS	21,615	136.50	2,950,447.50	
	TELIA CO AB	122,530	42.25	5,176,892.50	
	スウェーデンクローナ小計	1,093,588		166,838,678.01	(1,883,608,674)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	3,800	266.10	1,011,180.00	
	EQUINOR ASA	42,924	178.00	7,640,472.00	
	NORSK HYDRO A S	62,840	35.53	2,232,705.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,800	364.00	2,839,200.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	244.20	1,255,188.00	
	MOWI ASA	20,670	221.80	4,584,606.00	
	ORKLA ASA	38,170	87.40	3,336,058.00	
	DNB ASA	40,535	168.10	6,813,933.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,030	169.50	1,191,585.00	
	TELENOR ASA	34,555	165.90	5,732,674.50	
	ノルウェークローネ小計	263,464		36,637,602.20	(435,254,714)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,680	533.80	2,498,184.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	9,075	321.10	2,913,982.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	8,360	549.00	4,589,640.00	

	ISS A/S	7,930	181.55	1,439,691.50	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	195	8,400.00	1,638,000.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	253	8,900.00	2,251,700.00	
	DSV PANALPINA A S	9,770	717.40	7,008,998.00	
	PANDORA A/S	4,560	280.00	1,276,800.00	
	CARLSBERG AS-B	4,630	950.80	4,402,204.00	
	COLOPLAST-B	5,825	794.60	4,628,545.00	
	DEMANT A/S	4,440	178.15	790,986.00	
	GENMAB A/S	3,070	1,457.00	4,472,990.00	
	H LUNDBECK A/S	2,450	236.90	580,405.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	80,025	381.00	30,489,525.00	
	DANSKE BANK A/S	31,805	93.90	2,986,489.50	
	TRYG A/S	6,075	187.00	1,136,025.00	
	ORSTED A/S	9,210	568.40	5,234,964.00	
	デンマーククローネ小計	192,353		78,339,129.50	(1,265,960,332)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,105	27.90	393,529.50	
	OIL SEARCH LTD	68,980	7.28	502,174.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,720	8.07	554,570.40	
	SANTOS LTD	79,625	8.15	648,943.75	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	44,633	33.12	1,478,244.96	
	WORLEY LTD	12,600	14.06	177,156.00	
	ALUMINA LTD	107,822	2.35	253,381.70	
	BHP GROUP LTD	133,726	36.95	4,941,175.70	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,750	13.52	253,500.00	
	BORAL LTD	42,795	5.09	217,826.55	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	57,895	9.53	551,739.35	
	INCITEC PIVOT LTD	75,040	3.61	270,894.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	18,225	25.20	459,270.00	
	NEWCREST MINING LTD	34,449	31.61	1,088,932.89	
	ORICA LIMITED	20,325	23.71	481,905.75	
	RIO TINTO LTD	18,988	94.84	1,800,821.92	
	SOUTH32 LTD	194,147	2.58	500,899.26	
	CIMIC GROUP LTD	4,887	34.29	167,575.23	
	BRAMBLES LTD	78,388	12.09	947,710.92	

SEEK LTD	11,730	22.53	264,276.90
AURIZON HOLDINGS LTD	95,170	5.81	552,937.70
SYDNEY AIRPORT	51,686	8.97	463,623.42
TRANSURBAN GROUP	117,559	15.10	1,775,140.90
ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,560	31.49	1,088,294.40
CROWN RESORTS LTD	19,095	12.46	237,923.70
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,630	42.62	69,470.60
TABCORP HOLDINGS LTD	97,874	4.84	473,710.16
REA GROUP LTD	1,800	108.54	195,372.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	12,062	4.16	50,177.92
WESFARMERS LTD	51,575	40.41	2,084,145.75
COLES GROUP LTD	51,925	14.99	778,355.75
WOOLWORTHS GROUP LTD	59,052	37.69	2,225,669.88
COCA-COLA AMATIL LTD	17,820	10.09	179,803.80
TREASURY WINE ESTATES LTD	26,956	17.77	479,008.12
COCHLEAR LTD	2,917	216.04	630,188.68
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,855	70.11	480,604.05
SONIC HEALTHCARE LTD	20,390	29.30	597,427.00
CSL LTD	20,512	260.75	5,348,504.00
AUST AND NZ BANKING GROUP	126,189	26.04	3,285,961.56
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	14,130	9.18	129,713.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	17,778	10.64	189,157.92
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	80,317	77.70	6,240,630.90
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	127,923	27.86	3,563,934.78
WESTPAC BANKING CORP	156,681	27.17	4,257,022.77
AMP LTD	156,627	1.84	288,193.68
ASX LTD	7,715	81.56	629,235.40
CHALLENGER LTD	20,840	7.89	164,427.60
MACQUARIE GROUP LTD	15,914	136.27	2,168,600.78
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,540	49.91	226,591.40
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	116,375	7.90	919,362.50
MEDIBANK PRIVATE LTD	104,360	3.40	354,824.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	55,820	12.60	703,332.00
SUNCORP GROUP LTD	56,606	13.25	750,029.50
COMPUTERSHARE LTD	25,050	15.82	396,291.00

	TELSTRA CORPORATION LTD	171,384	3.50	599,844.00	
	TPG TELECOM LTD	7,840	6.48	50,803.20	
	AGL ENERGY LTD	28,301	19.66	556,397.66	
	APA GROUP	53,448	11.55	617,324.40	
	AUSNET SERVICES	69,210	1.84	127,692.45	
豪ドル小計		3,212,316		59,884,258.31 (4,498,505,484)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	30,583	4.85	148,327.55	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	36,555	9.31	340,327.05	
	A2 MILK CO LTD	30,340	12.76	387,138.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,590	19.82	487,373.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,200	13.45	190,990.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,377	4.47	359,285.19	
	MERIDIAN ENERGY LTD	55,650	4.60	255,990.00	
ニュージーランドドル小計		272,295		2,169,431.99 (150,667,051)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	119,708	74.05	8,864,377.40	
	NWS HOLDINGS LTD	82,500	12.24	1,009,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	60,000	62.80	3,768,000.00	
	MTR CORP	82,000	46.20	3,788,400.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	41,000	22.45	920,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	109,000	55.75	6,076,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,400	13.10	372,040.00	
	SANDS CHINA LTD	121,400	40.10	4,868,140.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	8.68	243,040.00	
	SJM HOLDINGS LTD	82,000	8.71	714,220.00	
	WYNN MACAU LTD	55,800	17.88	997,704.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	47,000	29.35	1,379,450.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	40,000	33.70	1,348,000.00	
	WH GROUP LTD	389,500	8.75	3,408,125.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,040	19.26	867,470.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	158,500	28.00	4,438,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,600	167.40	6,461,640.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	250.20	13,210,560.00		
AIA GROUP LTD	547,990	82.40	45,154,376.00		

