

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年3月16日提出
【計算期間】	第29特定期間(自 2019年6月18日至 2019年12月16日)
【ファンド名】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		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		
	日々			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券、不動産投 信)))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

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

年12回(毎月)

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色



1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

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



2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

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



3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

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

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

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



「財産3分法」とは？

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

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

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行いません。

[世界の財産3分法ファンド]
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス
(円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2019年12月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

各資産の値動きの特徴

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

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

ご参考：設定来のファンドと各資産の推移(マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)～2019年12月、月末値)

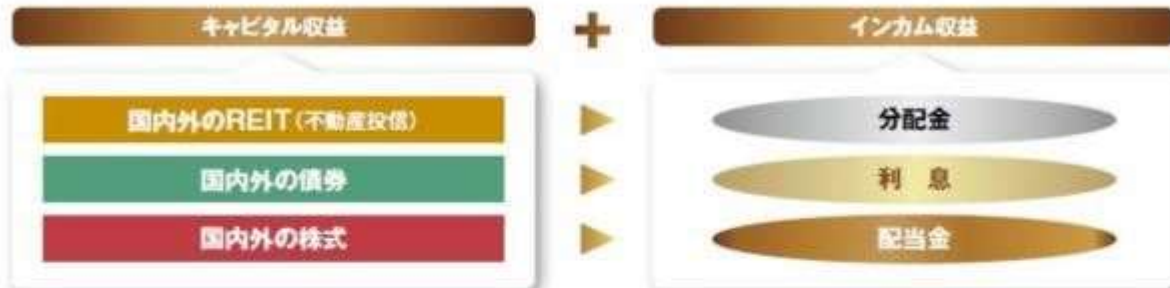


※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したもものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。
 ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。
 ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



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

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



ご参考:各指数の利回り

(2019年12月末現在)



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

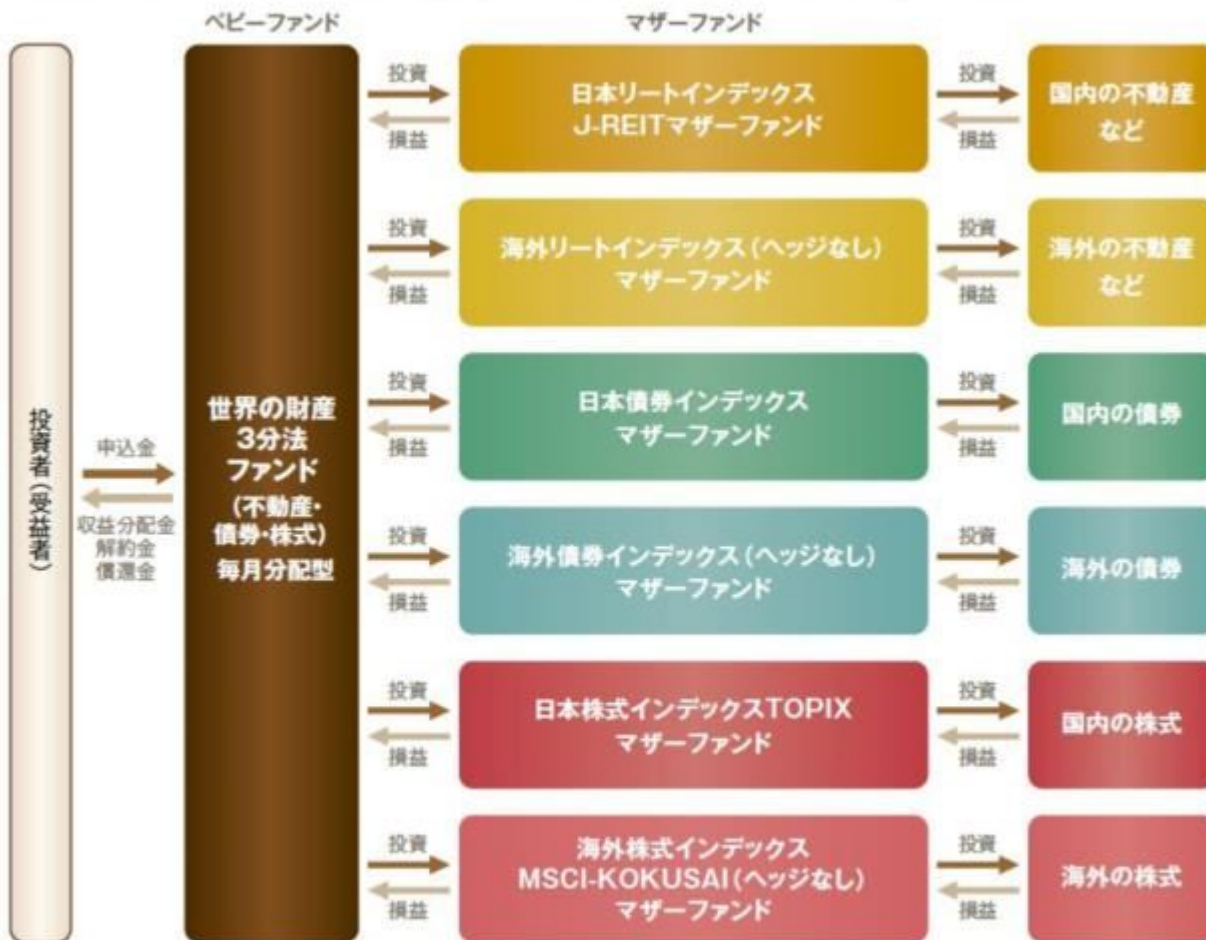
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

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

■ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

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

(分配方針)

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

収益分配金に関する留意事項

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

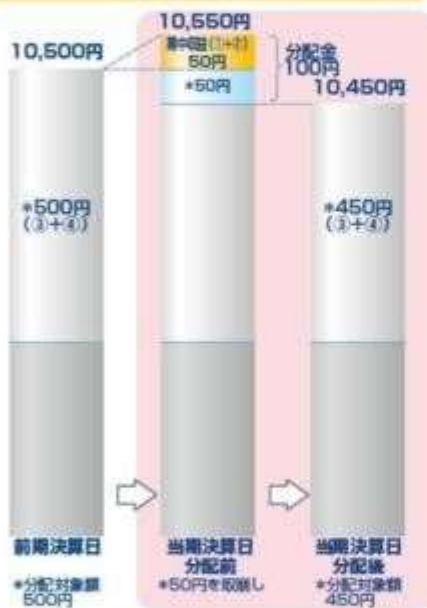
投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

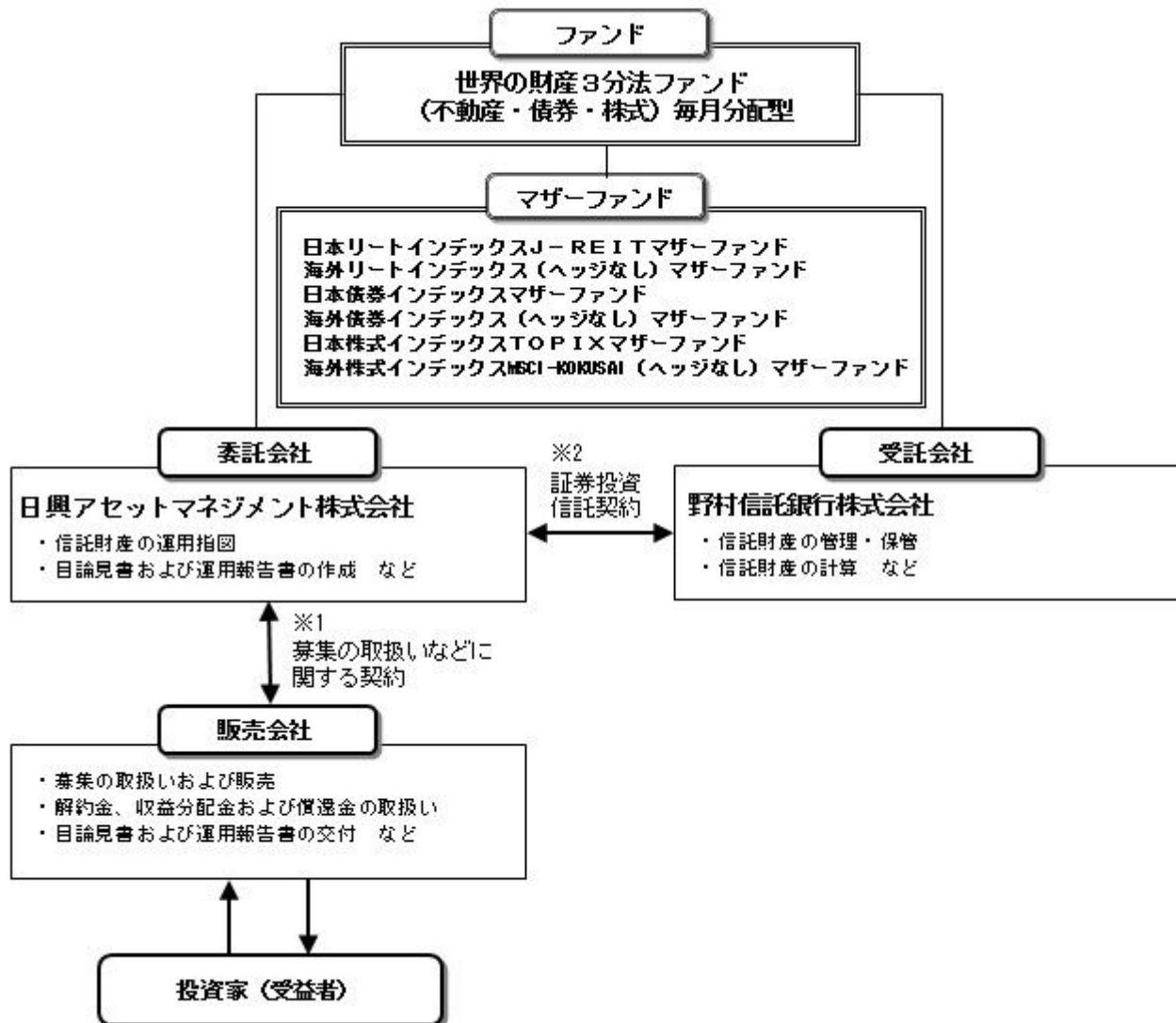
・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

（3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2019年12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、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。
 - 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
- ・特に「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低いため、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
- 2) 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
- 6) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
- 7) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
- 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)

- 10) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

ます。）

- 4) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 5) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

- 1) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）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。）に限りません。）
- 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せん。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

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

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 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せん。）
- 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せん。）
- 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せん。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）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せん。）
- 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せん。）
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡し取引
- 5) 為替先渡し取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引

投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ - REITマザーファンド>

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

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

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

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

< 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI 総合 [*] 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定されます。

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。

<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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（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	

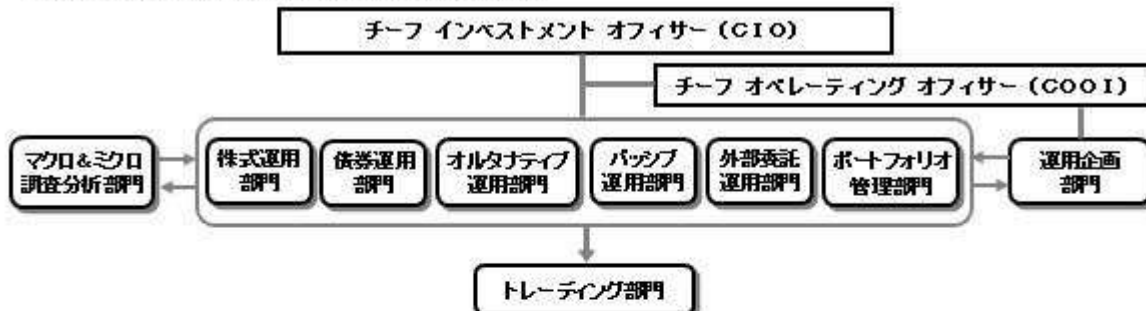
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* 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。

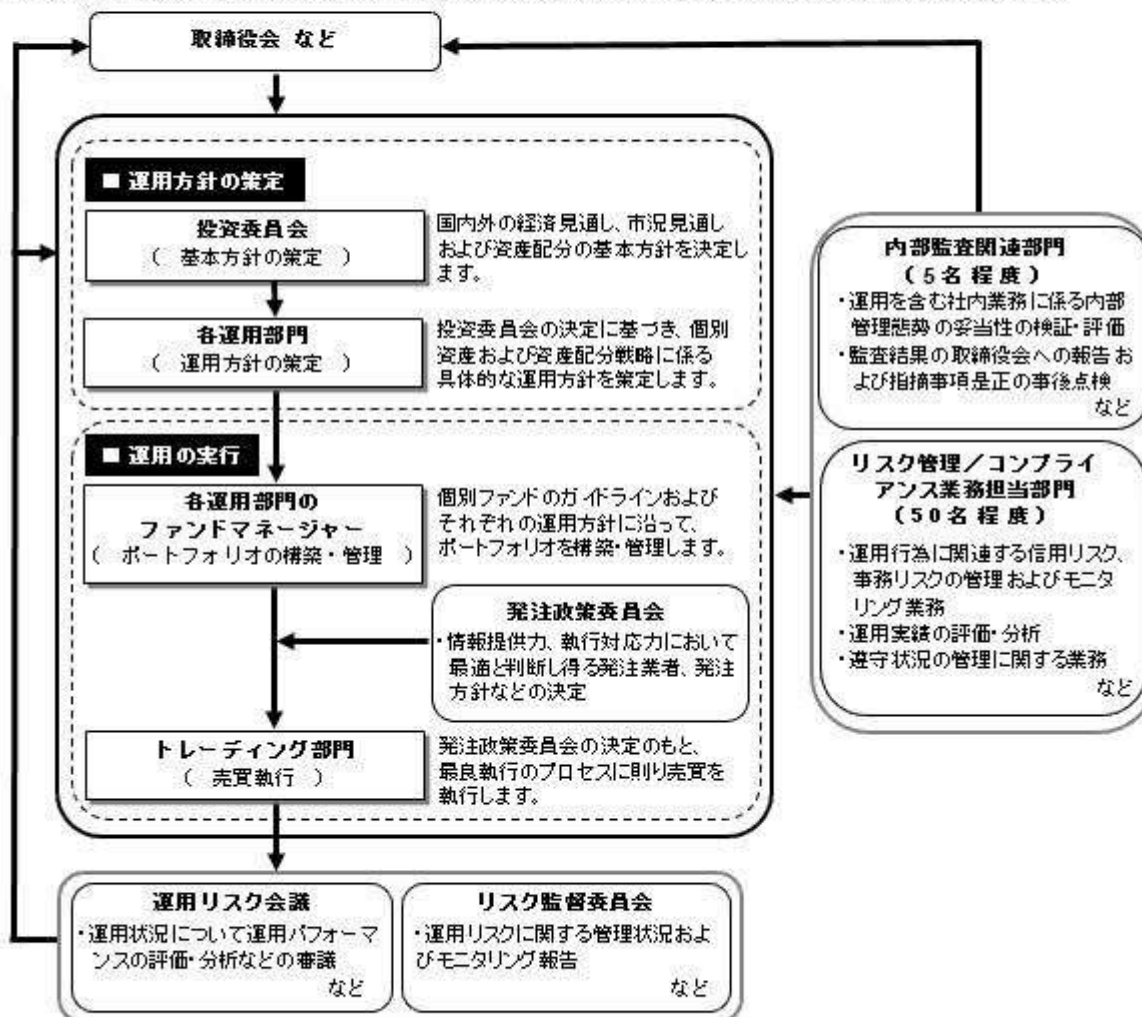
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（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12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、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

３）留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

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

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

３）投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

５）信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

６）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ）解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

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

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

７）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド>

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

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 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。

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、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<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、公社債の借入の指図をすることができます。公社債の借入の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