	CK ASSET HOLDINGS LTD	122,708	54.80	6,724,398.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,000	17.20	1,358,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	40.15	2,926,975.15	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	25,000	31.40	785,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	31,950	25.90	827,505.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	283,666	11.48	3,256,485.68	
	SINO LAND CO	143,050	12.16	1,739,488.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	72,480	120.50	8,733,840.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	76.10	1,333,043.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	66,000	24.75	1,633,500.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	42,800	18.42	788,376.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	47,800	46.25	2,210,750.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	29,600	48.90	1,447,440.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	153,000	12.40	1,897,200.00	
	PCCW LTD	231,000	4.69	1,083,390.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	27,000	56.90	1,536,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	75,000	83.25	6,243,750.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	93,500	7.85	733,975.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	427,434	15.44	6,599,580.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS	59,000	56.50	3,333,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,700	103.90	1,111,730.00	
香港ドル小計		4,240,344		164,195,570.69 (2,287,244,299)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	62,360	6.90	430,284.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.32	48,720.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	86,700	4.10	355,470.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	120,300	2.34	281,502.00	
	SATS LTD	37,500	5.08	190,500.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	21,800	9.43	205,574.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	212,600	0.95	201,970.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,250	2.30	129,375.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3,500	33.07	115,745.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.22	28,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	84,360	3.83	323,098.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,415	26.17	2,209,140.55	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	140,840	11.08	1,560,507.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	52,800	26.77	1,413,456.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	36,800	8.97	330,096.00	
	CAPITALAND LTD	109,900	3.69	405,531.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,200	10.92	187,824.00	
	UOL GROUP LTD	26,150	8.01	209,461.50	
	VENTURE CORP LTD	9,700	16.07	155,879.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,080	3.30	1,171,764.00	
シンガポールドル小計		1,669,255		9,954,498.05	(798,848,468)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	36,890	16.23	598,724.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	573.00	687,600.00	
	BANK HAPOALIM BM	60,335	28.48	1,718,340.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,505	25.95	1,829,604.75	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	41,400	16.01	662,814.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	86.85	425,565.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,610	264.40	425,684.00	
	NICE LTD	2,455	552.80	1,357,124.00	
イスラエルシュケル小計		219,295		7,705,457.25	(240,718,484)
合 計		53,104,817		187,851,868,008	(187,851,868,008)

(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	9,607.00	187,240.43	
	出資金小計		9,607.00	187,240.43	(20,426,058)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	22,170	376,446.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,140	797,111.20	
		AMERICAN TOWER CORP	19,969	4,113,813.69	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	66,040	592,378.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,665	1,404,048.90	

BOSTON PROPERTIES INC	6,937	945,651.84	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,830	429,304.70	
CROWN CASTLE INTL CORP	18,910	2,489,690.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,835	1,089,620.55	
DUKE REALTY CORPORATION	17,385	603,433.35	
EQUINIX INC	3,668	1,933,732.92	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,580	513,620.80	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	17,440	1,479,086.40	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,960	942,256.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,500	589,105.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,945	527,249.25	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,815	750,654.15	
HOST HOTELS & RESORTS INC	29,879	520,193.39	
INVITATION HOMES INC	19,500	577,785.00	
IRON MOUNTAIN INC	12,895	430,564.05	
KIMCO REALTY CORPORATION	20,575	437,836.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8,083	469,298.98	
MACERICH CO/THE	4,120	119,480.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,800	651,168.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,390	355,923.00	
PROLOGIS INC	28,702	2,465,501.80	
PUBLIC STORAGE	7,309	1,573,408.43	
REALTY INCOME CORP	15,120	1,182,837.60	
REGENCY CENTERS CORP	8,145	543,678.75	
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,860	1,111,773.60	
SIMON PROPERTY GROUP INC	13,654	2,135,622.14	
SL GREEN REALTY CORP	3,450	293,043.00	
SUN COMMUNITIES INC	3,850	597,712.50	
UDR INC	14,500	703,250.00	
VENTAS INC	16,665	1,007,565.90	
VEREIT INC	47,904	454,608.96	
VORNADO REALTY TRUST	8,131	531,442.16	
WELLTOWER INC	18,200	1,557,010.00	
WEYERHAEUSER CO	33,338	989,138.46	
WP CAREY INC	7,400	639,952.00	

	投資証券小計		576,259	38,925,999.27 (4,246,437,260)
米ドル小計			585,866	39,113,239.70 (4,266,863,318)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,690	147,849.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,660	148,858.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	53,505.40
加ドル小計			14,040	350,212.40 (29,036,110)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,665	168,331.50
		GECINA SA	2,350	358,140.00
		ICADE	1,175	102,753.75
		KLEPIERRE	7,522	250,858.70
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,350	902,017.50
ユーロ小計			19,062	1,782,101.45 (215,117,466)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	34,331	207,290.57
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	312,872.24
		SEGRO PLC	45,073	378,162.47
英ポンド小計			113,538	898,325.28 (126,214,701)
豪ドル	投資証券	DEXUS	42,687	509,255.91
		GOODMAN GROUP	81,012	1,154,421.00
		GPT GROUP	87,135	524,552.70
		LENDLEASE GROUP	28,927	549,613.00
		MIRVAC GROUP	208,775	674,343.25
		SCENTRE GROUP	268,371	1,038,595.77
		STOCKLAND	115,500	568,260.00
		VICINITY CENTRES	123,402	328,249.32
豪ドル小計			955,809	5,347,290.95 (401,688,496)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	93,500	7,956,850.00
香港ドル小計			93,500	7,956,850.00 (110,838,920)
シンガ ポールド	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,200	432,566.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	92,140	189,808.40

ル	CAPITALAND MALL TRUST	132,400	341,592.00	
	SUNTEC REIT	91,400	169,090.00	
シンガポールドドル小計		454,140	1,133,056.40	(90,927,776)
合計			5,240,686,787	(5,240,686,787)