する要因となります。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

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

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

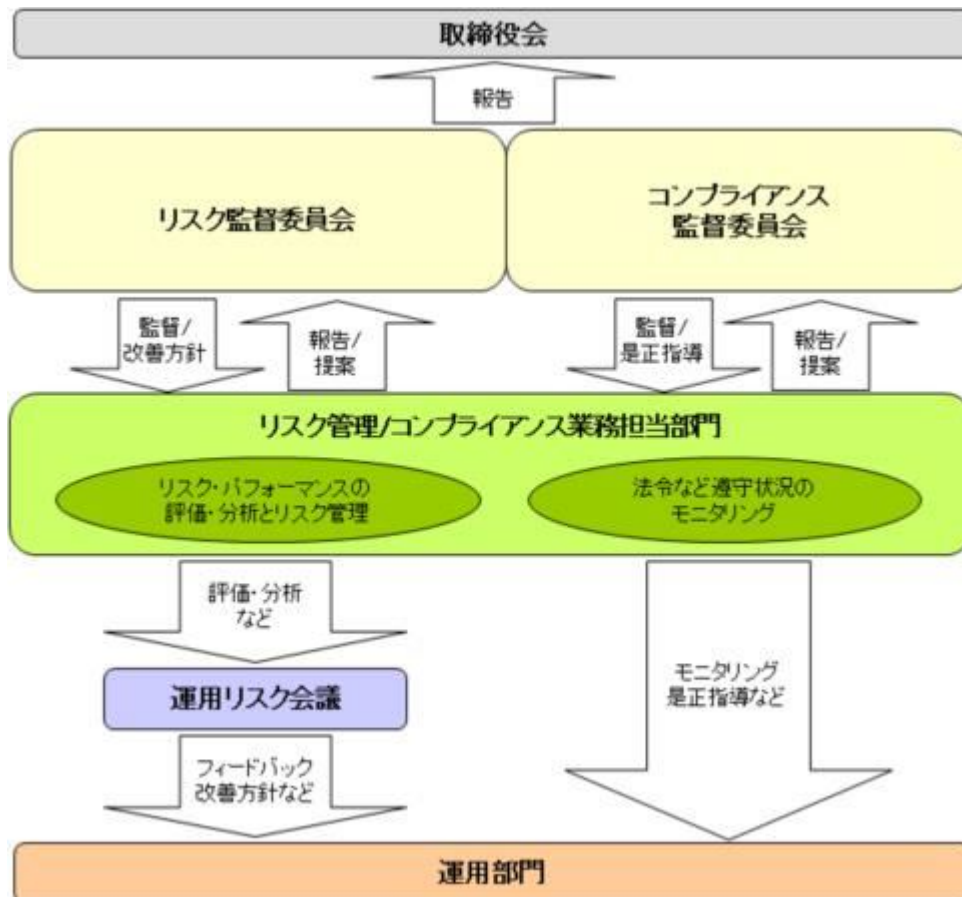
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（２）リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

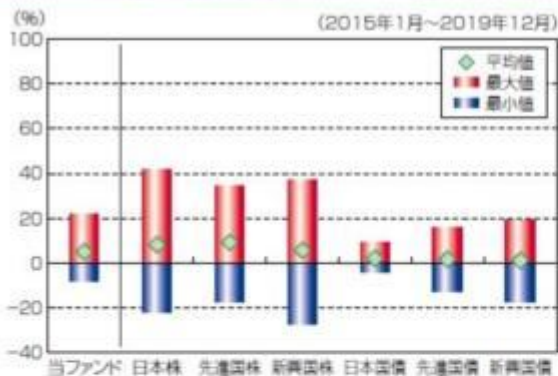
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2019年12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	5.0%	8.2%	9.2%	5.6%	2.1%	1.7%	1.1%
最大値	22.0%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.9%	19.3%
最小値	-7.8%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2015年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.045%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

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

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに依りて異なり、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依りて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

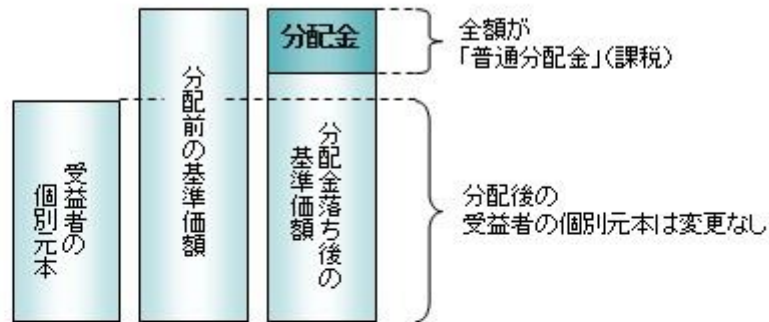
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

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

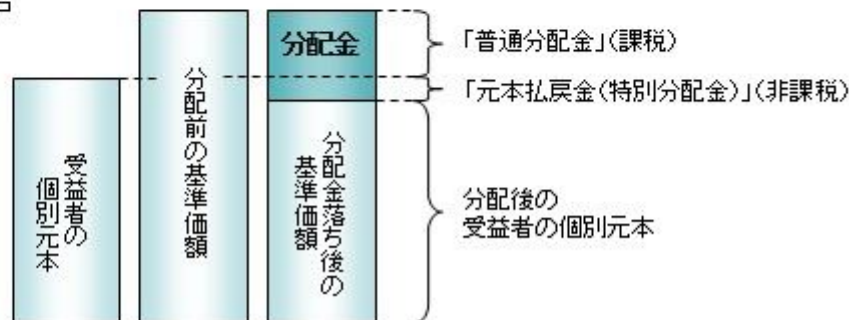
者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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3月16日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2019年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	32,314,082,784	98.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		634,115,040	1.92
合計（純資産総額）		32,948,197,824	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	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1,974,359,590	2.7650	5,459,104,267	2.8313	5,590,004,307	16.97
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,413,364,198	1.6103	5,496,540,369	1.5984	5,455,921,334	16.56
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,374,795,851	2.2265	5,287,482,963	2.2811	5,417,146,815	16.44
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,264,031,613	2.3620	5,347,642,670	2.3637	5,351,491,523	16.24
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,117,390,908	2.4731	5,236,519,454	2.5237	5,343,659,434	16.22
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	3,618,654,809	1.4249	5,156,221,237	1.4248	5,155,859,371	15.65

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.08
合計	98.08

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第10特定期間末 (2010年 6月15日)	96,496	97,363	0.5569	0.5619
第11特定期間末 (2010年12月15日)	88,713	89,187	0.5612	0.5642
第12特定期間末 (2011年 6月15日)	76,898	77,323	0.5427	0.5457
第13特定期間末 (2011年12月15日)	59,790	60,171	0.4709	0.4739
第14特定期間末 (2012年 6月15日)	55,918	56,146	0.4910	0.4930
第15特定期間末 (2012年12月17日)	55,668	55,874	0.5402	0.5422
第16特定期間末 (2013年 6月17日)	57,765	57,856	0.6378	0.6388
第17特定期間末 (2013年12月16日)	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18特定期間末 (2014年 6月16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19特定期間末 (2014年12月15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20特定期間末 (2015年 6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末 (2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末 (2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779

第23特定期間末	(2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末	(2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末	(2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末	(2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末	(2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末	(2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末	(2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
	2018年12月末日	30,433		0.8107	
	2019年 1月末日	31,566		0.8416	
	2月末日	32,054		0.8580	
	3月末日	32,234		0.8699	
	4月末日	32,210		0.8748	
	5月末日	31,415		0.8523	
	6月末日	31,858		0.8643	
	7月末日	32,235		0.8778	
	8月末日	32,013		0.8711	
	9月末日	32,603		0.8937	
	10月末日	33,148		0.9159	
	11月末日	33,093		0.9205	
	12月末日	32,948		0.9197	

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

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	0.0310
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	0.0240
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.0180
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	0.0180
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	0.0130
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	0.0120
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	0.0070
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060

第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	1.75
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	5.08
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.09
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	9.91
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	7.03
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	12.46
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	19.36
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	10,739,262,952	10,086,629,772
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	3,738,112,212	18,933,404,132
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	1,451,825,844	17,852,733,674
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	1,137,780,912	15,842,664,215
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	787,842,918	13,892,127,349
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	645,492,480	11,463,657,624

第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	755,347,566	13,250,917,932
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563

（参考）

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2019年12月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	117,689,171,160	98.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,250,176,147	1.05
合計（純資産総額）		118,939,347,307	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	10,407	786,095.67	8,180,897,687	795,000	8,273,565,000	6.96
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	10,747	697,570.09	7,496,785,768	720,000	7,737,840,000	6.51
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	34,693	182,847.84	6,343,540,271	185,600	6,439,020,800	5.41
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	21,413	219,913.46	4,709,007,060	235,300	5,038,478,900	4.24
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	24,130	197,774.74	4,772,304,671	203,600	4,912,868,000	4.13

日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	20,311	228,301.59	4,637,033,752	233,300	4,738,556,300	3.98
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	15,440	272,842.21	4,212,683,766	276,400	4,267,616,000	3.59
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	14,488	281,665.6	4,080,771,264	283,600	4,108,796,800	3.45
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	26,766	132,037.37	3,534,112,286	134,900	3,610,733,400	3.04
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	10,193	337,726.35	3,442,444,707	344,000	3,506,392,000	2.95
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	6,803	490,814.45	3,339,010,758	476,500	3,241,629,500	2.73
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	5,385	520,229.85	2,801,437,753	544,000	2,929,440,000	2.46
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	47,140	62,730.97	2,957,138,355	61,900	2,917,966,000	2.45
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	31,422	88,789.48	2,789,943,239	91,400	2,871,970,800	2.41
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	34,620	86,115.24	2,981,309,793	81,200	2,811,144,000	2.36
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,324	802,869.18	2,668,737,169	838,000	2,785,512,000	2.34
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	3,571	645,401.36	2,304,728,266	686,000	2,449,706,000	2.06
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	13,841	151,662.71	2,099,163,651	165,700	2,293,453,700	1.93
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	12,364	165,773.53	2,049,623,989	180,500	2,231,702,000	1.88
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	2,480	808,016.08	2,003,879,890	834,000	2,068,320,000	1.74
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	7,022	263,620.34	1,851,142,080	277,100	1,945,796,200	1.64
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	9,139	193,588.96	1,769,209,586	197,200	1,802,210,800	1.52
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	3,817	470,017.45	1,794,056,626	456,500	1,742,460,500	1.46
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	11,598	143,089.81	1,659,555,707	148,700	1,724,622,600	1.45
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	9,623	171,129.71	1,646,781,267	175,800	1,691,723,400	1.42
日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	3,491	449,762.72	1,570,121,658	478,000	1,668,698,000	1.40
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	13,788	113,010.12	1,558,183,564	118,000	1,626,984,000	1.37
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	9,992	147,124.2	1,470,065,076	161,300	1,611,709,600	1.36
日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	69,042	19,689.8	1,359,423,546	22,480	1,552,064,160	1.30
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	4,475	329,713.69	1,475,468,804	344,000	1,539,400,000	1.29

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.95
合計	98.95

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2019年12月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	83,976,729,262	72.92
	カナダ	2,210,600,146	1.92
	ドイツ	328,413,391	0.29
	イタリア	26,175,963	0.02
	フランス	4,177,903,965	3.63
	オランダ	293,018,290	0.25
	スペイン	772,640,192	0.67
	ベルギー	1,235,445,083	1.07
	アイルランド	162,699,044	0.14
	イギリス	6,272,251,463	5.45
	オーストラリア	7,717,235,632	6.70
	ニュージーランド	254,141,318	0.22
	香港	2,200,452,183	1.91
	シンガポール	4,741,444,810	4.12
	韓国	13,465,910	0.01
	イスラエル	87,953,767	0.08
	ガーンジー	232,326,096	0.20
マン島	40,146,205	0.03	
	小計	114,743,042,720	99.63
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		420,354,139	0.37
合計（純資産総額）		115,163,396,859	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,241,998,500	1.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	493,111	9,278.18	4,575,174,542	9,714.68	4,790,418,134	4.16
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	66,613	62,712.56	4,177,472,048	63,818.69	4,251,155,063	3.69
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	239,683	17,014.30	4,078,040,317	16,169.96	3,875,664,619	3.37
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	316,804	9,340.97	2,959,257,465	8,869.97	2,810,044,384	2.44
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	117,409	25,815.17	3,030,934,158	23,187.27	2,722,395,170	2.36
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	109,060	23,139.90	2,523,637,600	22,880.51	2,495,348,464	2.17
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	272,485	9,036.36	2,462,273,078	8,868.88	2,416,637,312	2.10
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	162,956	13,356.70	2,176,555,108	12,947.80	2,109,921,827	1.83
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	254,510	8,173.15	2,080,149,985	8,025.27	2,042,511,468	1.77
香港	投資証券	LINK REIT	1,637,800	1,248.63	2,045,017,543	1,149.51	1,882,682,218	1.63
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	107,565	16,497.49	1,774,553,085	17,278.13	1,858,523,129	1.61
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	291,130	7,269.65	2,116,414,964	6,335.85	1,844,557,408	1.60
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	51,614	34,065.54	1,758,258,992	32,838.41	1,694,922,148	1.47
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	112,264	14,621.73	1,641,494,413	15,084.22	1,693,414,964	1.47
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	89,977	16,754.15	1,507,488,499	17,573.42	1,581,203,971	1.37
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	386,545	3,709.81	1,434,012,183	3,723.94	1,439,472,088	1.25
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	421,106	3,180.68	1,339,404,205	3,233.11	1,361,484,378	1.18
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,253,499	1,111.28	1,392,991,230	1,051.38	1,317,909,795	1.14
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	89,191	13,907.39	1,240,414,666	14,242.80	1,270,329,575	1.10
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	4,172,144	297.14	1,239,717,393	300.72	1,254,662,163	1.09
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	72,434	15,860.18	1,148,816,916	16,341.96	1,183,714,226	1.03
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	134,879	9,406.29	1,268,712,325	8,719.88	1,176,128,748	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	229,128	5,188.15	1,188,750,617	5,077.01	1,163,285,239	1.01
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	101,340	12,115.76	1,227,811,833	11,450.11	1,160,354,715	1.01
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	560,295	1,914.42	1,072,640,445	2,066.30	1,157,738,455	1.01
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	856,537	1,142.51	978,604,267	1,290.74	1,105,571,775	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	142,370	7,252.24	1,032,502,161	7,615.51	1,084,220,956	0.94
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	287,170	3,663.94	1,052,174,011	3,762.29	1,080,416,934	0.94
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	360,789	2,532.47	913,688,146	2,765.29	997,687,801	0.87
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	406,031	2,110.69	857,005,696	2,268.98	921,279,304	0.80

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.63
合計	99.63

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	8,300,000.00	908,459,900	908,850,000	0.79
	加ドル	買建	300,000.00	25,113,600	25,125,000	0.02
	ユーロ	買建	650,000.00	79,608,750	79,644,500	0.07
	英ポンド	買建	500,000.00	71,699,000	71,720,000	0.06
	豪ドル	買建	1,100,000.00	84,143,400	84,139,000	0.07
	香港ドル	買建	1,700,000.00	23,877,180	23,902,000	0.02
	シンガポールドル	買建	600,000.00	48,576,300	48,618,000	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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12月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	32,601,814,724	76.43
地方債証券	日本	2,961,477,000	6.94
特殊債券	日本	4,172,059,000	9.78
社債券	日本	2,754,054,000	6.46
	オーストラリア	100,068,000	0.23
	小計	2,854,122,000	6.69
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		66,525,001	0.16
合計(純資産総額)		42,655,997,725	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	102.57	718,053,000	0.300	2025/12/20	1.68
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	102.61	625,975,900	101.50	619,192,700	0.100	2026/12/20	1.45
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	508,000,000	121.91	619,343,440	120.60	612,653,080	1.700	2032/9/20	1.44
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.14	560,820,794	100.14	560,820,794	0.100	2020/6/20	1.31
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	430,000,000	119.76	514,976,600	118.54	509,756,400	1.500	2033/3/20	1.20

日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.74	508,330,900	102.98	504,606,900	0.500	2024/9/20	1.18
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	490,000,000	102.86	504,043,400	101.60	497,854,700	0.100	2027/12/20	1.17
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	102.75	503,475,000	101.52	497,467,600	0.100	2027/3/20	1.17
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	480,000,000	102.82	493,545,600	101.56	487,531,200	0.100	2028/3/20	1.14
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	393,000,000	122.66	482,069,350	121.54	477,663,990	2.100	2030/3/20	1.12
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	119.38	477,544,000	2.200	2028/11/28	1.12
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	102.77	447,062,550	101.53	441,659,850	0.100	2028/6/20	1.04
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.95	436,590,000	103.04	432,789,000	0.400	2025/9/20	1.01
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	355,000,000	122.68	435,538,850	121.47	431,250,450	1.700	2033/6/20	1.01
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	103.60	404,067,300	102.77	400,818,600	0.400	2025/3/20	0.94
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	390,000,000	102.71	400,592,400	101.48	395,803,200	0.100	2028/9/20	0.93
日本	国債証券	第124回利付国債(20年)	320,000,000	122.73	392,767,800	121.70	389,459,200	2.000	2030/12/20	0.91
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	140.30	387,244,560	139.28	384,434,880	2.400	2038/9/20	0.90
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	103.77	383,978,600	102.91	380,767,000	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	102.10	377,781,100	101.72	376,378,800	1.300	2021/3/20	0.88
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.28	354,632,300	120.67	349,945,900	2.100	2029/9/20	0.82
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.18	351,543,000	115.73	347,205,000	2.300	2026/6/20	0.81
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.27	325,900,726	100.27	325,900,726	0.100	2020/9/20	0.76
日本	国債証券	第130回利付国債(20年)	270,000,000	121.66	328,490,900	120.50	325,358,100	1.800	2031/9/20	0.76
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	105.19	310,316,400	104.55	308,425,450	1.400	2022/12/20	0.72
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	105.32	300,164,850	104.62	298,181,250	0.500	2038/3/20	0.70
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	117.88	294,712,500	116.31	290,790,000	2.300	2026/9/20	0.68
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	139.87	279,750,000	139.11	278,238,000	2.200	2041/3/20	0.65
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	133.38	277,434,560	132.20	274,980,160	2.400	2034/3/20	0.64
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	120.29	276,669,500	119.03	273,775,900	1.600	2032/6/20	0.64

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.43
地方債証券	6.94
特殊債券	9.78
社債券	6.69

合 計	99.84
-----	-------

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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	74,573,597,303	47.49
	カナダ	2,982,344,849	1.90
	メキシコ	1,367,748,814	0.87
	ドイツ	9,851,103,784	6.27
	イタリア	13,881,100,375	8.84
	フランス	15,350,128,535	9.78
	オランダ	2,883,501,025	1.84
	スペイン	8,769,681,151	5.58
	ベルギー	3,681,193,132	2.34
	オーストリア	2,166,609,338	1.38
	フィンランド	875,655,810	0.56
	アイルランド	1,104,102,577	0.70
	イギリス	10,059,760,582	6.41
	スウェーデン	539,247,987	0.34
	ノルウェー	377,784,623	0.24
	デンマーク	771,173,132	0.49
	ポーランド	915,917,020	0.58
	オーストラリア	3,064,194,433	1.95
	シンガポール	657,951,907	0.42
	マレーシア	721,160,867	0.46
南アフリカ	954,522,617	0.61	
	小計	155,548,479,861	99.06
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,483,690,478	0.94
合計（純資産総額）		157,032,170,339	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		373,792,260	0.24
	売建		80,353,761	0.05

(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	11,045.01	1,309,939,076	2.125	2021/8/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	10,805.14	1,188,565,513	10,809.42	1,189,036,273	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	1,142,088,080	12,243.75	1,132,547,549	8.000	2021/11/15	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	11,028.53	1,069,768,348	11,032.39	1,070,142,005	1.875	2022/7/31	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,840,000	10,923.26	965,616,219	10,935.24	966,675,527	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	11,000.08	841,506,148	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	11,163.99	837,299,399	2.750	2021/9/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	13,715.96	702,257,652	13,609.61	696,812,538	3.625	2043/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	11,373.26	693,769,416	11,300.08	689,305,266	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	11,309.28	671,771,658	11,262.85	669,013,495	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	11,039.88	667,912,820	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	11,338.38	657,626,597	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,341.81	657,825,174	11,319.13	656,509,606	2.500	2024/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,223.00	647,819,060	12,148.74	643,883,641	2.875	2045/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	13,989.01	629,505,636	13,877.95	624,508,040	3.750	2043/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,907.42	621,723,257	10,870.62	619,625,352	1.625	2026/2/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,815,000	22,483.66	632,915,180	21,893.36	616,298,198	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,450,000	11,270.77	614,256,979	11,247.01	612,962,521	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	10,924.24	616,127,146	10,859.49	612,475,410	1.625	2026/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	12,183.20	615,251,609	12,093.54	610,723,803	2.875	2043/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,305.22	599,176,793	11,288.95	598,314,849	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	10,848.15	596,648,618	1.375	2023/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,088.66	587,699,483	11,083.53	587,427,324	2.000	2023/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,065.56	586,474,680	11,066.20	586,508,649	2.250	2021/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,766.14	588,307,236	11,712.86	585,643,120	3.000	2025/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	11,150.29	582,045,502	11,112.42	580,068,433	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,250,000	10,957.06	575,246,138	10,963.06	575,560,709	1.625	2022/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	11,369.41	578,703,324	11,296.23	574,978,320	2.250	2027/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,825,000	20,736.73	585,812,871	20,330.15	574,326,824	4.750	2035/4/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	14,646.51	575,608,235	14,517.92	570,554,511	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	99.06
合 計	99.06

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	2,680,000.00	293,480,000	293,455,200	0.19
	ユーロ	買建	562,000.00	68,914,220	68,861,860	0.04
	英ポンド	買建	80,000.00	11,483,570	11,475,200	0.01
	米ドル	売建	733,824.31	80,397,790	80,353,761	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2019年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	33,108,092,360	99.40
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		199,950,464	0.60
合計(純資産総額)		33,308,042,824	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	189,310,000	0.57

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	152,100	7,486.12	1,138,639,620	7,714.00	1,173,299,400	3.52
日本	株式	ソニー	電気機器	86,200	6,376.61	549,664,357	7,401.00	637,966,200	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	925,200	566.63	524,246,076	593.20	548,828,640	1.65
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	106,100	3,998.67	424,258,887	4,756.00	504,611,600	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	178,800	2,650.31	473,875,428	2,757.00	492,951,600	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	113,400	3,829.49	434,264,166	4,332.00	491,248,800	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	12,300	33,639.92	413,771,016	38,490.00	473,427,000	1.42
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	93,300	3,538.90	330,179,370	4,099.00	382,436,700	1.15
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	93,000	3,851.35	358,175,550	4,038.00	375,534,000	1.13
日本	株式	任天堂	その他製品	8,400	37,233.86	312,764,424	43,970.00	369,348,000	1.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	107,300	2,951.34	316,678,782	3,099.00	332,522,700	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	99,700	2,938.27	292,945,519	3,253.00	324,324,100	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,826,400	167.35	305,648,040	168.30	307,383,120	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	65,500	4,201.69	275,210,695	4,626.00	303,003,000	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	98,800	2,847.96	281,378,448	3,038.00	300,154,400	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,100	5,592.33	268,991,073	6,119.00	294,323,900	0.88
日本	株式	花王	化学	32,600	8,345.12	272,050,912	9,025.00	294,215,000	0.88
日本	株式	HOYA	精密機器	27,200	9,148.59	248,841,648	10,450.00	284,240,000	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	39,000	6,902.10	269,181,900	7,228.00	281,892,000	0.85
日本	株式	信越化学工業	化学	22,900	11,859.04	271,572,016	12,060.00	276,174,000	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,200	2,736.99	257,824,458	2,900.00	273,180,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	40,000	5,912.93	236,517,200	6,746.00	269,840,000	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,400	15,236.13	265,108,662	15,450.00	268,830,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	13,000	21,635.51	281,261,630	20,330.00	264,290,000	0.79
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,300	22,729.60	256,844,480	22,000.00	248,600,000	0.75
日本	株式	日本電産	電気機器	16,400	15,962.61	261,786,804	15,005.00	246,082,000	0.74
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	24,000	9,992.55	239,821,200	9,858.00	236,592,000	0.71
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	92,500	2,287.72	211,614,100	2,534.50	234,441,250	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	118,000	1,820.49	214,817,820	1,946.00	229,628,000	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	119,900	1,772.22	212,489,178	1,870.00	224,213,000	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	0.29
		建設業	2.80
		食料品	3.75
		繊維製品	0.59
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.09

医薬品	5.98
石油・石炭製品	0.50
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	0.85
鉄鋼	0.77
非鉄金属	0.77
金属製品	0.59
機械	5.08
電気機器	14.31
輸送用機器	7.67
精密機器	2.36
その他製品	2.32
電気・ガス業	1.53
陸運業	4.36
海運業	0.18
空運業	0.50
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.66
卸売業	4.96
小売業	4.61
銀行業	5.82
証券、商品先物取引業	0.82
保険業	2.30
その他金融業	1.18
不動産業	2.41
サービス業	5.14
合計	99.40

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 2020年03月	買建	11	日本円	190,726,050	189,310,000	0.57

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

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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	144,296,072,976	62.81
	カナダ	8,294,440,957	3.61
	ドイツ	7,047,883,622	3.07
	イタリア	1,586,732,273	0.69
	フランス	8,413,320,830	3.66
	オランダ	4,139,830,302	1.80
	スペイン	2,324,811,043	1.01
	ベルギー	823,631,153	0.36
	オーストリア	187,454,099	0.08
	ルクセンブルク	220,936,756	0.10
	フィンランド	871,806,562	0.38
	アイルランド	4,325,900,816	1.88
	ポルトガル	130,003,712	0.06
	イギリス	13,012,143,826	5.66
	スイス	8,399,015,860	3.66
	スウェーデン	2,043,599,772	0.89
	ノルウェー	508,494,854	0.22
	デンマーク	1,503,500,659	0.65
	ケイマン	519,208,155	0.23
	オーストラリア	5,126,531,460	2.23
	バミューダ	465,436,476	0.20
	ニュージーランド	234,162,067	0.10
	香港	2,154,224,938	0.94
	シンガポール	935,586,276	0.41
	イスラエル	456,943,531	0.20
	ジャージー	637,250,351	0.28
	英ヴァージン諸島	33,881,123	0.01
	アラブ首長国連邦	9,116,375	0.00
	マン島	34,159,093	0.01
	小計		218,736,079,917
投資証券	アメリカ	4,951,989,625	2.16
	カナダ	50,330,055	0.02
	フランス	246,781,966	0.11
	イギリス	172,802,208	0.08
	オーストラリア	417,800,017	0.18
	香港	128,171,368	0.06
	シンガポール	128,045,512	0.06
小計		6,095,920,751	2.65

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		4,884,520,915	2.13
合計(純資産総額)		229,716,521,583	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	4,699,926,792	2.05
	買建	ドイツ	1,106,683,248	0.48

(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		5,177,188,500	2.25

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	225,472	27,218.16	6,136,933,746	31,750.48	7,158,846,030	3.12
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	361,824	15,538.62	5,622,248,810	17,415.65	6,301,402,895	2.74
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	20,975	193,142.93	4,051,173,099	204,855.28	4,296,839,666	1.87
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	120,130	20,729.34	2,490,215,711	22,799.43	2,738,896,247	1.19
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	159,470	13,873.44	2,212,398,368	15,244.17	2,430,989,129	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,602	139,199.90	2,171,796,841	148,113.06	2,310,860,093	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,950	139,131.58	2,080,017,261	148,414.35	2,218,794,658	0.97
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	131,741	14,177.18	1,867,716,238	15,968.36	2,103,689,032	0.92
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	86,222	19,531.61	1,684,054,628	20,749.56	1,789,069,287	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	148,583	11,765.44	1,748,145,715	11,959.36	1,776,957,587	0.77
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	124,949	13,493.95	1,686,055,874	13,814.42	1,726,098,015	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	441,069	3,492.40	1,540,392,494	3,872.94	1,708,236,419	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	65,760	23,317.02	1,533,327,769	24,775.89	1,629,263,079	0.71
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	211,271	7,590.47	1,603,648,191	7,657.14	1,617,733,400	0.70

アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	364,877	4,062.90	1,482,461,705	4,299.13	1,568,655,262	0.68
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	47,330	27,218.55	1,288,254,239	32,426.47	1,534,744,977	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	45,090	29,797.80	1,343,582,886	32,949.07	1,485,673,765	0.65
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	220,882	6,200.48	1,369,576,297	6,582.36	1,453,925,902	0.63
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	89,962	14,521.65	1,306,396,835	15,968.37	1,436,546,502	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	206,567	6,611.55	1,365,729,876	6,741.22	1,392,514,996	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	54,700	25,551.04	1,397,642,035	24,099.91	1,318,265,252	0.57
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	127,893	9,074.36	1,160,547,911	10,024.74	1,282,094,073	0.56
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	35,098	33,235.91	1,166,514,299	35,658.89	1,251,556,072	0.54
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	94,831	13,002.44	1,233,034,493	13,180.06	1,249,879,029	0.54
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	208,940	5,671.66	1,185,037,693	5,907.47	1,234,307,868	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	202,932	5,887.81	1,194,826,018	6,064.14	1,230,609,276	0.54
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	276,320	4,047.62	1,118,441,112	4,307.89	1,190,358,707	0.52
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	107,333	9,812.33	1,053,187,639	10,465.56	1,123,300,381	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	226,624	4,980.61	1,128,725,804	4,941.15	1,119,784,537	0.49
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	213,890	5,123.43	1,095,851,005	5,233.68	1,119,432,072	0.49

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	5.16
		素材	4.21
		資本財	6.86
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	1.10
		耐久消費財・アパレル	1.91
		消費者サービス	1.78
		メディア・娯楽	5.94
		小売	4.61
		食品・生活必需品小売り	1.46

	食品・飲料・タバコ	4.70
	家庭用品・パーソナル用品	2.02
	ヘルスケア機器・サービス	4.90
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.11
	銀行	7.65
	各種金融	4.33
	保険	3.73
	不動産	0.49
	ソフトウェア・サービス	9.51
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.63
	電気通信サービス	2.29
	公益事業	3.49
	半導体・半導体製造装置	3.31
投資証券		2.65
合計		97.87

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 EMINI2003	買建	265	米ドル	42,639,800	4,671,616,488	42,898,200	4,699,926,792	2.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2003	買建	265	ユーロ	8,984,230	1,100,927,544	9,031,200	1,106,683,248	0.48

(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	38,600,000.00	4,207,849,100	4,221,428,000	1.84
	ユーロ	買建	7,800,000.00	947,019,500	955,760,500	0.42

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2019年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....9,197円

純資産総額.....329.48億円

※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12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)を再投資したもものとして計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2019年8月	2019年9月	2019年10月	2019年11月	2019年12月	最近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	4,940円

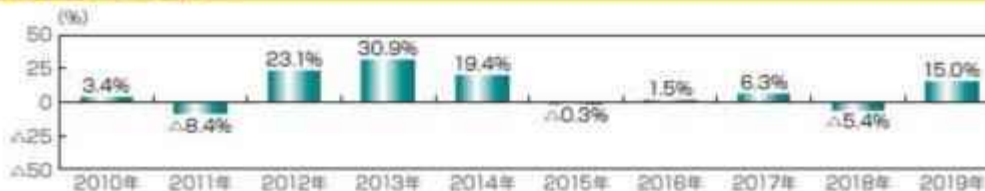
主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.2%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	7.0%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	6.5%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	5.4%
			オリックス不動産投資法人 投資証券	日本	4.2%
			ユナイテッドアーバン投資法人 投資証券	日本	4.1%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.4%	PROLOGIS INC	アメリカ	4.2%
			EQUINIX INC	アメリカ	3.7%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.4%
			WELLTOWER INC	アメリカ	2.4%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.4%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	15.6%	第341回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第140回利付国債(20年)	日本	1.4%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.3%
			第144回利付国債(20年)	日本	1.2%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.2%	US TREASURY N/B(2.125%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(1.25%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(8%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(1.875%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(1.5%)	アメリカ	0.6%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.6%	トヨタ自動車	日本	3.5%
			ソニー	日本	1.9%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	1.6%
			ソフトバンクグループ	日本	1.5%
			日本電信電話	日本	1.5%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	17.0%	APPLE INC	アメリカ	3.1%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	2.7%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.9%
			FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.2%
			JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.1%
現金その他		1.9%			

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

*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

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

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<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。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