(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	96.8%			66.7%
	投資証券 40銘柄			3.2%	2.2%
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 95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	91.8%			2.3%
	投資証券 8銘柄			8.2%	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	95.4%			1.2%
	投資証券 1銘柄			4.6%	0.1%
シンガポールドドル	株式 20銘柄	89.8%			0.4%
	投資証券 4銘柄			10.2%	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。

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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,389,574	-
コール・ローン	73,344,063	60,850,776
国債証券	29,887,813,826	32,055,271,267
地方債証券	2,790,485,000	3,161,772,000
特殊債券	3,105,017,000	3,461,736,000
社債券	2,455,598,000	2,750,637,000
未収利息	91,357,008	90,239,114
前払費用	830,695	2,211,474
流動資産合計	38,412,835,166	41,582,717,631
資産合計	38,412,835,166	41,582,717,631
負債の部		
流動負債		
未払金	-	42,305,900
未払解約金	24,628,232	9,613,484
未払利息	125	33
流動負債合計	24,628,357	51,919,417
負債合計	24,628,357	51,919,417
純資産の部		
元本等		
元本	27,717,750,995	29,082,509,839
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,670,455,814	12,448,288,375
元本等合計	38,388,206,809	41,530,798,214
純資産合計	38,388,206,809	41,530,798,214
負債純資産合計	38,412,835,166	41,582,717,631

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られ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られ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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
1.	期首	2017年11月 7日	2018年11月 7日
	期首元本額	26,628,181,886円	27,717,750,995円
	期首からの追加設定元本額	3,474,873,250円	3,602,070,698円
	期首からの一部解約元本額	2,385,304,141円	2,237,311,854円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	1,856,314,765円	2,581,135,782円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,875,652,086円	2,359,105,762円
	DCインデックスバランス(株式60)	1,348,956,010円	1,707,355,366円
	DCインデックスバランス(株式80)	221,368,003円	264,743,804円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,826,802,108円	1,961,614,809円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,832,217,524円	3,616,810,930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	3,699,170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	4,328,632円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	24,838,920円	25,139,548円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	115,571,543円	103,120,055円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	294,386,146円	273,499,884円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,971,632,764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)	2,762,842円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,239,420,432円	1,319,530,163円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,219,133,392円	1,282,950,890円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	658,273,991円	685,055,821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	99,244,443円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,340,531,990円	6,686,660,099円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	264,166,974円	303,459,608円
計	27,717,750,995円	29,082,509,839円
2. 受益権の総数	27,717,750,995口	29,082,509,839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11月 7日 至 2018年11月 6日	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6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11月 6日現在	2019年11月 6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ぬ。	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。	(1)有価証券 同左

	(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。	(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11月 6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	64,396,902
地方債証券	1,570,000
特殊債券	1,358,000
社債券	1,286,000
合計	68,610,902

（2019年11月 6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	99,485,861
地方債証券	5,000,000
特殊債券	4,916,000
社債券	2,413,000
合計	111,814,861

（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11月 6日現在		2019年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3850円	1口当たり純資産額	1.4280円
(1万口当たり純資産額)	(13,850円)	(1万口当たり純資産額)	(14,280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 4 回利付国債（ 5 年）	560,000,000	561,076,862	
	第 1 2 5 回利付国債（ 5 年）	325,000,000	326,082,922	
	第 1 2 6 回利付国債（ 5 年）	220,000,000	220,688,600	
	第 1 回利付国債（ 4 0 年）	70,000,000	107,861,600	
	第 2 回利付国債（ 4 0 年）	145,000,000	217,587,000	
	第 3 回利付国債（ 4 0 年）	50,000,000	75,700,500	
	第 4 回利付国債（ 4 0 年）	95,000,000	145,285,400	
	第 5 回利付国債（ 4 0 年）	35,000,000	51,939,650	
	第 6 回利付国債（ 4 0 年）	70,000,000	102,568,200	
	第 7 回利付国債（ 4 0 年）	50,000,000	70,597,000	
	第 8 回利付国債（ 4 0 年）	95,000,000	125,796,150	
	第 9 回利付国債（ 4 0 年）	160,000,000	159,241,600	
	第 1 0 回利付国債（ 4 0 年）	125,000,000	145,790,000	
	第 1 1 回利付国債（ 4 0 年）	140,000,000	158,625,600	
	第 1 2 回利付国債（ 4 0 年）	65,000,000	66,756,300	
	第 3 0 8 回利付国債（ 1 0 年）	140,000,000	141,315,475	
第 3 0 9 回利付国債（ 1 0 年）	134,000,000	135,091,436		

第310回利付国債(10年)	78,000,000	78,869,658	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,216,586	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	208,167,250	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	377,488,800	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	66,454,050	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	35,726,250	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	107,529,450	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	189,108,850	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,137,150	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	194,807,000	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	179,966,500	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	76,950,000	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,295,550	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,654,000	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	216,058,500	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,846,900	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,039,050	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,115,350	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	238,376,600	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	218,227,800	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,511,200	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	217,539,000	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,560,000	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	507,233,300	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,959,200	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,799,200	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	403,014,300	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	382,935,200	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	435,351,000	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	722,120,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	132,555,800	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	250,010,250	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	51,062,000	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	623,438,300	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	501,172,000	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	163,712,000	

第348回利付国債(10年)	90,000,000	92,121,300	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	501,715,900	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	491,409,600	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	445,074,600	
第352回利付国債(10年)	390,000,000	398,763,300	
第353回利付国債(10年)	200,000,000	204,338,000	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	276,332,160	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	197,966,370	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	47,271,700	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	146,175,700	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,788,000	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	55,013,600	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	75,892,850	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	94,058,280	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	27,085,800	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	233,743,200	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	40,611,890	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	132,414,040	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	386,049,480	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	203,789,040	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	165,073,200	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	70,134,000	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	182,036,700	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	279,096,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	228,486,720	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	184,451,850	
第37回利付国債(30年)	131,000,000	176,800,220	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	126,666,350	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	101,913,750	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	120,471,300	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	52,713,200	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	178,316,100	
第43回利付国債(30年)	205,000,000	271,100,200	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	198,828,000	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	76,727,400	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	128,133,000	