信託約款の変更

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

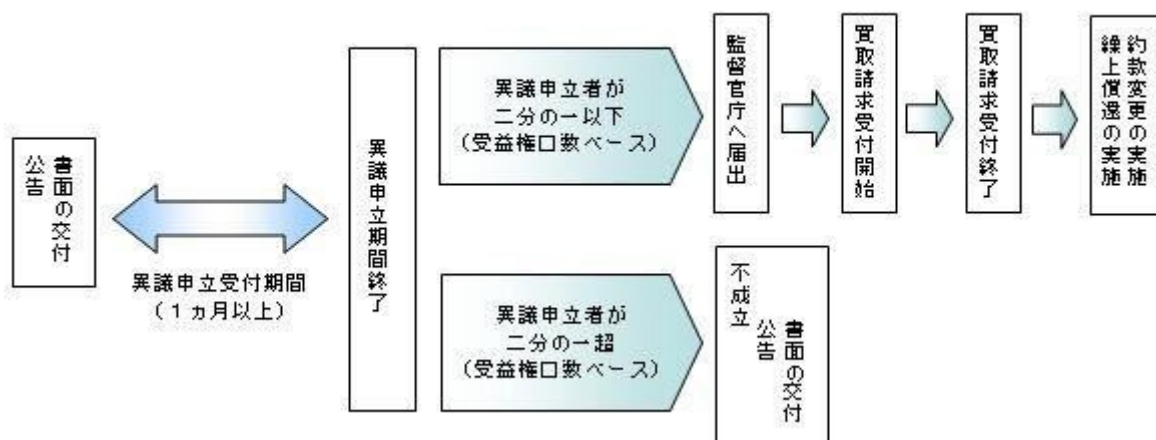
異議の申立て

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

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

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2019年6月18日から2019年12月16日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2019年 6月17日現在	当期 2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	26,179,743	-
コール・ローン	631,730,033	543,449,367
親投資信託受益証券	31,266,589,154	32,273,505,515
未収入金	3,626,718	20,412,245
流動資産合計	31,928,125,648	32,837,367,127
資産合計	31,928,125,648	32,837,367,127
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	36,865,082	35,945,058
未払解約金	10,407,630	28,676,510
未払受託者報酬	1,548,925	1,534,858
未払委託者報酬	27,880,840	27,627,670
未払利息	979	630
その他未払費用	6,689,275	3,447,919
流動負債合計	83,392,731	97,232,645
負債合計	83,392,731	97,232,645
純資産の部		
元本等		
元本	36,865,082,059	35,945,058,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,020,349,142	3,204,923,764
（分配準備積立金）	1,408,745,547	2,485,682,544
元本等合計	31,844,732,917	32,740,134,482
純資産合計	31,844,732,917	32,740,134,482
負債純資産合計	31,928,125,648	32,837,367,127

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2018年12月18日	自	2019年6月18日
	至	2019年6月17日	至	2019年12月16日
営業収益				
受取利息		389		-
有価証券売買等損益		1,200,019,771		2,108,693,214
営業収益合計		1,200,020,160		2,108,693,214
営業費用				
支払利息		123,323		107,065
受託者報酬		8,531,115		8,802,727
委託者報酬		153,561,087		158,450,242
その他費用		3,908,441		4,040,440
営業費用合計		166,123,966		171,400,474
営業利益又は営業損失()		1,033,896,194		1,937,292,740
経常利益又は経常損失()		1,033,896,194		1,937,292,740
当期純利益又は当期純損失()		1,033,896,194		1,937,292,740
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()		7,576,638		15,126,457
期首剰余金又は期首欠損金()		5,929,910,089		5,020,349,142
剰余金増加額又は欠損金減少額		330,328,063		264,500,103
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		330,328,063		264,500,103
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		224,179,299		152,594,236
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		224,179,299		152,594,236
分配金		222,907,373		218,646,772
期末剰余金又は期末欠損金()		5,020,349,142		3,204,923,764

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		前期 2019年6月17日現在	当期 2019年12月16日現在
1.	期首元本額	37,565,004,411円	36,865,082,059円
	期中追加設定元本額	1,553,018,779円	1,375,802,750円
	期中一部解約元本額	2,252,941,131円	2,295,826,563円
2.	受益権の総数	36,865,082,059口	35,945,058,246口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	5,020,349,142円	3,204,923,764円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2018年12月18日 至 2019年6月17日		当期 自 2019年6月18日 至 2019年12月16日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2018年12月18日 至 2019年1月15日		自 2019年6月18日 至 2019年7月16日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	52,681,395円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 67,450,869円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	414,990,544円	C 信託約款に定める収益調整金 465,648,100円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,297,156,134円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 1,399,681,846円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,764,828,073円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 1,932,780,815円
F	分配対象収益(1万口当たり)	469円	F 分配対象収益(1万口当たり) 525円
G	分配金額	37,588,456円	G 分配金額 36,808,705円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2019年1月16日 至 2019年2月15日		自 2019年7月17日 至 2019年8月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	51,057,029円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 21,841,427円

B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	421,420,826円	C	信託約款に定める収益調整金	475,084,633円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,300,779,199円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,418,052,428円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,773,257,054円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,914,978,488円
F	分配対象収益(1万口当たり)	473円	F	分配対象収益(1万口当たり)	521円
G	分配金額	37,468,765円	G	分配金額	36,740,653円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2019年 2月16日			自 2019年 8月16日	
	至 2019年 3月15日			至 2019年 9月17日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	72,517,486円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	67,464,871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	374,982,667円
C	信託約款に定める収益調整金	424,556,349円	C	信託約款に定める収益調整金	481,714,026円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,299,147,493円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,391,971,969円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,796,221,328円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,316,133,533円
F	分配対象収益(1万口当たり)	482円	F	分配対象収益(1万口当たり)	632円
G	分配金額	37,192,500円	G	分配金額	36,642,375円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2019年 3月16日			自 2019年 9月18日	
	至 2019年 4月15日			至 2019年10月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	110,898,964円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	92,832,100円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	45,514,998円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	353,546,520円
C	信託約款に定める収益調整金	431,454,873円	C	信託約款に定める収益調整金	489,474,008円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,316,018,504円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,778,651,825円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,903,887,339円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,714,504,453円
F	分配対象収益(1万口当たり)	515円	F	分配対象収益(1万口当たり)	744円
G	分配金額	36,924,384円	G	分配金額	36,445,367円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2019年 4月16日			自 2019年10月16日	
	至 2019年 5月15日			至 2019年11月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	24,351,130円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	40,590,192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	162,467,765円
C	信託約款に定める収益調整金	445,145,826円	C	信託約款に定める収益調整金	498,705,707円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,419,890,880円	D	信託約款に定める分配準備積立金	2,152,429,639円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,889,387,836円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,854,193,303円
F	分配対象収益(1万口当たり)	512円	F	分配対象収益(1万口当たり)	791円
G	分配金額	36,868,186円	G	分配金額	36,064,614円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

自 2019年 5月16日 至 2019年 6月17日		自 2019年11月16日 至 2019年12月16日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	51,461,086円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	40,437,944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	186,206,229円
C 信託約款に定める収益調整金	458,973,505円	C 信託約款に定める収益調整金	514,538,203円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	1,394,149,543円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	2,294,983,429円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	1,904,584,134円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	3,036,165,805円
F 分配対象収益(1万口当たり)	516円	F 分配対象収益(1万口当たり)	844円
G 分配金額	36,865,082円	G 分配金額	35,945,058円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

	前期 2019年 6月17日現在	当期 2019年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

前期（2019年 6月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

当期（2019年12月16日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	257,656,130
合計	257,656,130

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

前期 2019年 6月17日現在		当期 2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	0.8638円	1口当たり純資産額	0.9108円
(1万口当たり純資産額)	(8,638円)	(1万口当たり純資産額)	(9,108円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	2,024,843,992	5,598,693,637	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,618,654,809	5,156,221,237	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,265,989,077	5,352,266,199	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,502,989,777	5,640,864,437	
	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	2,117,390,908	5,236,519,454	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,375,450,506	5,288,940,551	
	合計	15,905,319,069	32,273,505,515	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本リートインデックス」-REITマザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	40,376,227	-
コール・ローン	974,298,155	2,137,932,109
投資証券	27,400,876,000	105,603,484,220
未収配当金	89,188,590	386,485,017
流動資産合計	28,504,738,972	108,127,901,346
資産合計	28,504,738,972	108,127,901,346
負債の部		
流動負債		
未払金	929,330,350	1,648,478,800
未払解約金	2,652,495	253,083
未払利息	1,510	2,478
流動負債合計	931,984,355	1,648,734,361
負債合計	931,984,355	1,648,734,361
純資産の部		
元本等		
元本	12,341,578,634	43,055,259,887
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,231,175,983	63,423,907,098
元本等合計	27,572,754,617	106,479,166,985
純資産合計	27,572,754,617	106,479,166,985
負債純資産合計	28,504,738,972	108,127,901,346

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
1.	期首	2018年12月18日	2019年 6月18日
	期首元本額	3,940,100,434円	12,341,578,634円
	期首からの追加設定元本額	8,672,066,510円	31,051,272,811円
	期首からの一部解約元本額	270,588,310円	337,591,558円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,390,678,281円	2,117,390,908円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	1,311,044,408円	1,425,714,824円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	167,326,722円	148,691,553円	
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	8,472,529,223円	39,363,462,602円	
計	12,341,578,634円	43,055,259,887円	
2.	受益権の総数	12,341,578,634口	43,055,259,887口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2019年12月16日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,784,881,002

合計	1,784,881,002
----	---------------

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年 6月17日現在		2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	2,2341円	1口当たり純資産額	2,4731円
(1万口当たり純資産額)	(22,341円)	(1万口当たり純資産額)	(24,731円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,009	125,317,800	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,424	175,864,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	3,266	2,168,624,000	
	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	12,609	1,428,599,700	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	11,308	1,994,731,200	
	産業ファンド投資法人 投資証券	12,093	1,938,507,900	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	9,322	3,127,531,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	6,117	1,211,777,700	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	4,925	2,620,100,000	
	GLP投資法人 投資証券	24,480	3,317,040,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	4,092	1,366,728,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	14,121	3,960,940,500	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,495	840,190,000	
	Oneリート投資法人 投資証券	1,532	521,646,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	10,607	1,536,954,300	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	8,359	1,611,615,200	

日本リート投資法人 投資証券	3,192	1,468,320,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	63,144	1,302,660,720	
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	477	97,737,300	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	28,738	2,606,536,600	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	2,139	277,428,300	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	3,796	1,016,189,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	2,096	271,851,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,967	222,664,400	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	30,652	5,624,642,000	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	1,628	214,570,400	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	9,138	1,417,303,800	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	3,262	378,392,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	845	108,413,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,420	1,116,830,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	1,670	152,304,000	
さくら総合リート投資法人 投資証券	2,127	208,658,700	
投資法人みらい 投資証券	10,661	615,139,700	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	2,306	335,292,400	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,935	665,640,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,380	185,886,000	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	1,427	196,497,900	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,789	342,210,300	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,520	174,648,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	9,518	7,509,702,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	9,829	7,047,393,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	18,576	4,346,784,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	19,583	4,435,549,500	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	6,222	2,943,006,000	
プレミア投資法人 投資証券	8,877	1,369,721,100	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	6,590	1,306,138,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	6,825	924,787,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	22,068	4,559,248,800	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	7,024	1,324,024,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	43,113	2,651,449,500	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	3,491	1,612,842,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	6,121	812,256,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	6,422	1,717,242,800	
福岡リート投資法人 投資証券	5,083	920,023,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,040	2,422,880,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	7,611	820,465,800	

大和証券オフィス投資法人 投資証券	2,269	1,826,545,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	4,439	735,542,300	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,531	302,219,400	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	13,251	3,773,884,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	31,662	2,624,779,800	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	11,055	1,113,238,500	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	8,801	1,557,777,000	
合計	569,069	105,603,484,220	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,295,750,099	2,090,679,776
金銭信託	376,949	-
コール・ローン	9,095,954	15,065,737
投資証券	25,013,611,804	103,640,526,687
派生商品評価勘定	1,920	80,960
未収入金	306,740	848,757
未収配当金	40,037,873	142,080,344
流動資産合計	26,359,181,339	105,889,282,261
資産合計	26,359,181,339	105,889,282,261
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	37,907	87,290
未払金	1,205,815,163	1,766,459,274
未払解約金	1,465,371	1,295,531
未払利息	14	17
流動負債合計	1,207,318,455	1,767,842,112
負債合計	1,207,318,455	1,767,842,112
純資産の部		
元本等		
元本	11,583,284,463	46,765,012,186
剰余金		
剰余金又は欠損金()	13,568,578,421	57,356,427,963
元本等合計	25,151,862,884	104,121,440,149
純資産合計	25,151,862,884	104,121,440,149
負債純資産合計	26,359,181,339	105,889,282,261

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
1.	期首	2018年12月18日	2019年 6月18日
	期首元本額	3,092,199,662円	11,583,284,463円
	期首からの追加設定元本額	8,731,249,790円	35,281,967,091円
	期首からの一部解約元本額	240,164,989円	100,239,368円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,421,174,254円	2,375,450,506円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	44,221,444円	37,595,546円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,716,439,955円	43,962,661,649円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	401,448,810円	389,304,485円
	計	11,583,284,463円	46,765,012,186円
2.	受益権の総数	11,583,284,463口	46,765,012,186口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2019年12月16日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,636,797,497
合計	1,636,797,497

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2019年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	231,318,387	-	231,282,400	35,987
	米ドル	130,378,080	-	130,380,000	1,920
	加ドル	24,298,410	-	24,297,000	1,410

	ニュージーランドドル	2,825,372	-	2,824,400	972
	香港ドル	32,603,665	-	32,571,000	32,665
	シンガポールドル	41,212,860	-	41,210,000	2,860
	合計	231,318,387	-	231,282,400	35,987

(2019年12月16日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,702,734,230	-	2,702,727,900	6,330
	米ドル	2,013,247,040	-	2,013,328,000	80,960
	加ドル	49,820,400	-	49,818,000	2,400
	ユーロ	164,347,650	-	164,335,500	12,150
	英ポンド	149,056,680	-	149,042,400	14,280
	豪ドル	180,654,000	-	180,624,000	30,000
	香港ドル	30,868,200	-	30,844,000	24,200
	シンガポールドル	114,740,260	-	114,736,000	4,260
	合計	2,702,734,230	-	2,702,727,900	6,330

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2019年 6月17日現在		2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	2,1714円	1口当たり純資産額	2,2265円
(1万口当たり純資産額)	(21,714円)	(1万口当たり純資産額)	(22,265円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	61,586	1,568,595.42	
		AGREE REALTY CORPORATION	30,833	2,109,285.53	
		ALEXANDER'S INC	1,490	472,508.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	82,223	12,865,432.81	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	35,855	1,602,718.50	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	100,991	4,646,595.91	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	79,190	1,078,567.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	186,119	4,768,368.78	
		AMERICOLD REALTY TRUST	139,683	4,617,919.98	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	108,419	5,545,631.85	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	154,220	2,432,049.40	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	380,100	326,886.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	51,140	135,521.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	101,320	21,139,404.80	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	16,785	195,377.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	104,280	14,089,270.80	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	19,263	182,035.35	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	127,222	1,879,068.94	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	217,839	4,546,299.93	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	48,225	882,999.75	
BRT APARTMENTS CORP	3,995	68,394.40	
CAMDEN PROPERTY TRUST	70,335	7,402,758.75	
CARETRUST REIT INC	69,012	1,400,943.60	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	154,512	162,237.60	
CEDAR REALTY TRUST INC	78,090	206,157.60	
CHATHAM LODGING TRUST	33,911	619,553.97	
CITY OFFICE REIT INC	39,450	493,519.50	
CLIPPER REALTY INC	4,436	43,206.64	
COLONY CAPITAL INC-A	351,873	1,608,059.61	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	84,170	1,701,075.70	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	12,878	575,517.82	
CORECIVIC INC	85,441	1,360,220.72	
COREPOINT LODGING INC	29,830	307,547.30	
CORESITE REALTY CORP	27,121	3,013,143.10	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	79,978	2,233,785.54	
COUSINS PROPERTIES INC	105,089	4,146,811.94	
CUBESMART	138,568	4,187,524.96	
CYRUSONE INC	82,536	5,041,298.88	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	146,903	1,577,738.22	
DIGITAL REALTY TRUST INC	151,140	17,186,129.40	
DOUGLAS EMMETT INC	120,056	5,089,173.84	
DUKE REALTY CORPORATION	262,326	8,974,172.46	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	52,100	1,181,107.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	26,965	3,573,132.15	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	110,653	1,512,626.51	
EPR PROPERTIES	55,916	3,799,492.20	
EQUINIX INC	61,527	33,953,059.68	
EQUITY COMMONWEALTH	89,909	2,811,454.43	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	132,114	9,228,162.90	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	252,949	20,491,398.49	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	58,338	1,450,282.68	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	47,684	14,329,518.84	
EXTRA SPACE STORAGE INC	93,363	9,550,101.27	

FARMLAND PARTNERS INC	19,935	128,580.75	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	50,709	6,479,088.93	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	91,640	3,738,912.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	48,327	1,311,111.51	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	76,323	646,455.81	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	36,309	446,600.70	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	148,181	6,096,166.34	
GEO GROUP INC/THE	87,677	1,285,344.82	
GETTY REALTY CORPORATION	23,233	757,163.47	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	21,950	489,924.00	
GLADSTONE LAND CORP	15,773	202,840.78	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,997	281,781.57	
GLOBAL NET LEASE INC	64,793	1,286,788.98	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	95,122	3,069,586.94	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	150,713	4,363,141.35	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	356,715	11,504,058.75	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	23,962	339,301.92	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	74,918	3,455,967.34	
HOST HOTELS & RESORTS INC	529,587	9,506,086.65	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	110,854	3,937,534.08	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,916	931,128.36	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	46,991	953,447.39	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,079	597,926.79	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,096	598,699.20	
INVITATION HOMES INC	389,931	11,319,696.93	
IRON MOUNTAIN INC	208,449	6,584,903.91	
JBG SMITH PROPERTIES	85,130	3,316,664.80	
KILROY REALTY CORPORATION	67,431	5,498,998.05	
KIMCO REALTY CORPORATION	306,640	6,227,858.40	
KITE REALTY GROUP TRUST	58,041	1,048,220.46	
LEXINGTON REALTY TRUST	179,161	1,888,356.94	
LIBERTY PROPERTY TRUST	114,363	6,826,327.47	
LIFE STORAGE INC	33,721	3,513,390.99	
LTC PROPERTIES INC	28,555	1,259,275.50	
MACERICH CO/THE	81,392	2,120,261.60	

MACK-CALI REALTY CORPORATION	65,200	1,341,816.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,035,347	1,009,463.32	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	360,043	7,154,054.41	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	82,799	10,805,269.50	
MONMOUTH RE INVST CORP	69,071	1,024,322.93	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	124,772	6,453,207.84	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,994	1,405,608.30	
NATL HEALTH INVESTORS INC	32,196	2,532,537.36	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	59,526	451,207.08	
NEXPOINT RESIDENTIAL	15,193	692,041.15	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	34,030	1,051,527.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	157,195	6,449,710.85	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	12,060	334,906.20	
PARAMOUNT GROUP INC	144,140	1,954,538.40	
PARK HOTELS & RESORTS INC	175,590	4,342,340.70	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	95,651	2,501,273.65	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	38,702	205,894.64	
PHYSICIANS REALTY TRUST	136,021	2,485,103.67	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	90,650	1,948,068.50	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,263	188,326.05	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	34,066	443,879.98	
PROLOGIS INC	457,673	40,522,367.42	
PS BUSINESS PARKS INC	14,342	2,388,803.52	
PUBLIC STORAGE	108,990	22,389,815.70	
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	41,653	2,136,798.90	
REALTY INCOME CORP	230,970	16,745,325.00	
REGENCY CENTERS CORP	121,708	7,413,234.28	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	83,156	1,426,956.96	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	157,035	2,057,158.50	
RETAIL VALUE INC	9,308	335,088.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	79,323	3,602,850.66	
RLJ LODGING TRUST	125,416	2,167,188.48	
RPT REALTY	60,593	872,539.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	37,295	3,170,447.95	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	139,266	2,863,308.96	

SAFEHOLD INC	9,596	374,435.92	
SAUL CENTERS INC	7,765	389,725.35	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	174,864	1,280,004.48	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	23,291	911,609.74	
SERVICE PROPERTIES TRUST	120,459	2,845,241.58	
SIMON PROPERTY GROUP INC	223,487	32,260,348.45	
SITE CENTERS CORP	108,153	1,421,130.42	
SL GREEN REALTY CORP	59,962	5,318,629.40	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,723	3,548,136.81	
STAG INDUSTRIAL INC	92,054	2,791,997.82	
STORE CAPITAL CORP	152,796	5,699,290.80	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	73,446	877,679.70	
SUN COMMUNITIES INC	65,722	10,064,667.08	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	166,022	2,345,890.86	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	65,116	984,553.92	
TAUBMAN CENTERS INC	45,482	1,366,734.10	
TERRENO REALTY CORP	46,747	2,532,284.99	
UDR INC	212,583	9,834,089.58	
UMH PROPERTIES INC	27,619	440,799.24	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	9,087	1,046,731.53	
URBAN EDGE PROPERTIES	83,603	1,585,948.91	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	22,106	518,827.82	
VENTAS INC	270,489	15,012,139.50	
VEREIT INC	766,575	7,014,161.25	
VICI PROPERTIES INC	334,342	8,134,540.86	
VORNADO REALTY TRUST	115,120	7,513,882.40	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	122,851	441,035.09	
WASHINGTON REIT	57,538	1,703,124.80	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	88,871	2,707,010.66	
WELLTOWER INC	294,087	23,135,824.29	
WHITESTONE REIT	26,984	357,268.16	
WP CAREY INC	124,064	9,585,184.64	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	81,376	1,724,357.44	
米ドル小計	17,519,782	695,009,708.58	(76,054,912,409)

加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	42,027	2,124,044.58	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,495	542,131.70	
		BOARDWALK EQUITIES INC	16,023	730,969.26	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	57,514	2,976,349.50	
		CHOICE PROPERTIES REIT	111,205	1,499,043.40	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	63,023	881,061.54	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,631	588,172.53	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	50,327	757,421.35	
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	68,874	1,156,394.46	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	43,791	568,845.09	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	21,288	643,323.36	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	19,096	1,268,738.24	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	102,910	2,133,324.30	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	44,767	688,516.46	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	32,382	618,496.20	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	12,246	269,412.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	13,156	233,650.56	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	23,215	679,038.75	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	43,916	527,431.16	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	108,623	2,898,061.64	
		SLATE OFFICE REIT	26,167	151,768.60	
		SLATE RETAIL REIT	16,629	212,019.75	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53,584	1,656,817.28	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	53,179	639,743.37			
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	33,413	239,237.08			
加ドル小計			1,141,481	24,684,012.16	(2,049,760,369)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	17,762	1,936,058.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	116,526	1,914,522.18	
		ALTAREA	2,504	500,299.20	
		BEFIMMO S.C.A.	17,660	950,108.00	
		COFINIMMO	18,352	2,349,056.00	
		COVIVIO	32,704	3,239,331.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	29,128	725,869.76	
		GECINA SA	39,968	6,131,091.20	

		HAMBORNER REIT AG	55,412	535,113.68	
		HIBERNIA REIT PLC	502,964	704,149.60	
		ICADE	20,277	1,874,608.65	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	34,398	211,547.70	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	181,714	2,038,831.08	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	17,385	444,186.75	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	328,892	532,805.04	
		KLEPIERRE	152,559	4,924,604.52	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	47,543	358,474.22	
		MERCIALYS	15,304	180,434.16	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	267,246	3,380,661.90	
		MONTEA	7,479	573,639.30	
		NSI NV	11,717	483,912.10	
		RETAIL ESTATES	7,647	624,759.90	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	100,016	13,802,208.00	
		VASTNED RETAIL	14,085	360,576.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,697	2,081,944.00	
		WERELDHAVE NV	29,841	593,835.90	
		ユーロ小計	2,082,780	51,452,628.04 (6,263,842,937)	
英債券	投資証券	AEW UK REIT PLC	134,481	129,505.20	
		ASSURA PLC	1,802,783	1,406,170.74	
		BIG YELLOW GROUP PLC	110,645	1,300,078.75	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	684,572	4,259,406.98	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	442,668	123,947.04	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	454,752	398,817.50	
		DERWENT LONDON PLC	76,479	3,011,743.02	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	474,471	450,747.45	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	191,460	1,653,065.64	
		HAMMERSON PLC	564,432	1,669,589.85	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	291,319	310,546.05	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	261,463.87	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	545,218	5,460,358.27	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	601,396	1,377,196.84	
		LXI REIT PLC	408,867	528,256.16	

		NEWRIVER REIT PLC	203,115	396,074.25	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	364,899	346,289.15	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	882,976	1,336,825.66	
		RDI REIT PLC	167,643	221,288.76	
		REGIONAL REIT LTD	281,770	305,438.68	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	151,592	1,171,048.20	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	470,132	269,855.76	
		SEGRO PLC	787,222	6,833,086.96	
		SHAFTESBURY PLC	160,870	1,529,873.70	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	255,304	228,752.38	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,216,574	1,757,949.43	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	608,487	542,770.40	
		UNITE GROUP PLC	264,635	3,175,620.00	
		WORKSPACE GROUP PLC	90,278	1,062,572.06	
		英債券小計	13,447,786	41,518,338.75 (6,067,074,841)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	260,813	931,102.41	
		APN INDUSTRIA REIT	98,194	286,726.48	
		ARENA REIT	220,379	656,729.42	
		BWP TRUST	376,248	1,512,516.96	
		CENTURIA METROPOLITAN REIT	267,543	781,225.56	
		CHARTER HALL GROUP	334,980	3,718,278.00	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	249,672	1,353,222.24	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	261,201	1,185,852.54	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	187,758	619,601.40	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	1,380,244	1,614,885.48	
		DEXUS	791,811	9,272,106.81	
		GDI PROPERTY GROUP	433,108	651,827.54	
		GOODMAN GROUP	1,165,036	15,926,042.12	
		GPT GROUP	1,413,461	8,042,593.09	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	234,115	980,941.85	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	100,275	318,874.50	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	187,991	842,199.68	
		MIRVAC GROUP	2,885,410	9,060,187.40	
		NATIONAL STORAGE REIT	535,447	1,014,672.06	

		RURAL FUNDS GROUP	240,881	429,972.58	
		SCENTRE GROUP	3,880,475	14,551,781.25	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	650,090	1,722,738.50	
		STOCKLAND	1,773,406	8,299,540.08	
		VICINITY CENTRES	2,335,395	5,861,841.45	
		VIVA ENERGY REIT	326,991	876,335.88	
豪ドル小計			20,590,924	90,511,795.28	(6,812,822,830)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	948,257	2,043,493.83	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	361,371	948,598.87	
ニュージーランドドル小計			1,309,628	2,992,092.70	(215,939,330)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	1,507,000	7,519,930.00	
		FORTUNE REIT	1,007,000	8,992,510.00	
		LINK REIT	1,530,800	123,229,400.00	
		PROSPERITY REIT	1,056,000	3,157,440.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	773,000	3,849,540.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,053,000	5,517,720.00	
香港ドル小計			7,127,800	153,140,890.00	(2,148,566,686)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	330,725	463,015.00	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	645,240	703,311.60	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,164,803	6,299,576.73	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	841,642	1,119,383.86	
		CACHE LOGISTICS TRUST	653,358	467,150.97	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,058,950	4,056,131.50	
		CAPITALAND MALL TRUST	2,075,700	5,023,194.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	568,657	898,478.06	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	607,400	971,840.00	
		ESR REIT	1,559,359	834,257.06	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	619,400	442,871.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	393,500	391,532.50	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	555,689	1,483,689.63	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	485,200	800,580.00	

		FRASERS HOSPITALITY TRUST	614,700	436,437.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	1,199,510	1,427,416.90	
		KEPPEL DC REIT	905,877	1,766,460.15	
		KEPPEL REIT	1,457,400	1,792,602.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,111,200	250,020.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,576,631	3,563,186.06	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,105,960	2,753,840.40	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,117,944	3,515,787.04	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	1,520,500	1,748,575.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,979,635	1,108,595.60	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	301,400	973,522.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	573,500	263,810.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	336,100	300,809.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	617,721	321,214.92	
		SPH REIT	604,300	658,687.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	1,015,900	736,527.50	
		SUNTEC REIT	1,703,100	3,082,611.00	
シンガポールドドル小計			32,301,001	48,655,113.98	(3,931,819,760)
韓国ウォン	投資証券	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	18,583	140,301,650.00	
韓国ウォン小計			18,583	140,301,650.00	(13,090,143)
イスラエルシェケル	投資証券	REIT 1 LTD	118,102	2,633,674.60	
イスラエルシェケル小計			118,102	2,633,674.60	(82,697,382)
合計				103,640,526,687	(103,640,526,687)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 156銘柄	100.0%	73.3%
加ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	6.0%
英ポンド	投資証券 29銘柄	100.0%	5.9%
豪ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 31銘柄	100.0%	3.8%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,591,970	-
コール・ローン	134,936,982	160,054,431
国債証券	31,303,086,934	32,347,227,948
地方債証券	3,075,030,000	2,961,506,000
特殊債券	2,863,632,022	3,840,682,000
社債券	2,866,012,000	2,853,513,000
未収利息	129,111,416	128,977,592
前払費用	3,500,791	9,829,961
流動資産合計	40,380,902,115	42,301,790,932
資産合計	40,380,902,115	42,301,790,932
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,474,426	6,007,873
未払利息	209	185

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
流動負債合計	2,474,635	6,008,058
負債合計	2,474,635	6,008,058
純資産の部		
元本等		
元本	28,211,704,088	29,684,235,525
剰余金		
剰余金又は欠損金()	12,166,723,392	12,611,547,349
元本等合計	40,378,427,480	42,295,782,874
純資産合計	40,378,427,480	42,295,782,874
負債純資産合計	40,380,902,115	42,301,790,932

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
1. 期首	2018年12月18日	2019年 6月18日
期首元本額	27,747,010,635円	28,211,704,088円
期首からの追加設定元本額	1,727,463,261円	2,296,486,999円
期首からの一部解約元本額	1,262,769,808円	823,955,562円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	2,302,079,218円	2,711,935,582円
DCインデックスバランス(株式40)	2,128,302,268円	2,460,688,105円
DCインデックスバランス(株式60)	1,508,535,470円	1,778,194,324円
DCインデックスバランス(株式80)	234,512,858円	276,183,838円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,897,346,809円	2,002,645,688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	3,615,640,173円	3,618,654,809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）	1,482,831,594円	1,528,015,066円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,159,027円	4,566,941円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	24,933,474円	25,357,624円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	120,944,820円	103,185,100円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	283,137,318円	277,082,222円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,471,966,482円	4,405,738,768円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,255,544,051円	1,345,192,939円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,251,416,227円	1,299,476,380円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	665,963,180円	695,140,125円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	98,783,487円	101,804,423円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,575,211,086円	6,744,323,330円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	290,396,546円	306,050,261円
計	28,211,704,088円	29,684,235,525円
2. 受益権の総数	28,211,704,088口	29,684,235,525口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月17日現在	2019年12月16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）

（2019年 6月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2019年12月16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	242,376,418
地方債証券	1,540,000

特殊債券	2,481,000
社債券	2,536,000
合計	248,933,418

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年 6月17日現在		2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	1.4313円	1口当たり純資産額	1.4249円
(1万口当たり純資産額)	(14,313円)	(1万口当たり純資産額)	(14,249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	560,887,182	
	第1 2 5 回利付国債(5年)	325,000,000	325,947,962	
	第1 2 6 回利付国債(5年)	220,000,000	220,554,400	
	第1 回利付国債(40年)	70,000,000	107,727,200	
	第2 回利付国債(40年)	145,000,000	217,050,500	
	第3 回利付国債(40年)	50,000,000	75,512,500	
	第4 回利付国債(40年)	95,000,000	144,921,550	
	第5 回利付国債(40年)	35,000,000	51,812,600	
	第6 回利付国債(40年)	70,000,000	102,319,700	
	第7 回利付国債(40年)	50,000,000	70,538,500	
	第8 回利付国債(40年)	95,000,000	125,711,600	
	第9 回利付国債(40年)	160,000,000	158,992,000	
	第1 0 回利付国債(40年)	125,000,000	145,736,250	
第1 1 回利付国債(40年)	140,000,000	158,579,400		

第12回利付国債(40年)	85,000,000	87,144,550	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,189,706	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	207,794,150	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	376,719,200	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	66,314,950	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	35,655,200	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	107,295,300	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	188,718,500	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,123,800	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	194,322,500	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	179,492,250	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	76,755,000	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,177,200	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,591,000	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	215,495,700	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,765,900	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	66,855,750	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	117,820,950	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	237,702,700	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	217,459,200	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,236,800	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	216,650,700	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	123,998,400	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	504,900,900	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,581,600	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,665,700	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	401,040,900	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	380,981,600	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	433,041,000	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	718,438,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,885,000	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	248,616,200	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,766,500	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	619,699,000	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	498,070,300	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	162,728,000	
第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,550,700	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	498,310,400	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	487,987,200	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	441,894,750	
第352回利付国債(10年)	390,000,000	396,013,800	
第353回利付国債(10年)	200,000,000	202,990,000	