第47回利付国債(30年)	115,000,000	150,384,350	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	132,408,150	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	113,564,700	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,816,000	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	69,063,400	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	93,314,700	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	111,500,550	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	122,513,600	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	122,465,200	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	55,642,500	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	111,234,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	111,180,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	184,516,300	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	136,766,400	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	75,971,700	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	123,639,600	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	90,118,800	
第64回利付国債(30年)	40,000,000	40,000,000	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,459,348	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	101,978,910	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	58,784,670	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	243,768,720	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	40,380,600	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	15,762,300	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	69,444,540	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	54,864,680	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	143,178,300	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	34,967,130	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	309,806,050	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,097,280	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,252,460	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,420,980	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	108,741,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,830,840	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,159,960	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	86,279,700	

第70回利付国債(20年)	104,000,000	116,625,600	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	124,695,200	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	125,919,290	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	132,101,000	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,253,200	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,403,870	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	44,796,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	180,096,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	68,214,600	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	150,064,200	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	350,169,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,667,680	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	293,422,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	69,939,000	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	69,840,000	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,573,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	97,779,260	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	115,343,060	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,569,350	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	111,150,300	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	138,976,110	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,032,700	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	80,391,960	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	99,073,530	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,358,290	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,498,690	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	92,488,550	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,420,260	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	156,677,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	159,025,840	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,149,980	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	118,547,660	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,583,000	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	97,088,800	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	353,234,500	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	63,530,480	

第115回利付国債(20年)	55,000,000	67,756,700	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	67,963,500	
第117回利付国債(20年)	293,000,000	359,004,110	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,187,900	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,923,500	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,327,000	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,658,720	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,414,450	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	241,332,000	
第124回利付国債(20年)	180,000,000	220,759,200	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	62,643,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	129,158,400	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,438,450	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	102,892,500	
第130回利付国債(20年)	170,000,000	206,317,100	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,421,120	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,158,900	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,499,200	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,977,000	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,216,000	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	215,076,600	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	241,980,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	142,171,200	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	275,385,900	
第140回利付国債(20年)	508,000,000	616,351,320	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	237,084,900	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	153,607,500	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	113,267,180	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	512,431,000	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	433,337,850	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	165,110,400	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	72,680,400	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	107,995,500	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	138,193,200	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	106,983,900	
第151回利付国債(20年)	200,000,000	232,072,000	

	第152回利付国債(20年)	140,000,000	162,687,000	
	第153回利付国債(20年)	170,000,000	200,288,900	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	139,636,800	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	158,601,800	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	114,027,100	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	50,161,000	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	178,758,400	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	160,195,500	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	151,873,400	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	128,167,200	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	74,765,600	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	176,076,450	
	第164回利付国債(20年)	285,000,000	299,084,700	
	第165回利付国債(20年)	60,000,000	62,947,800	
	第166回利付国債(20年)	100,000,000	108,499,000	
	第167回利付国債(20年)	160,000,000	167,603,200	
	第168回利付国債(20年)	100,000,000	102,770,000	
	第169回利付国債(20年)	160,000,000	161,344,000	
	第170回利付国債(20年)	60,000,000	60,453,000	
	国債証券 合計	28,307,000,000	32,055,271,267	
地方債証券	第694回東京都公募公債	200,000,000	203,528,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	102,182,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	101,894,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	204,100,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	102,627,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,501,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	204,468,000	
	平成27年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,429,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,597,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,451,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,527,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,033,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,462,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	102,913,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,819,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,062,000	

	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	102,209,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,474,000	
	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	205,516,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	101,987,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,899,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,887,000	
	平成27年度第1回相模原市公募公債	200,000,000	204,964,000	
	平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	101,961,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	102,282,000	
地方債証券 合計		3,100,000,000	3,161,772,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,309,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,264,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,132,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,922,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,162,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,411,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,914,000	
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,067,000	
	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	102,079,000	
	第17回道路債券	100,000,000	104,593,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,071,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,185,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,718,000	
	第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,107,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,161,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,800,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,040,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,201,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,115,000	
	第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	101,938,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,037,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,238,000	

	第 3 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,803,000	
	第 1 7 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,859,000	
	第 1 9 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,898,000	
	第 3 1 6 回信金中金債（ 5 年）	100,000,000	99,998,000	
	第 3 1 8 回信金中金債（ 5 年）	100,000,000	99,952,000	
	第 3 2 0 回信金中金債（ 5 年）	100,000,000	99,896,000	
	第 3 2 2 回信金中金債（ 5 年）	200,000,000	199,846,000	
	第 3 7 回国際協力機構債券	100,000,000	100,020,000	
特殊債券 合計		3,400,000,000	3,461,736,000	
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	102,794,000	
	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	100,178,000	
	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	103,275,000	
	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	99,740,000	
	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	201,686,000	
	第 2 1 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	200,394,000	
	第 1 0 回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,608,000	
	第 2 8 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	102,111,000	
	第 1 3 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	99,824,000	
	第 9 回三菱UFJ信託銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	204,518,000	
	第 1 1 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	101,606,000	
	第 2 4 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	104,642,000	
	第 2 9 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	107,326,000	
	第 8 7 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	204,490,000	
	第 9 8 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	102,702,000	
	第 1 1 回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,264,000	
	第 6 3 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	203,620,000	

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	99,811,000	
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	102,331,000	
第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,011,000	
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	203,706,000	
社債券 合計	2,700,000,000	2,750,637,000	
合計	37,507,000,000	41,429,416,267	

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11月 6日現在	2019年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	435,075,215	973,316,910
金銭信託	5,137,390	-
コール・ローン	44,912,539	108,974,090
国債証券	146,813,640,796	153,202,979,354
派生商品評価勘定	48,249	49
未収入金	-	1,323,670,238
未収利息	1,240,467,078	1,163,080,368
前払費用	30,283,573	24,183,944
流動資産合計	148,569,564,840	156,796,204,953
資産合計	148,569,564,840	156,796,204,953
負債の部		
流動負債		
未払金	98,981,385	1,951,776,714
未払解約金	45,246,907	78,195,310
未払利息	76	59
流動負債合計	144,228,368	2,029,972,083
負債合計	144,228,368	2,029,972,083
純資産の部		

元本等		
元本	66,186,471,666	66,109,940,367
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	82,238,864,806	88,656,292,503
元本等合計	148,425,336,472	154,766,232,870
純資産合計	148,425,336,472	154,766,232,870
負債純資産合計	148,569,564,840	156,796,204,953