第1回利付国債(30年)	50,000,000	63,786,500	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	274,655,680	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	196,744,800	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	47,012,000	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	145,487,100	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,659,600	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	54,742,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	75,515,000	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	93,664,560	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,975,000	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	232,767,400	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	40,438,760	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	131,844,400	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	384,048,480	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	202,917,330	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	164,214,000	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	69,827,500	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	181,622,250	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	278,430,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	228,199,440	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	184,222,350	
第37回利付国債(30年)	131,000,000	176,783,190	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	126,526,700	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	101,796,750	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	120,340,800	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	52,659,200	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	178,133,850	
第43回利付国債(30年)	205,000,000	270,825,500	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	198,627,000	
第45回利付国債(30年)	100,000,000	127,766,000	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	128,021,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	150,244,050	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	132,142,500	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	113,473,800	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,771,750	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	68,900,300	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	93,075,300	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	111,339,900	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	122,315,600	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	122,266,100	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	55,622,000	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	111,194,000	

第58回利付国債(30年)	100,000,000	111,141,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	184,465,300	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	136,708,800	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	75,852,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	123,465,600	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	90,000,000	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	99,867,000	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,401,988	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	101,650,230	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	58,618,800	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	243,133,560	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	40,262,430	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	15,705,150	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	69,206,280	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	54,675,400	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	142,646,400	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	34,839,420	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	308,770,600	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,015,470	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,125,050	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,151,520	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	108,201,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,651,320	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	36,960,720	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	85,793,760	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	115,927,760	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	123,959,360	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	125,164,450	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	131,297,420	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,179,800	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,255,400	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	44,507,600	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	178,902,400	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	67,763,400	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	149,052,800	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	347,610,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,529,280	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	291,225,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	69,414,000	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	69,309,000	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,123,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	97,031,420	

第96回利付国債(20年)	98,000,000	114,479,680
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,155,350
第98回利付国債(20年)	94,000,000	110,299,600
第99回利付国債(20年)	117,000,000	137,834,190
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,728,200
第101回利付国債(20年)	66,000,000	79,700,280
第102回利付国債(20年)	81,000,000	98,205,210
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,242,350
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,161,760
第105回利付国債(20年)	77,000,000	91,725,480
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,400,100
第107回利付国債(20年)	130,000,000	155,431,900
第108回利付国債(20年)	134,000,000	157,787,680
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,895,100
第110回利付国債(20年)	98,000,000	117,590,200
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,344,000
第112回利付国債(20年)	80,000,000	96,337,600
第113回利付国債(20年)	290,000,000	350,627,400
第114回利付国債(20年)	52,000,000	63,054,680
第115回利付国債(20年)	125,000,000	152,827,500
第116回利付国債(20年)	55,000,000	67,477,300
第117回利付国債(20年)	293,000,000	356,460,870
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,101,300
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,673,600
第120回利付国債(20年)	170,000,000	198,577,000
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,468,640
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,270,290
第123回利付国債(20年)	195,000,000	239,549,700
第124回利付国債(20年)	320,000,000	389,593,600
第125回利付国債(20年)	50,000,000	62,170,000
第126回利付国債(20年)	105,000,000	128,201,850
第128回利付国債(20年)	65,000,000	78,847,600
第129回利付国債(20年)	85,000,000	102,135,150
第130回利付国債(20年)	270,000,000	325,425,600
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,322,960
第132回利付国債(20年)	35,000,000	41,868,050
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,244,800
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,583,500
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,985,300
第136回利付国債(20年)	180,000,000	213,721,200
第137回利付国債(20年)	200,000,000	240,566,000
第138回利付国債(20年)	120,000,000	141,362,400

第139回利付国債(20年)	230,000,000	273,798,900	
第140回利付国債(20年)	508,000,000	612,322,880	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,669,200	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	152,678,750	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	112,591,320	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	509,412,400	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	430,980,650	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	164,203,200	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	72,283,200	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	107,406,000	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	137,431,900	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	106,474,500	
第151回利付国債(20年)	200,000,000	230,992,000	
第152回利付国債(20年)	140,000,000	161,922,600	
第153回利付国債(20年)	170,000,000	199,474,600	
第154回利付国債(20年)	120,000,000	139,076,400	
第155回利付国債(20年)	140,000,000	157,984,400	
第156回利付国債(20年)	110,000,000	113,642,100	
第157回利付国債(20年)	50,000,000	50,000,000	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	178,268,800	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	159,736,500	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	151,422,600	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	127,686,000	
第162回利付国債(20年)	70,000,000	74,482,100	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	175,556,700	
第164回利付国債(20年)	285,000,000	297,958,950	
第165回利付国債(20年)	60,000,000	62,708,400	
第166回利付国債(20年)	100,000,000	108,063,000	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	166,955,200	
第168回利付国債(20年)	100,000,000	102,379,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	160,739,200	
第170回利付国債(20年)	160,000,000	160,598,400	
国債証券 合計	28,635,000,000	32,347,227,948	
地方債証券			
第694回東京都公募公債	200,000,000	203,396,000	
第708回東京都公募公債	100,000,000	102,232,000	
第709回東京都公募公債	100,000,000	101,961,000	
第712回東京都公募公債	200,000,000	204,252,000	
第730回東京都公募公債	100,000,000	102,826,000	
第731回東京都公募公債	100,000,000	102,700,000	
平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	204,562,000	
平成27年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,711,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,479,000	

	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,640,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,147,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,637,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	103,068,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,786,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,276,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	102,284,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,771,000	
	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	205,898,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,052,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,105,000	
	平成27年度第1回相模原市公募公債	200,000,000	205,524,000	
	平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	101,893,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	102,306,000	
地方債証券 合計		2,900,000,000	2,961,506,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,287,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,279,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,259,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	204,762,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,119,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,388,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,961,000	
	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	102,128,000	
	第17回道路債券	100,000,000	104,605,000	
	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	477,680,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,093,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,296,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,892,000	
	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	101,151,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,000,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,432,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,275,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,299,000	
	第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	102,070,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,029,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,226,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,993,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,809,000	

	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,014,000	
	第316回信中金債(5年)	100,000,000	100,082,000	
	第318回信中金債(5年)	100,000,000	100,050,000	
	第320回信中金債(5年)	100,000,000	100,008,000	
	第322回信中金債(5年)	200,000,000	200,086,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	100,302,000	
特殊債券 合計		3,700,000,000	3,840,682,000	
社債券	第15回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,960,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,094,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,296,000	
	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	99,743,000	
	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	201,714,000	
	第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,638,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,572,000	
	第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,119,000	
	第13回株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,930,000	
	第9回三菱UFJ信託銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	204,286,000	
	第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,834,000	
	第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,520,000	
	第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	107,159,000	
	第87回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	204,406,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,634,000	
	第11回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,187,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	203,798,000	
	第20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	102,759,000	
	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	99,969,000	
	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	102,372,000	
	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,961,000	
	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	203,562,000	
社債券 合計		2,800,000,000	2,853,513,000	
合計		38,035,000,000	42,002,928,948	

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）

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	94,828,477	197,300,886
金銭信託	7,318,467	-
コール・ローン	176,598,186	34,538,790
国債証券	149,804,065,535	155,328,040,689
派生商品評価勘定	213	276,200
未収利息	1,090,695,764	1,101,428,172
前払費用	30,099,791	36,576,862
流動資産合計	151,203,606,433	156,698,161,599
資産合計	151,203,606,433	156,698,161,599
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,095
未払金	34,172,372	46,782,088
未払解約金	146,582,715	51,359,412
未払利息	273	40
流動負債合計	180,755,360	98,143,635
負債合計	180,755,360	98,143,635
純資産の部		
元本等		
元本	66,086,660,783	66,299,765,692
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	84,936,190,290	90,300,252,272
元本等合計	151,022,851,073	156,600,017,964
純資産合計	151,022,851,073	156,600,017,964
負債純資産合計	151,203,606,433	156,698,161,599

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</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p>
--------------------	--

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

（貸借対照表に関する注記）

		2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
1.	期首	2018年12月18日	2019年 6月18日
	期首元本額	65,916,864,942円	66,086,660,783円
	期首からの追加設定元本額	1,565,296,955円	1,590,378,198円
	期首からの一部解約元本額	1,395,501,114円	1,377,273,289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）	12,380,930,497円	12,790,110,812円
	DCインデックスバランス（株式20）	221,896,387円	253,944,231円
	DCインデックスバランス（株式40）	296,317,162円	333,119,217円
	DCインデックスバランス（株式60）	377,241,873円	432,345,384円
	DCインデックスバランス（株式80）	293,744,767円	335,803,010円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,573,457,856円	25,104,567,167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	2,264,049,892円	2,265,989,077円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	18,247,208,364円	17,268,611,083円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	765,999,672円	934,562,861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）	152,697,699円	157,572,835円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,616,785円	2,793,179円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,096,581円	3,091,667円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,353,354円	6,973,217円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	13,601,818円	12,984,044円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	859,421,327円	849,733,630円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	931,279,414円	895,564,737円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	60,517,415円	62,920,476円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	87,024,232円	88,219,709円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	82,843,151円	85,179,386円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	61,533,798円	62,412,673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	4,137,426,531円	4,085,085,523円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	265,402,208円	268,181,774円
計	66,086,660,783円	66,299,765,692円
2. 受益権の総数	66,086,660,783口	66,299,765,692口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月17日現在	2019年12月16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 「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)デリバティブ取引 同左
	(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2019年 6月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2019年12月16日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,008,495,714
合計	1,008,495,714

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2019年 6月17日現在）

（単位：円）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	21,467,477	-	21,467,690	213
	米ドル	10,864,840	-	10,865,000	160
	ユーロ	10,602,637	-	10,602,690	53
	合計	21,467,477	-	21,467,690	213

(2019年12月16日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	42,563,495	-	42,561,400	2,095
	米ドル	32,823,000	-	32,823,000	-
	ユーロ	9,740,495	-	9,738,400	2,095
	売建	43,623,405	-	43,347,205	276,200
	米ドル	9,740,495	-	9,739,605	890
	英ポンド	33,882,910	-	33,607,600	275,310
	合計	86,186,900	-	85,908,605	274,105

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年 6月17日現在		2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	2.2852円	1口当たり純資産額	2.3620円
(1万口当たり純資産額)	(22,852円)	(1万口当たり純資産額)	(23,620円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	2,006,601.40	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,119,759.37	
		US TREASURY N/B-2.75%-20/11/30	3,400,000.00	3,435,659.88	
		US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,405,296.80	
		US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,021,972.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	2,001,992.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,907,273.39	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,412,281.04	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,993,828.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,510,000.00	4,611,122.31	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,516,992.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,379,350.36	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,987,187.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	342,616.40	
		US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,263,575.59	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,213,635.62	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,992,695.32	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,408,255.87	
		US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	3,030,000.00	3,071,307.38	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/05/31	3,400,000.00	3,417,597.38	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,051,912.89			

US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,927,312.50	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	6,095,020.47	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,869,226.58	
US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	3,045,410.10	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,351,136.52	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,958,203.10	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	11,860,000.00	11,952,192.52	
US TREASURY N/B-2.75%-21/08/15	2,100,000.00	2,137,775.22	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,361,328.13	
US TREASURY N/B-1.5%-21/08/31	2,000,000.00	1,995,273.44	
US TREASURY N/B-2.75%-21/09/15	7,500,000.00	7,641,942.75	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,420,015.52	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	2,030,000.00	2,011,207.51	
US TREASURY N/B-1.5%-21/09/30	2,000,000.00	1,995,117.18	
US TREASURY N/B-2.875%-21/10/15	2,000,000.00	2,044,218.60	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,855,508.18	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,985,703.12	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,350,786.07	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,028,828.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	601,429.68	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,150,895.17	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	8,840,000.00	8,819,108.60	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,519,580.00	
US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,073,750.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,506,982.25	
US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,033,867.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,805,519.52	
US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,028,437.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,009,550.50	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,822,413.92	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,006,562.40	
US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	1,200,000.00	1,214,226.48	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,441,842.51	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,010,605.30	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,531,884.75	

US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,012,812.40	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,968,455.44	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,761,950.99	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	5,000,000.00	5,001,757.50	
US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,600,000.00	2,591,824.22	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,912,876.87	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	5,250,000.00	5,251,332.97	
US TREASURY N/B-1.5%-22/09/15	1,950,000.00	1,944,287.10	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,562,688.41	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,410,000.00	2,427,274.63	
US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	2,979,023.43	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,020,859.30	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,425,359.36	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,000,000.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,446,164.41	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,957,509.40	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,007,382.80	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,615,580.81	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,300,000.00	5,360,349.51	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,087,103.50	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	587,556.39	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,991,953.12	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,189,240.62	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,159,682.80	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,730,710.60	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	7,650,000.00	7,679,434.14	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,499,707.03	
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,348,242.09	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,965,078.12	
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,033,847.60	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	11,000,000.00	10,851,113.24	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,460,966.30	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,832,368.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	5,500,000.00	5,445,646.91	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	380,000.00	397,085.14	

US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,698,605.47	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,166,093.60	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	2,963,027.76	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,894,454.78	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,558,496.00	
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,114,081.90	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,046,953.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	5,800,000.00	5,993,937.50	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,444,245.97	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	3,500,000.00	3,566,103.45	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,677,308.14	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,321,321.50	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,028,359.20	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,074,296.80	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	6,005,605.36	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,580,000.00	3,632,441.27	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	4,100,000.00	4,159,738.23	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,669,975.00	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,244,842.10	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,000,000.00	4,015,000.00	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,764,825.91	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,433,201.45	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,100,000.00	2,061,199.22	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,449,781.04	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,000,000.00	1,984,648.44	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,119,378.87	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,450,000.00	5,596,787.57	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,225,546.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,952,435.44	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,560,644.40	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,047,656.25	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,169,477.67	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,608,312.28	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,333,246.08	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,906,312.32	

US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,220,437.50	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	4,000,000.00	4,221,406.00	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	4,000,000.00	4,250,546.80	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	5,301,154.29	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	5,000,000.00	5,353,320.00	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	6,115,531.15	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,406,212.50	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,103,125.00	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,450,000.00	1,525,162.05	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,249,472.60	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,700,000.00	5,665,042.98	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,870,759.60	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,133,434.11	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,076,796.80	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	5,640,000.00	5,600,784.40	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	4,000,000.00	4,094,062.40	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,016,328.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	4,200,000.00	4,234,125.00	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,937,189.24	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	610,000.00	605,091.40	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,210,122.05	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,121,505.87	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,959,937.44	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	3,159,662.48	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	5,265,167.26	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,860,000.00	5,105,151.46	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	6,311,593.75	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,293,202.80	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	3,540,000.00	3,839,309.46	
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	648,535.15	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,800,000.00	5,213,249.76	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	2,000,000.00	2,567,109.20	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	3,660,000.00	4,056,380.56	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,291,054.60	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,570,000.00	4,882,669.78	

US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,280,000.00	4,485,724.19	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	4,280,000.00	4,204,849.20	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	1,000,000.00	993,750.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,504,661.62	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,979,839.71	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,250,000.00	1,800,878.87	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,585,395.63	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,220,000.00	1,679,406.25	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,484,347.61	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,521,766.33	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,391,860.27	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,370,735.86	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,180,256.33	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,853,437.39	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,716,247.87	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,159,648.40	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,197,456.42	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,487,056.15	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	580,234.35	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	875,187.44	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,186,210.80	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,322,578.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,050,000.00	5,638,443.17	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	6,427,899.90	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,760,439.20	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,775,781.10	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	4,124,625.00	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	4,725,052.38	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,773,343.75	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,456,750.00	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,666,499.84	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,945,316.34	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	4,477,687.50	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,935,734.20	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,622,021.25	