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2018年11月 6日現在	2019年11月 6日現在
1. 期首	2017年11月 7日	2018年11月 7日
期首元本額	68,813,700,349円	66,186,471,666円
期首からの追加設定元本額	3,403,109,134円	2,787,676,829円
期首からの一部解約元本額	6,030,337,817円	2,864,208,128円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	12,025,880,978円	12,722,484,813円
DCインデックスバランス（株式20）	177,605,835円	243,150,997円
DCインデックスバランス（株式40）	259,547,219円	320,858,961円
DCインデックスバランス（株式60）	334,197,477円	418,393,550円
DCインデックスバランス（株式80）	268,750,988円	324,789,751円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	23,997,031,098円	24,778,254,264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	2,369,212,998円	2,265,552,164円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	19,391,378,340円	17,528,361,096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	20,802,198円	- 円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	546,561,756円	889,412,344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	2,677,723円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,097,804円	3,073,745円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,011,579円	6,985,542円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	14,087,457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)	878,307,671円	857,949,169円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,026,017,703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)	2,349,760円	- 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	59,204,110円	61,966,468円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	84,546,738円	87,293,527円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	82,151,594円	84,281,427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	61,191,546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	4,160,469,588円	4,119,195,200円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	252,567,497円	267,273,437円
計	66,186,471,666円	66,109,940,367円
2. 受益権の総数	66,186,471,666口	66,109,940,367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11月 7日 至 2018年11月 6日	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6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11月 6日現在	2019年11月 6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11月 6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	210,610,529
合計	210,610,529

(2019年11月 6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	768,286,961
合計	768,286,961

(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11月 6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	11,038,226	-	11,085,000	46,774
	英ポンド	11,038,226	-	11,085,000	46,774
	売建	63,023,276	-	63,021,801	1,475
	米ドル	22,359,726	-	22,358,251	1,475
	ポーランドズロチ	40,663,550	-	40,663,550	-
合計		74,061,502	-	74,106,801	48,249

(2019年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	27,159,750	-	27,159,799	49

	米ドル	27,159,750	-	27,159,799	49
	売建	27,159,750	-	27,159,750	-
	ユーロ	27,159,750	-	27,159,750	-
	合計	54,319,500	-	54,319,549	49

(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11月 6日現在		2019年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.2425円	1口当たり純資産額	2.3410円
(1万口当たり純資産額)	(22,425円)	(1万口当たり純資産額)	(23,410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-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	2,001,835.80	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,286,346.68	
		US TREASURY N/B-2.875%-20/10/31	4,550,000.00	4,603,408.81	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,534,179.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,401,449.14	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	2,006,992.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,119,606.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-20/11/30	3,400,000.00	3,438,581.84	
		US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,405,671.68	
		US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,024,023.40	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,002,031.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,907,644.46	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,413,031.04	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,993,046.88	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,510,000.00	4,620,723.65	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,517,919.75	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,380,044.53	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,985,468.76	
		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	1,262,434.57	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,214,451.97	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,991,093.76	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,413,993.69	
		US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	3,030,000.00	3,072,668.46	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/05/31	3,400,000.00	3,416,734.12	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,050,343.75	
		US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,928,314.37	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	6,094,901.89	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,865,037.12	
		US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	3,047,577.90	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,351,653.80	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,953,906.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	11,860,000.00	11,952,887.52	
US TREASURY N/B-2.75%-21/08/15	2,100,000.00	2,139,375.00			
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,357,546.86			

US TREASURY N/B-1.5%-21/08/31	2,000,000.00	1,994,101.56
US TREASURY N/B-2.75%-21/09/15	7,500,000.00	7,649,853.00
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,420,624.88
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	2,030,000.00	2,009,462.99
US TREASURY N/B-1.5%-21/09/30	2,000,000.00	1,994,492.18
US TREASURY N/B-2.875%-21/10/15	2,000,000.00	2,046,367.00
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,855,582.86
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	10,411,127.52
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,028,984.00
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	601,312.50
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,151,504.51
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	8,840,000.00	8,813,928.89
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,520,556.50
US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,075,702.80
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,505,664.00
US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,034,570.20
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,804,781.16
US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,028,632.80
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,007,851.30
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,821,375.00
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,005,976.40
US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	500,000.00	505,888.65
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,440,573.35
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,009,433.50
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,531,640.50
US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,011,406.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,967,841.57
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,758,729.62
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	5,000,000.00	4,998,632.80
US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,000,000.00	1,992,617.18
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,912,246.07
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	5,250,000.00	5,247,744.12
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,561,301.42
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	2,013,789.00

US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,020,273.40
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,424,702.96
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	1,999,335.94
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,445,764.76
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,957,661.89
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,006,093.60
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,615,981.97
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,300,000.00	5,359,935.05
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,085,710.92
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	587,823.61
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,990,625.00
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,189,448.51
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,158,821.88
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,732,398.28
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	7,650,000.00	7,674,204.60
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,498,330.08
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,348,927.71
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,960,625.00
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,034,296.80
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	11,000,000.00	10,840,585.91
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,462,415.85
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,830,850.40
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	5,500,000.00	5,439,846.17
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	380,000.00	397,389.44
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,698,140.62
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,168,046.80
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	2,961,947.86
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,895,373.89
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,558,105.25
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,114,550.50
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,047,226.40
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	5,800,000.00	5,995,070.24
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,447,017.31
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	3,500,000.00	3,565,761.50
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,677,658.26

US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,320,825.00
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,027,851.40
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,074,413.80
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	6,007,870.84
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,580,000.00	3,632,860.84
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	4,100,000.00	4,158,456.98
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,668,987.87
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,243,413.65
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,000,000.00	4,013,750.00
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,766,089.02
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,432,425.00
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,100,000.00	2,059,804.69
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,449,124.88
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,000,000.00	1,983,554.68
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,119,144.63
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,450,000.00	5,595,616.91
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,224,937.44
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,951,730.35
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,559,941.35
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,044,161.34
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,169,236.23
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,605,820.12
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,332,644.38
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,901,718.72
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,220,078.12
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	4,000,000.00	4,218,984.00
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	4,000,000.00	4,248,281.20
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	5,294,935.18
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	5,000,000.00	5,351,367.00
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,109,382.66
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,405,335.88
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,101,250.00
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,450,000.00	1,524,142.56
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,254,816.26
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,700,000.00	5,653,798.82