		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,147,438.46	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,252,929.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,230,500.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,091,317.02	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,204,375.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,131,155.38	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,177,914.85	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,839,171.68	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	4,746,550.73	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,658,057.52	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	3,827,548.56	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,402,538.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,250,000.00	1,249,877.92	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	2,250,000.00	2,310,952.05	
米ドル小計			646,450,000.00	681,225,423.46	(74,546,498,089)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-21/02/01	825,000.00	829,925.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,140,000.00	2,115,539.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-21/05/01	890,000.00	891,032.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	971,118.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-21/08/01	640,000.00	638,425.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,470,000.00	1,447,406.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-21/11/01	960,000.00	952,752.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/02/01	590,000.00	588,100.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,640,000.00	1,599,213.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,005,999.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,520,000.00	1,494,160.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,144,115.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,294,670.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	820,000.00	831,447.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	811,156.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,163,489.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	950,000.00	945,915.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	660,000.00	648,786.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,065,195.10	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,093,587.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	534,405.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,060,000.00	1,015,363.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,037,000.00	1,069,520.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,060,000.00	1,441,759.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	713,260.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	410,000.00	396,297.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,515,983.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	940,000.00	1,409,210.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,165,000.00	1,644,712.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,315,000.00	1,812,214.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,312,525.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	673,000.00	727,533.19	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	449,704.00	
			32,624,000.00	35,574,524.86	
				(2,954,108,544)	
	加ドル小計				
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	24,654,297.59	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	14,200,000.00	14,360,046.07	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	21,326,392.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	2,000,000.00	2,004,934.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	17,600,000.00	18,421,262.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	10,400,000.00	10,957,346.91	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	24,531,921.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	10,140,604.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	22,100,000.00	23,016,283.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	12,550,000.00	14,025,565.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	12,757,929.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	7,000,000.00	7,546,794.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	10,126,357.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,600,000.00	13,301,028.64	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	15,500,000.00	16,583,058.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	10,870,000.00	12,013,533.78	
メキシコペソ小計			221,770,000.00	235,767,358.12 (1,355,662,309)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,397,825.57	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,194,685.20	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,150,000.00	1,306,666.80	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,187,406.54	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	503,015.13	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,200,000.00	1,365,940.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	657,389.25	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,250,000.00	1,328,898.75	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	850,000.00	1,107,817.75	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,117,486.75	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	1,070,000.00	1,148,453.47	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,524,404.54	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,038,996.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	590,000.00	641,852.15	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	820,000.00	903,534.22	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	971,596.56	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	740,000.00	840,791.70	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	819,816.80	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,475,000.00	2,504,533.77	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	496,406.37	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	655,000.00	819,590.36	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,370,000.00	2,379,676.30	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,405,794.31	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	939,693.37	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	558,604.80	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	490,876.69	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	552,589.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%-21/01/31	770,000.00	774,188.80			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	2,080,000.00	2,249,671.84			

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,758,292.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/10/31	200,000.00	201,675.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,790,000.00	2,028,130.86
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,659,666.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,420,000.00	1,451,575.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	1,972,905.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	1,290,000.00	1,316,386.95
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,640,000.00	1,931,943.94
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,602,024.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,968,837.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	200,000.00	203,294.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,720,000.00	1,958,985.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,900,000.00	2,065,756.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,630,000.00	2,054,437.33
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,770,000.00	1,989,975.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,685,000.00	1,885,552.07
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	2,070,000.00	2,859,152.31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,760,000.00	1,901,287.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,490,000.00	1,632,634.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	2,385,000.00	2,612,123.55
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,901,099.64

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,720,000.00	1,879,927.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	2,067,958.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,080,000.00	3,137,561.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,710,000.00	1,878,615.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,310,000.00	1,333,947.58	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,840,000.00	2,119,437.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,772,654.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,450,000.00	1,764,281.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	730,000.00	840,303.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,396,448.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,453,823.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,570,000.00	2,680,578.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,180,000.00	2,200,130.53	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,320,000.00	1,822,346.98	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	845,000.00	1,135,399.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	605,000.00	972,043.21	
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,210,337.28	
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	748,729.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,410,000.00	1,458,627.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,835,009.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,659,048.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,111,104.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,621,620.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,694,308.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,029,794.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,846,210.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,029,635.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,012,110.87
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,351,163.61
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,131,168.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,965,376.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,866,606.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,762,214.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,933,181.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,800,000.00	2,890,529.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,654,156.27
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,731,832.35
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,420,000.00	2,595,285.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,718,594.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,645,000.00	1,768,355.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,310,000.00	1,893,791.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	2,170,000.00	2,289,020.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,160,000.00	1,223,414.88

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,139,425.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,829,590.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,730,000.00	2,976,939.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	2,005,000.00	3,399,357.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,160,000.00	2,125,379.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,300,000.00	2,564,832.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	2,089,426.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	2,710,000.00	4,273,949.13
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,292,000.00	3,695,467.23
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,140,000.00	2,774,240.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	860,000.00	804,351.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	1,000,000.00	1,048,807.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 21/04/15	1,170,000.00	1,174,095.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,265,445.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,515,000.00	1,528,935.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,580,000.00	2,743,213.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,270,000.00	2,459,024.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.3%- 21/10/15	880,000.00	918,583.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	776,669.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,107,224.06
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	1,950,000.00	2,167,249.50

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,428,717.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	1,000,286.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	600,000.00	615,099.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,298,663.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,800,000.00	2,065,928.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,359,973.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,310,209.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	932,648.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,230,295.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,561,460.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,975,660.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,460,000.00	1,577,128.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,080,000.00	1,096,716.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,190,000.00	2,924,071.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,932,007.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	995,000.00	1,057,603.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,660,000.00	1,755,757.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,726,303.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,050,000.00	1,098,504.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,533,942.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	2,780,000.00	3,411,037.76	

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	675,000.00	704,206.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,463,911.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,433,733.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,215,948.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,756,140.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,295,240.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	720,000.00	778,658.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,560,000.00	2,225,368.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,512,291.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	938,334.82
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,195,000.00	1,291,015.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,560,000.00	3,628,707.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,195,000.00	1,291,160.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,760,000.00	2,299,899.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,435,000.00	1,645,511.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,200,000.00	1,401,244.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,949,794.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	2,117,071.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,680,000.00	3,990,587.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,526,045.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,603,567.22

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	690,000.00	763,569.87
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,970,824.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	650,000.00	790,122.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	962,141.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,549,796.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,386,721.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,742,114.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	310,000.00	362,641.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,702,507.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	1,940,896.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,320,000.00	1,599,560.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,405,605.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,455,000.00	1,818,685.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	785,000.00	1,042,790.07
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	731,668.50
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	738,622.50
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	318,360.00
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	587,960.45
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	254,884.00
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	576,187.04
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	520,000.00	648,471.20
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	342,531.20
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	430,738.21
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	363,514.77
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	474,635.20

FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	420,000.00	443,101.26	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	200,000.00	211,106.40	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	367,680.76	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	480,000.00	544,333.44	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	533,630.32	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	225,000.00	279,763.65	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,133,048.40	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,205,376.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,095,068.25	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,976,627.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	183,479.76	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,256,523.84	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,414,812.92	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,665,018.07	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,525,234.04	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,077,485.97	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,410,000.00	3,574,975.80	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,097,127.50	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,503,522.66	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,430,000.00	4,269,338.15	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	3,000,000.00	3,153,030.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,960,000.00	3,062,629.12	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	3,910,000.00	4,262,971.34	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,730,000.00	4,601,551.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,084,188.10	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,920,000.00	3,139,321.20	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,187,881.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	1,670,000.00	1,755,811.28	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,950,000.00	3,714,008.70	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,965,000.00	4,601,993.11	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,570,000.00	4,414,221.72	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	3,495,000.00	3,983,838.66	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,725,000.00	4,557,905.85	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,685,000.00	3,061,525.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,270,000.00	3,743,652.22	

FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	3,025,000.00	3,745,421.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,815,000.00	5,086,902.05	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,030,000.00	3,271,101.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	2,340,000.00	3,106,916.28	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,690,000.00	2,020,116.15	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,209,597.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	930,000.00	1,919,469.78	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,078,963.05	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	494,118.72	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,490.73	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	652,232.76	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	779,413.01	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,256,391.88	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,105,836.62	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	666,485.95	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	280,000.00	309,091.72	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	981,960.52	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	390,000.00	442,517.40	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	402,255.47	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	500,000.00	603,666.50	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	685,000.00	899,642.69	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	283,000.00	335,984.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,550,111.93	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	708,957.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,322,311.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	403,342.83	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,140,708.66	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,030,415.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	183,912.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,762,745.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,323,743.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,264,817.87	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,323,317.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,757,902.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	906,000.00	984,022.90	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	495,000.00	514,942.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,451,460.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,230,000.00	2,049,542.85	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	715,000.00	759,335.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,305,000.00	2,326,140.31	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,073,000.00	1,785,878.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	205,592.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	657,296.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,350,948.06	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	764,809.27	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,050,478.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	458,598.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,164,191.56	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	941,845.51	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	982,324.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	928,490.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	1,028,165.76	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	722,164.67	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	740,000.00	1,106,015.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	550,000.00	591,015.14	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	574,180.93	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	750,846.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,234,000.00	2,046,854.31	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	629,000.00	1,031,064.97	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	640,000.00	803,179.52	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	633,985.78	
		ユーロ小計	392,397,000.00	479,519,857.86	(58,376,747,495)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	495,000.00	591,077.32	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,049,285.00	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,131,553.32	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,171,163.22	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,184,528.40	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,050,000.00	2,117,793.50	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,710,532.90	

UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,360,000.00	1,384,643.20	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,029,682.96	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,601,279.89	
UK TREASURY-0.625%-25/06/07	50,000.00	50,026.38	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,577,057.72	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,410,000.00	1,473,858.90	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,524,455.68	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,350,000.00	1,457,100.36	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,461,600.00	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	390,000.00	393,276.00	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,195,000.00	1,689,038.33	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,751,904.00	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	1,754,000.00	2,584,729.48	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,450,491.20	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	915,000.00	998,173.50	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,272,903.64	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,905,197.00	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,415,000.00	2,204,135.31	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,465,000.00	2,413,862.92	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,344,327.99	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,566,484.68	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,425,000.00	2,390,024.25	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,660,000.00	1,744,245.00	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	400,000.00	445,216.00	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,145,000.00	1,994,418.25	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,327,000.00	2,224,558.91	
UK TREASURY-1.625%-54/10/22	485,000.00	540,256.05	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,480,000.00	2,801,539.36	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,261,996.25	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,328,083.54	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	3,102,250.49	
UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,665,000.00	1,664,214.12	
UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,635,676.25	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	957,054.93	
UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,684,792.60	

英ポンド小計			52,818,000.00	69,864,488.80 (10,209,297,748)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,195,000.00	7,562,736.45
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	7,700,000.00	8,426,987.80
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,698,007.19
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,453,247.00
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,690,000.00	5,055,125.88
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,784,755.11
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,719,779.00
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	4,025,000.00	6,280,606.77
スウェーデンクローナ小計			40,720,000.00	45,981,245.20 (536,141,319)
ノルウェーク ローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,270,000.00	6,488,271.24
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,370,000.00	5,488,677.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,820,000.00	4,089,727.14
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,343,480.17
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,281,525.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	2,908,620.08
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	2,861,382.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,900,000.00	1,947,965.50
ノルウェークローネ小計			29,460,000.00	30,409,648.13 (368,260,838)
デンマークク ローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,850,000.00	6,268,822.56
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,193,477.20
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,040,000.00	9,119,997.12
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	4,457,240.32
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,500,000.00	1,614,930.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,770,000.00	18,615,523.52
デンマーククローネ小計			35,960,000.00	47,269,990.72 (770,028,148)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,310,000.00	2,330,686.05
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-21/05/25	740,000.00	726,338.97
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,443,984.65
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,180,000.00	1,272,812.90
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,318,201.40

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,970,000.00	2,192,619.85	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,156,490.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,466,355.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,030,000.00	2,094,757.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	900,000.00	919,890.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,330,000.00	2,502,769.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	3,005,560.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,688,679.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,240,000.00	2,366,571.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,141,125.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,220,000.00	1,299,300.00	
ポーランドズロチ小計			30,345,000.00	31,926,141.27	(907,340,934)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,080,000.00	2,223,530.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,386,898.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,850,000.00	2,084,136.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,120,000.00	1,167,372.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,920,000.00	2,217,072.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,090,000.00	2,258,998.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,200,000.00	2,465,606.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,560,000.00	3,066,266.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,926,660.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,508,239.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,080,000.00	2,253,997.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,900,000.00	2,142,542.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,190,000.00	2,575,017.33	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,570,000.00	1,788,248.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,890,000.00	2,116,815.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	945,000.00	965,268.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,582,123.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	640,000.00	750,584.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,235,399.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	835,679.20	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	400,000.00	470,887.80			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	1,230,894.02			

豪ドル小計			35,087,000.00	40,252,240.66 (3,029,786,154)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	616,161.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	558,000.00	554,975.64
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	310,000.00	311,395.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	470,000.00	489,552.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	320,000.00	321,728.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	595,000.00	618,502.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	230,000.00	233,726.55
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	573,836.40
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	260,000.00	270,088.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	300,000.00	308,520.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	605,610.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	415,000.00	443,344.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	350,000.00	383,176.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	364,749.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	524,176.62
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	301,000.00	313,852.70
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	141,813.17
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	423,187.50
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	510,000.00	573,523.05		
シンガポールドル小計			7,592,000.00	8,071,918.13 (652,291,704)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	467,939.83
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	859,222.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	650,000.00	661,639.22
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	774,175.44
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	816,400.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	475,000.00	479,750.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	630,000.00	651,735.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	328,582.36
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,013,810.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	480,000.00	494,400.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	463,837.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	650,000.00	669,662.50

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	520,000.00	538,980.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	769,490.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	634,027.68	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,285,236.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	440,000.00	501,528.23	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	666,426.83	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	920,000.00	1,011,205.76	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	700,000.00	792,329.23	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,780,000.00	1,810,883.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	856,635.01	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,769,238.27	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	976,660.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,344,686.79	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	464,528.47	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	652,437.11	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	611,400.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	848,807.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,306,506.57	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,093,461.87	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	470,300.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	992,766.65	
マレーシアリングット小計			25,830,000.00	27,078,690.52	(715,148,216)
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	4,650,586.13	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	8,280,000.00	8,401,181.51	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	17,950,000.00	20,016,118.59	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	10,000,000.00	9,269,090.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	8,066,089.92	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	8,920,000.00	8,128,182.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	9,510,000.00	8,804,237.22	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,893,410.85	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	11,500,000.00	10,098,655.41	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	7,560,000.00	6,834,500.06	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,132,940.11	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	10,650,000.00	9,264,234.78	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	18,100,000.00	15,696,634.03	
南アフリカランド小計		132,470,000.00	120,255,860.91 (906,729,191)	
合計			155,328,040,689 (155,328,040,689)	

(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 210銘柄	100.0%	47.9%
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 277銘柄	100.0%	37.6%
英ポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.6%
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 22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。

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)	
	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,004,779	-
コール・ローン	193,159,238	67,829,437
株式	29,914,270,770	33,752,819,650
派生商品評価勘定	59,460	348,900
未収配当金	247,384,871	4,351,580
前払金	2,745,000	-
流動資産合計	30,365,624,118	33,825,349,567
資産合計	30,365,624,118	33,825,349,567
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,764,720	-
前受金	-	460,000
未払金	150,710,990	-
未払解約金	769,129	41,011,259
未払利息	299	78
流動負債合計	155,245,138	41,471,337
負債合計	155,245,138	41,471,337
純資産の部		
元本等		
元本	21,413,574,101	20,979,830,566
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,796,804,879	12,804,047,664
元本等合計	30,210,378,980	33,783,878,230
純資産合計	30,210,378,980	33,783,878,230
負債純資産合計	30,365,624,118	33,825,349,567

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券
--------------------	--

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

		2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
1.	期首	2018年12月18日	2019年 6月18日
	期首元本額	19,938,824,885円	21,413,574,101円
	期首からの追加設定元本額	2,201,140,786円	1,182,784,137円
	期首からの一部解約元本額	726,391,570円	1,616,527,672円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	537,962,214円	566,011,536円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,436,530,547円	1,478,069,009円
	DCインデックスバランス(株式60)	2,741,591,469円	2,873,166,184円
	DCインデックスバランス(株式80)	2,845,499,503円	2,974,701,655円
	インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,378,167,811円	1,342,512,868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	3,620,389,631円	3,502,989,777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)	736,772,435円	739,710,271円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,344,781円	50,516,169円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	43,939,510円	41,125,427円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	79,323,480円	61,558,148円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	64,911,156円	57,433,154円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,377,295,747円	3,932,782,940円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	293,334,909円	279,081,289円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	842,546,956円	797,180,254円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,189,483,652円	1,149,490,912円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,174,480,300円	1,133,500,973円
	計	21,413,574,101円	20,979,830,566円
2.	受益権の総数	21,413,574,101口	20,979,830,566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	391,935,000円	447,575,000円
----	---	--------------	--------------

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

(有価証券に関する注記)

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2019年12月16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	1,703,677,456
合計	1,703,677,456

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2019年 6月17日現在)

(単位：円)

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

合計	295,345,000	-	291,650,000	3,695,000
----	-------------	---	-------------	-----------

(2019年12月16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	34,340,000	-	34,690,000	350,000
	合計	34,340,000	-	34,690,000	350,000