US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,570,000.00	1,639,423.35
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,131,372.18
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,074,687.40
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	5,640,000.00	5,591,421.08
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	4,000,000.00	4,087,968.40
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,013,320.20
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	4,200,000.00	4,227,644.40
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,930,001.76
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	250,000.00	247,597.65
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,216,773.31
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,116,584.31
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,956,093.60
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	3,157,946.29
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	5,259,997.85
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,860,000.00	5,108,468.75
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	6,305,160.08
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,288,359.20
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,580,000.00	2,794,059.24
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	648,623.00
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,800,000.00	5,203,780.80
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	2,000,000.00	2,567,500.00
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	3,560,000.00	3,938,528.03
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,290,429.60
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	3,840,000.00	4,092,674.68
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,100,000.00	4,283,698.86
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,440,000.00	3,366,698.43
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,503,005.37
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,975,904.57
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,250,000.00	1,789,697.25
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,572,690.13
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,220,000.00	1,665,871.81
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,463,860.34
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,500,580.44
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,370,019.40
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,347,504.65

US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,157,803.78
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,833,862.46
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,689,081.51
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,139,580.05
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,184,831.25
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,457,120.28
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	572,890.60
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	862,250.00
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,155,000.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,290,625.00
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,050,000.00	5,555,492.88
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	6,344,099.84
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,686,347.60
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,724,570.20
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	4,065,523.14
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	4,654,652.04
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,716,947.08
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,400,095.60
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,611,812.48
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,853,083.62
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,408,903.98
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,885,804.60
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,576,513.50
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,108,469.71
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,215,234.20
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,175,648.28
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,039,130.45
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,165,898.40
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,077,350.72
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,123,666.97
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,791,359.36
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	4,663,349.43
US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,595,773.29
US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	3,759,486.06
US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,339,081.90

		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,250,000.00	1,224,047.85
米ドル小計			645,890,000.00	678,566,904.27 (74,024,863,586)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-20/11/01	670,000.00	671,748.70
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-21/02/01	825,000.00	830,428.50
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,140,000.00	2,113,485.40
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-21/05/01	890,000.00	891,246.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	973,009.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-21/08/01	640,000.00	638,598.40
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,470,000.00	1,446,494.70
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-21/11/01	960,000.00	952,752.00
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,640,000.00	1,597,474.80
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,007,636.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,520,000.00	1,494,099.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,144,776.60
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,294,683.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	820,000.00	831,504.60
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	811,156.20
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,163,915.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	950,000.00	945,392.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	150,000.00	147,243.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,065,256.90
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,092,751.00
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	536,677.60
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,060,000.00	1,014,049.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,037,000.00	1,068,773.68
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,060,000.00	1,443,296.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	712,047.30
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	310,000.00	298,551.70
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,512,492.10
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	940,000.00	1,399,754.00
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,165,000.00	1,627,202.10
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,315,000.00	1,787,505.80
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,292,480.50
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	513,000.00	544,421.25

		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	440,015.80
加ドル小計			31,934,000.00	34,790,918.53 (2,884,515,055)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	24,668,606.30
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	14,200,000.00	14,388,691.73
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	21,393,627.08
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	2,000,000.00	2,011,780.30
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	17,600,000.00	18,489,469.67
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	7,400,000.00	7,815,003.10
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	24,597,288.92
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	10,132,141.08
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	22,100,000.00	23,079,161.49
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	12,150,000.00	13,587,680.34
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	12,694,422.58
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	7,000,000.00	7,499,816.80
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	10,077,311.01
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	10,400,000.00	11,881,046.84
MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,500,000.00	16,507,973.52		
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	10,870,000.00	11,928,411.35		
メキシコペソ小計			217,170,000.00	230,752,432.11 (1,310,673,814)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,404,421.47
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,200,220.20
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,150,000.00	1,312,492.70
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,190,677.32
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	503,638.17
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,200,000.00	1,370,918.40
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	658,547.19
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,250,000.00	1,331,825.00
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	850,000.00	1,113,194.59

BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,119,965.61
BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	1,070,000.00	1,150,838.50
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,536,176.30
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,040,971.55
BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	590,000.00	643,028.61
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	827,652.75
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	975,695.49
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	370,000.00	421,471.69
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	823,067.70
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,475,000.00	2,513,786.30
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	497,116.66
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	655,000.00	820,842.72
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,370,000.00	2,381,742.67
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,408,453.08
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	937,541.99
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	557,103.15
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	486,649.06
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	545,423.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,700,000.00	1,789,780.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	770,000.00	774,811.73
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,080,000.00	2,263,936.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,760,966.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/10/31	200,000.00	201,885.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,790,000.00	2,042,764.11
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,662,792.66
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,420,000.00	1,454,642.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	1,986,604.43
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	1,290,000.00	1,319,197.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-	1,640,000.00	1,943,839.52

23/10/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,613,057.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,981,012.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	200,000.00	204,041.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,720,000.00	1,970,573.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,900,000.00	2,077,133.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,630,000.00	2,070,108.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,911,739.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,585,000.00	1,784,107.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,750,000.00	2,439,662.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,760,000.00	1,912,551.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,490,000.00	1,644,490.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,705,000.00	1,881,179.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,917,706.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,720,000.00	1,896,527.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	2,089,746.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,080,000.00	3,172,157.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,710,000.00	1,895,454.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,110,000.00	1,140,903.51	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,770,000.00	2,062,428.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,811,349.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-	1,450,000.00	1,786,608.80	

33/07/30		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	730,000.00	851,788.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,431,946.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,487,263.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,570,000.00	2,715,881.77
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,180,000.00	2,233,426.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,320,000.00	1,851,375.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	785,000.00	1,071,022.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	605,000.00	986,370.22
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,211,245.20
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	749,447.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,410,000.00	1,463,238.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,842,735.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,664,597.94
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,117,463.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,631,130.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,699,721.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,036,458.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,852,338.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,037,253.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,019,689.41
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,356,480.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-	1,950,000.00	2,139,426.90

24/05/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,972,304.46
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,872,419.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,772,638.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,943,076.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,800,000.00	2,899,696.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,663,963.37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,743,660.39
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,420,000.00	2,605,137.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,730,121.29
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,645,000.00	1,774,042.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,310,000.00	1,905,677.43
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	2,170,000.00	2,294,440.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,160,000.00	1,226,455.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,154,567.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,842,525.63
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,730,000.00	2,996,989.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,005,000.00	3,421,755.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,160,000.00	2,135,961.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,300,000.00	2,576,428.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	2,097,394.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-	2,660,000.00	4,198,892.46

44/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,940,000.00	3,129,214.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	1,500,000.00	1,943,917.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	260,000.00	243,022.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	1,180,000.00	1,190,325.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	1,000,000.00	1,052,548.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 21/04/15	1,170,000.00	1,174,168.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,270,446.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,515,000.00	1,529,404.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,580,000.00	2,754,138.13	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,270,000.00	2,470,874.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.3%- 21/10/15	880,000.00	921,139.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	777,047.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,110,283.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	1,950,000.00	2,180,490.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,432,117.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	1,002,673.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	600,000.00	616,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,301,509.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,800,000.00	2,079,752.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,364,131.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-	2,000,000.00	2,324,650.00	

22/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	935,198.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,233,692.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,571,259.69	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,988,881.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,460,000.00	1,586,247.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,080,000.00	1,101,124.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,190,000.00	2,954,320.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,947,188.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	995,000.00	1,063,834.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	180,000.00	191,574.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,739,998.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,050,000.00	1,105,372.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,546,692.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	2,780,000.00	3,442,465.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	675,000.00	709,454.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,475,783.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,447,074.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,236,566.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,776,851.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,307,862.69	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-	720,000.00	786,916.49	

26/07/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,560,000.00	2,256,627.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,528,657.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	950,274.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,035,000.00	1,132,523.91	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,560,000.00	3,679,646.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,035,000.00	1,131,613.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,760,000.00	2,336,848.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,435,000.00	1,668,474.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,200,000.00	1,420,927.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	4,011,516.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	2,146,216.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,680,000.00	4,059,007.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,551,572.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,655,875.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	690,000.00	780,235.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	3,037,561.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	650,000.00	808,106.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	987,029.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,645,337.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	811,545.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-	1,850,000.00	2,835,662.79	

39/08/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	310,000.00	375,556.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,794,351.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	2,015,809.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,320,000.00	1,666,535.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,470,477.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,455,000.00	1,901,085.54
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	785,000.00	1,089,948.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	769,732.52
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	741,871.20
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	319,213.20
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	589,636.57
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	255,148.75
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	578,384.56
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	520,000.00	652,511.60
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	343,650.56
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	432,093.26
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	364,789.89
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	476,998.42
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	420,000.00	444,619.56
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	200,000.00	211,564.00
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	368,450.18
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	330,000.00	375,305.04
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	532,924.58
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	225,000.00	279,264.66
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,472,050.00
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,150,637.40
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,220,126.96
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,109,884.72
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,985,702.50

FRANCE (GOVT OF) -0.0%-23/03/25	180,000.00	183,605.94	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	960,000.00	1,266,249.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,423,976.92	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,689,146.31	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,537,571.10	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,090,954.80	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	3,410,000.00	3,585,192.16	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,124,969.64	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,515,013.20	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,430,000.00	4,295,488.81	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	3,000,000.00	3,163,746.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	2,960,000.00	3,072,515.52	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	3,910,000.00	4,279,964.20	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,730,000.00	4,626,596.88	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,096,087.12	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	2,920,000.00	3,149,599.60	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,211,948.86	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	1,670,000.00	1,761,153.61	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,950,000.00	3,731,721.96	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,965,000.00	4,622,424.75	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,520,000.00	4,352,805.82	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,345,000.00	2,681,079.53	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,670,000.00	4,486,358.28	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,585,000.00	2,955,696.75	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,677,097.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	1,925,000.00	2,388,158.85	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,745,000.00	4,983,289.47	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	2,030,000.00	3,273,854.08	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	2,340,000.00	3,103,055.28	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,000,000.00	1,189,575.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,196,448.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	930,000.00	1,907,008.80	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	1,067,675.40	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	494,786.64	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,488.40	

IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	654,185.58	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	781,072.60	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,258,525.01	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,103,703.49	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	663,714.15	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	200,000.00	219,770.60	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	977,107.55	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	390,000.00	439,842.78	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	398,832.20	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	500,000.00	592,967.25	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	685,000.00	877,954.22	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	283,000.00	325,275.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,556,694.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	709,724.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,327,395.09	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	405,496.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,149,339.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,033,955.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	184,251.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,770,418.44	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,327,593.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,267,946.38	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,326,338.73	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,770,329.16	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	906,000.00	986,688.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	495,000.00	516,302.32	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,457,636.29	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,230,000.00	2,057,283.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	595,000.00	632,302.33	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,165,000.00	2,080,738.93	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,073,000.00	1,787,343.52	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	202,775.03	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	638,067.65	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,356,541.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	768,123.73	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,054,793.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	458,939.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,167,667.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	944,695.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	985,229.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	933,616.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	1,029,843.36	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	722,912.01	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	740,000.00	1,112,715.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	550,000.00	592,329.64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	575,082.36	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	751,138.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,074,000.00	1,782,740.76	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	559,000.00	912,966.62	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	640,000.00	797,761.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	628,036.71	
	ユーロ小計		387,830,000.00	476,232,771.23	(57,486,057,815)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	495,000.00	589,327.20	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,049,883.03	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,139,495.04	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,174,451.70	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,188,581.24	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,050,000.00	2,120,931.64	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,716,113.49	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	930,000.00	949,269.60	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,034,272.69	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,612,572.84	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,585,312.32	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,410,000.00	1,480,549.35	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,534,873.90	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,350,000.00	1,461,993.16	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,472,000.00	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	200,000.00	202,310.20	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,195,000.00	1,700,572.95	

		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,765,134.00	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	1,754,000.00	2,601,139.90	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,464,711.25	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	645,000.00	706,763.06	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,285,748.46	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,916,670.48	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,415,000.00	2,217,912.03	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,465,000.00	2,427,220.79	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,356,474.50	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,580,606.18	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,425,000.00	2,402,275.68	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,660,000.00	1,750,971.32	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	400,000.00	446,968.00	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,145,000.00	2,001,418.78	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,327,000.00	2,227,575.18	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	145,000.00	161,253.05	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,480,000.00	2,799,212.80	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,259,007.75	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,323,202.08	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	3,090,700.88	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,665,000.00	1,664,643.69	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,638,596.05	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	962,273.77	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,679,048.34	
英債券小計			51,538,000.00	68,742,038.37	(9,658,256,390)
スウェーデン ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,195,000.00	7,611,838.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	7,700,000.00	8,478,069.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,728,090.24	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,481,327.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,690,000.00	5,076,456.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,806,758.72	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,739,184.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,575,000.00	5,700,343.21	
			40,270,000.00	45,622,067.37	

スウェーデンクローナ小計				(515,073,140)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,270,000.00	6,510,391.80
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,370,000.00	5,504,974.95
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,420,000.00	3,667,458.88
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,338,768.10
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,275,207.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	2,903,070.72
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,540,000.00	2,647,990.64
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,900,000.00	1,943,909.00
ノルウェークローネ小計			28,860,000.00	29,791,771.09 (353,926,240)
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	7,459,964.82
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,224,758.24
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,040,000.00	9,169,044.33
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	4,479,517.12
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,500,000.00	1,621,335.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,770,000.00	18,792,438.68
デンマーククローネ小計			37,040,000.00	48,747,058.19 (787,752,460)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,310,000.00	2,333,573.55
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-21/05/25	740,000.00	725,043.08
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,446,171.65
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,060,000.00	1,148,939.30
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,321,279.40
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,970,000.00	2,202,666.85
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,160,480.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,474,981.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,030,000.00	2,099,730.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	520,000.00	532,220.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,330,000.00	2,506,381.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	3,006,720.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,689,456.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,240,000.00	2,370,368.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,147,242.42
POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,120,000.00	1,194,200.00		

ポーランドズロチ小計			29,745,000.00	31,359,452.75 (887,786,107)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	1,390,000.00	1,402,170.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,080,000.00	2,232,555.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,387,085.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,850,000.00	2,090,302.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,020,000.00	1,062,633.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,920,000.00	2,222,246.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,090,000.00	2,258,671.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,200,000.00	2,466,366.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,560,000.00	3,072,686.33	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,937,079.17	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,515,820.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,080,000.00	2,261,983.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,900,000.00	2,153,614.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,090,000.00	2,472,842.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,570,000.00	1,799,405.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,490,000.00	1,679,156.99	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	815,000.00	837,228.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,594,299.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	640,000.00	758,499.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,249,451.93	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	845,944.57			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	400,000.00	477,205.15			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	1,251,388.80			
豪ドル小計			35,747,000.00	41,028,640.17 (3,082,071,449)	
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	616,408.05	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	558,000.00	555,081.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	310,000.00	311,798.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	470,000.00	490,727.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	320,000.00	322,240.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	595,000.00	620,466.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	100,000.00	101,782.96	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	575,370.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	260,000.00	270,660.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	300,000.00	309,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	608,310.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	415,000.00	445,710.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	350,000.00	385,397.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	365,145.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	527,856.77	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	256,000.00	268,672.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	142,865.88	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	425,437.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	510,000.00	580,930.80	
シンガポールドル小計			7,417,000.00	7,923,858.87	(635,889,674)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	467,862.59	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	858,797.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	650,000.00	661,015.16	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	773,871.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	816,040.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	175,000.00	176,427.24	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	630,000.00	650,002.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	328,167.39	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,009,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	480,000.00	494,606.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	463,050.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	650,000.00	669,825.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	300,000.00	311,100.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	775,066.87	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	635,287.32	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,280,220.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	440,000.00	503,043.68	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	680,755.03	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	920,000.00	1,028,331.84	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	700,000.00	806,721.51	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,780,000.00	1,811,061.00			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	855,949.32			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,764,862.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	974,545.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,343,535.41	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	464,153.22	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	654,004.91	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	611,160.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	851,777.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,308,252.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,095,730.48	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	470,555.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	995,112.28	
マレーシアリングット小計			25,310,000.00	26,590,290.76	(701,983,676)
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	4,654,969.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	8,280,000.00	8,363,339.43	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	17,250,000.00	19,170,428.70	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	10,000,000.00	9,283,059.49	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	8,077,275.36	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	8,920,000.00	8,161,487.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	8,410,000.00	7,864,732.17	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,968,916.36	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	10,200,000.00	9,075,765.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	7,560,000.00	6,923,672.15	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,197,363.24	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	10,650,000.00	9,421,581.07	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	18,100,000.00	15,963,077.80	
			129,370,000.00	118,125,668.67	

南アフリカランド小計		(874,129,948)	
合計		153,202,979,354 (153,202,979,354)	

(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 211銘柄	100.0%	48.3%
加ドル	国債証券 33銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 280銘柄	100.0%	37.5%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.3%
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 16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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年11月29日現在です。

【DCインデックスバランス(株式40)】

【純資産額計算書】

資産総額	7,772,483,112円
負債総額	8,261,963円
純資産総額(-)	7,764,221,149円
発行済口数	3,970,397,542口
1口当たり純資産額(/)	1.9555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	33,274,898,293円
負債総額	30,514,223円
純資産総額(-)	33,244,384,070円
発行済口数	21,101,059,032口
1口当たり純資産額(/)	1.5755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	215,411,226,036円
負債総額	4,304,920,995円
純資産総額(-)	211,106,305,041円
発行済口数	76,820,516,282口
1口当たり純資産額(/)	2.7480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	43,001,468,530円
負債総額	702,772,418円
純資産総額（ - ）	42,298,696,112円
発行済口数	29,603,212,496口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4289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	156,186,339,427円
負債総額	274,359,964円
純資産総額（ - ）	155,911,979,463円
発行済口数	66,254,406,304口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3532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なわないものとします。

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2019年11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11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11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11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	832	202,219
株式投資信託	784	172,232
単位型	259	8,949
追加型	525	163,282
公社債投資信託	48	29,987
単位型	34	910
追加型	14	29,076

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
有価証券		3
前払費用		14,024
未収入金		19
未収委託者報酬		551
未収収益	3	73
関係会社短期貸付金		15,873
立替金		16,867
その他	2,3	3,174
流動資産合計		41,800
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	68
器具備品	1	122
有形固定資産合計		191
無形固定資産		
ソフトウェア		99

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</p> <p>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)</p> <p>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。</p> <p>なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table> <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の翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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)	
(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更) 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。 この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」1,014百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,504百万円に含めて表示しております。	

(貸借対照表関係)

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-

(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 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tockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

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

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

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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	<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</p> <p>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）</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>

<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ため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2019年9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9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	
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	

日本生命保険相互会社	100,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
富国生命保険相互会社	12,000百万円 (基金の総額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

(4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者

の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式40）の2018年11月7日から2019年11月6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、DCインデックスバランス（株式40）の2019年11月6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に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。