(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)

2019年 6月17日現在		2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	1.4108円	1口当たり純資産額	1.6103円
(1万口当たり純資産額)	(14,108円)	(1万口当たり純資産額)	(16,103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	2,858.00	2,000,600	
日本水産	18,700	670.00	12,529,000	
マル八二チ口	2,700	2,825.00	7,627,500	
カネコ種苗	600	1,497.00	898,200	
サカタのタネ	2,200	3,570.00	7,854,000	

ホクト	1,400	1,992.00	2,788,800
ホクリヨウ	300	675.00	202,500
住石ホールディングス	3,900	152.00	592,800
日鉄鉱業	400	5,090.00	2,036,000
三井松島ホールディングス	700	1,217.00	851,900
国際石油開発帝石	75,000	1,095.00	82,125,000
石油資源開発	2,400	3,005.00	7,212,000
K & O エナジーグループ	900	1,659.00	1,493,100
ヒノキヤグループ	500	2,313.00	1,156,500
ショーボンドホールディングス	2,700	4,520.00	12,204,000
ミライト・ホールディングス	5,600	1,682.00	9,419,200
サンヨーホームズ	200	676.00	135,200
日本アクア	800	651.00	520,800
ファーストコーポレーション	700	632.00	442,400
ベステラ	400	1,228.00	491,200
スペースバリューホールディングス	2,400	527.00	1,264,800
ダイセキ環境ソリューション	400	994.00	397,600
第一カッター興業	300	1,813.00	543,900
安藤・間	11,200	966.00	10,819,200
東急建設	5,500	780.00	4,290,000
コムシスホールディングス	6,600	3,165.00	20,889,000
ミサワホーム	1,300	1,205.00	1,566,500
ピーアールホールディングス	2,100	498.00	1,045,800
高松コンストラクショングループ	1,200	2,865.00	3,438,000
東建コーポレーション	600	7,380.00	4,428,000
ソネック	300	813.00	243,900
ヤマウラ	900	895.00	805,500
大成建設	14,400	4,540.00	65,376,000
大林組	43,200	1,249.00	53,956,800
清水建設	43,900	1,119.00	49,124,100
飛島建設	1,300	1,537.00	1,998,100
長谷工コーポレーション	16,700	1,474.00	24,615,800
松井建設	1,700	814.00	1,383,800
銭高組	200	4,030.00	806,000
鹿島建設	33,900	1,480.00	50,172,000
不動テトラ	1,200	1,669.00	2,002,800
大末建設	600	998.00	598,800
鉄建建設	900	2,928.00	2,635,200
西松建設	3,300	2,501.00	8,253,300
三井住友建設	10,500	645.00	6,772,500
大豊建設	1,000	2,975.00	2,975,000
前田建設工業	10,800	1,082.00	11,685,600

ナカノフドー建設	1,300	478.00	621,400
奥村組	2,300	3,025.00	6,957,500
東鉄工業	1,900	3,265.00	6,203,500
イチケン	400	1,812.00	724,800
富士ピー・エス	800	614.00	491,200
浅沼組	500	4,525.00	2,262,500
戸田建設	18,000	738.00	13,284,000
熊谷組	2,000	3,300.00	6,600,000
北野建設	300	2,648.00	794,400
植木組	200	2,578.00	515,600
矢作建設工業	2,000	821.00	1,642,000
ピーエス三菱	1,500	730.00	1,095,000
日本ハウスホールディングス	3,100	503.00	1,559,300
大東建託	5,200	13,605.00	70,746,000
新日本建設	1,900	977.00	1,856,300
N I P P O	3,600	2,380.00	8,568,000
東亜道路工業	300	3,570.00	1,071,000
前田道路	4,600	2,664.00	12,254,400
日本道路	400	6,870.00	2,748,000
東亜建設工業	1,400	1,624.00	2,273,600
日本国土開発	2,600	645.00	1,677,000
若築建設	800	1,740.00	1,392,000
東洋建設	4,900	530.00	2,597,000
五洋建設	17,200	678.00	11,661,600
福田組	500	5,230.00	2,615,000
住友林業	11,000	1,628.00	17,908,000
日本基礎技術	1,600	413.00	660,800
巴コーポレーション	2,000	462.00	924,000
大和ハウス工業	42,700	3,435.00	146,674,500
ライト工業	2,500	1,609.00	4,022,500
積水ハウス	47,300	2,367.50	111,982,750
日特建設	1,200	854.00	1,024,800
北陸電気工事	800	1,136.00	908,800
ユアテック	2,600	712.00	1,851,200
四電工	200	2,844.00	568,800
中電工	1,700	2,624.00	4,460,800
関電工	6,200	1,088.00	6,745,600
きんでん	10,300	1,725.00	17,767,500
東京エネシス	1,500	911.00	1,366,500
トーエネック	400	3,895.00	1,558,000
住友電設	1,200	2,631.00	3,157,200
日本電設工業	2,400	2,304.00	5,529,600

協和エクシオ	6,600	2,841.00	18,750,600
新日本空調	1,200	2,231.00	2,677,200
九電工	3,000	3,525.00	10,575,000
三機工業	3,100	1,548.00	4,798,800
日揮ホールディングス	13,300	1,746.00	23,221,800
中外炉工業	500	1,865.00	932,500
ヤマト	1,500	774.00	1,161,000
太平電業	1,100	2,325.00	2,557,500
高砂熱学工業	3,800	1,986.00	7,546,800
三晃金属工業	200	2,654.00	530,800
朝日工業社	300	3,430.00	1,029,000
明星工業	2,900	979.00	2,839,100
大気社	2,100	4,030.00	8,463,000
ダイダン	1,000	2,858.00	2,858,000
日比谷総合設備	1,400	1,997.00	2,795,800
東芝プラントシステム	3,300	2,666.00	8,797,800
OSJBホールディングス	7,100	273.00	1,938,300
東洋エンジニアリング	1,900	718.00	1,364,200
レイズネクスト	2,300	1,398.00	3,215,400
日本製粉	4,000	1,709.00	6,836,000
日清製粉グループ本社	15,600	2,005.00	31,278,000
日東富士製粉	100	6,470.00	647,000
昭和産業	1,300	3,145.00	4,088,500
鳥越製粉	1,200	924.00	1,108,800
中部飼料	1,700	1,550.00	2,635,000
フィード・ワン	9,200	180.00	1,656,000
東洋精糖	200	1,163.00	232,600
日本甜菜製糖	700	2,042.00	1,429,400
三井製糖	1,200	2,329.00	2,794,800
塩水港精糖	1,500	220.00	330,000
日新製糖	600	2,046.00	1,227,600
森永製菓	3,200	5,430.00	17,376,000
中村屋	400	4,480.00	1,792,000
江崎グリコ	4,100	4,950.00	20,295,000
名糖産業	700	1,320.00	924,000
井村屋グループ	600	1,990.00	1,194,000
不二家	800	2,156.00	1,724,800
山崎製パン	10,400	1,939.00	20,165,600
第一屋製パン	200	990.00	198,000
モロゾフ	200	5,050.00	1,010,000
亀田製菓	800	4,960.00	3,968,000
寿スピリッツ	1,300	7,260.00	9,438,000

カルビー	6,300	3,565.00	22,459,500
森永乳業	2,600	4,415.00	11,479,000
六甲バター	900	1,795.00	1,615,500
ヤクルト本社	9,500	6,190.00	58,805,000
明治ホールディングス	9,100	7,460.00	67,886,000
雪印メグミルク	3,300	2,563.00	8,457,900
プリマハム	2,200	2,538.00	5,583,600
日本ハム	5,300	4,580.00	24,274,000
林兼産業	400	740.00	296,000
丸大食品	1,500	2,361.00	3,541,500
S Foods	1,100	2,837.00	3,120,700
伊藤ハム米久ホールディングス	8,900	721.00	6,416,900
サッポロホールディングス	4,700	2,725.00	12,807,500
アサヒグループホールディングス	28,900	5,154.00	148,950,600
キリンホールディングス	58,600	2,491.00	145,972,600
宝ホールディングス	10,300	1,035.00	10,660,500
オエノンホールディングス	3,600	401.00	1,443,600
養命酒製造	400	1,967.00	786,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,700	2,813.00	27,286,100
サントリー食品インターナショナル	9,200	4,790.00	44,068,000
ダイドーグループホールディングス	700	4,605.00	3,223,500
伊藤園	4,200	5,740.00	24,108,000
キーコーヒー	1,400	2,365.00	3,311,000
ユニカフェ	400	1,032.00	412,800
ジャパンフーズ	200	1,251.00	250,200
日清オイリオグループ	1,800	3,765.00	6,777,000
不二製油グループ本社	3,400	2,998.00	10,193,200
J - オイルミルズ	700	4,335.00	3,034,500
キッコーマン	9,900	5,550.00	54,945,000
味の素	30,500	1,811.00	55,235,500
キューピー	7,700	2,477.00	19,072,900
ハウス食品グループ本社	5,200	3,785.00	19,682,000
カゴメ	5,200	2,660.00	13,832,000
焼津水産化学工業	700	1,049.00	734,300
アリアケジャパン	1,300	7,730.00	10,049,000
ピエトロ	200	1,635.00	327,000
エバラ食品工業	300	2,208.00	662,400
やまみ	100	2,167.00	216,700
ニチレイ	6,600	2,570.00	16,962,000
東洋水産	7,100	4,665.00	33,121,500
イトアンド	500	1,776.00	888,000
大冷	200	1,942.00	388,400

ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	1,071.00	856,800
日清食品ホールディングス	5,900	8,160.00	48,144,000
永谷園ホールディングス	700	2,171.00	1,519,700
一正蒲鉾	500	1,043.00	521,500
フジッコ	1,500	1,967.00	2,950,500
ロック・フィールド	1,500	1,526.00	2,289,000
日本たばこ産業	79,800	2,514.50	200,657,100
ケンコーマヨネーズ	800	2,570.00	2,056,000
わらべや日洋ホールディングス	900	1,732.00	1,558,800
なとり	800	1,714.00	1,371,200
イフジ産業	200	783.00	156,600
ピクルスコーポレーション	300	2,925.00	877,500
北の達人コーポレーション	4,800	682.00	3,273,600
ユーグレナ	5,900	783.00	4,619,700
ミヨシ油脂	500	1,307.00	653,500
理研ビタミン	700	4,000.00	2,800,000
片倉工業	2,000	1,365.00	2,730,000
ゲンゼ	1,000	5,060.00	5,060,000
東洋紡	5,300	1,633.00	8,654,900
ユニチカ	4,000	395.00	1,580,000
富士紡ホールディングス	700	3,495.00	2,446,500
倉敷紡績	1,400	2,635.00	3,689,000
シキボウ	700	1,007.00	704,900
日本毛織	4,400	1,132.00	4,980,800
ダイトウボウ	2,200	86.00	189,200
トーア紡コーポレーション	500	584.00	292,000
ダイドーリミテッド	1,800	279.00	502,200
帝国繊維	1,500	2,138.00	3,207,000
帝人	11,000	2,105.00	23,155,000
東レ	97,700	763.40	74,584,180
サカイオーベックス	400	1,902.00	760,800
住江織物	400	2,917.00	1,166,800
日本フェルト	800	500.00	400,000
イチカワ	200	1,514.00	302,800
日東製網	200	1,697.00	339,400
アツギ	1,100	841.00	925,100
ダイニック	500	800.00	400,000
セーレン	3,300	1,576.00	5,200,800
ソトー	600	971.00	582,600
東海染工	200	1,139.00	227,800
小松マテーレ	2,200	839.00	1,845,800
ワコールホールディングス	3,500	3,030.00	10,605,000

ホギメディカル	1,500	3,650.00	5,475,000
レナウン	3,500	116.00	406,000
クラウドIAホールディングス	300	485.00	145,500
T S Iホールディングス	4,600	554.00	2,548,400
マツオカコーポレーション	400	2,376.00	950,400
ワールド	1,900	2,777.00	5,276,300
三陽商会	700	1,391.00	973,700
ナイガイ	500	467.00	233,500
オンワードホールディングス	8,100	660.00	5,346,000
ルックホールディングス	500	1,200.00	600,000
キムラタン	7,200	31.00	223,200
ゴールドウイン	2,400	8,080.00	19,392,000
デサント	2,600	2,041.00	5,306,600
キング	600	524.00	314,400
ヤマトインターナショナル	800	402.00	321,600
特種東海製紙	900	4,130.00	3,717,000
王子ホールディングス	56,400	643.00	36,265,200
日本製紙	6,000	1,882.00	11,292,000
三菱製紙	1,500	491.00	736,500
北越コーポレーション	8,900	579.00	5,153,100
中越パルプ工業	600	1,703.00	1,021,800
巴川製紙所	400	895.00	358,000
大王製紙	5,900	1,504.00	8,873,600
阿波製紙	400	598.00	239,200
レンゴー	12,700	817.00	10,375,900
トモク	800	1,836.00	1,468,800
ザ・パック	1,000	4,125.00	4,125,000
クラレ	21,200	1,375.00	29,150,000
旭化成	89,400	1,258.50	112,509,900
共和レザー	700	825.00	577,500
昭和電工	9,600	3,005.00	28,848,000
住友化学	99,100	506.00	50,144,600
住友精化	600	3,575.00	2,145,000
日産化学	7,500	4,755.00	35,662,500
ラサ工業	500	1,673.00	836,500
クレハ	1,200	6,680.00	8,016,000
多木化学	400	4,555.00	1,822,000
テイカ	1,000	1,938.00	1,938,000
石原産業	2,400	1,127.00	2,704,800
片倉コープアグリ	400	1,210.00	484,000
日本曹達	2,000	3,060.00	6,120,000
東ソー	20,800	1,670.00	34,736,000

トクヤマ	3,900	2,969.00	11,579,100
セントラル硝子	2,700	2,752.00	7,430,400
東亜合成	8,400	1,293.00	10,861,200
大阪ソーダ	1,400	3,225.00	4,515,000
関東電化工業	3,200	1,005.00	3,216,000
デンカ	4,900	3,345.00	16,390,500
信越化学工業	23,200	12,270.00	284,664,000
日本カーバイド工業	400	1,486.00	594,400
堺化学工業	900	2,564.00	2,307,600
第一稀元素化学工業	1,500	882.00	1,323,000
エア・ウォーター	11,000	1,636.00	17,996,000
大陽日酸	13,000	2,461.00	31,993,000
日本化学工業	400	3,435.00	1,374,000
東邦アセチレン	200	1,356.00	271,200
日本パーカライジング	6,800	1,172.00	7,969,600
高压ガス工業	2,200	863.00	1,898,600
四国化成工業	2,100	1,294.00	2,717,400
戸田工業	300	2,205.00	661,500
ステラ ケミファ	700	3,155.00	2,208,500
保土谷化学工業	500	3,990.00	1,995,000
日本触媒	2,100	6,960.00	14,616,000
大日精化工業	1,200	3,415.00	4,098,000
カネカ	3,500	3,660.00	12,810,000
三菱瓦斯化学	12,700	1,706.00	21,666,200
三井化学	12,200	2,754.00	33,598,800
J S R	12,600	2,096.00	26,409,600
東京応化工業	2,300	4,500.00	10,350,000
大阪有機化学工業	1,300	1,438.00	1,869,400
三菱ケミカルホールディングス	90,100	824.70	74,305,470
K Hネオケム	2,400	2,405.00	5,772,000
ダイセル	18,400	1,071.00	19,706,400
住友ベークライト	2,100	4,300.00	9,030,000
積水化学工業	29,000	1,913.00	55,477,000
日本ゼオン	12,100	1,423.00	17,218,300
アイカ工業	4,000	3,595.00	14,380,000
宇部興産	6,800	2,450.00	16,660,000
積水樹脂	2,400	2,370.00	5,688,000
タキロンシーアイ	3,000	718.00	2,154,000
旭有機材	800	1,727.00	1,381,600
日立化成	6,200	4,050.00	25,110,000
ニチバン	700	1,976.00	1,383,200
リケンテクノス	3,400	542.00	1,842,800

大倉工業	600	2,022.00	1,213,200
積水化成成品工業	1,800	831.00	1,495,800
群栄化学工業	300	2,631.00	789,300
タイガースポリマー	700	607.00	424,900
ミライアル	500	1,395.00	697,500
ダイキアクシス	500	1,008.00	504,000
ダイキョーニシカワ	2,900	899.00	2,607,100
竹本容器	500	1,011.00	505,500
森六ホールディングス	700	2,453.00	1,717,100
日本化薬	8,300	1,395.00	11,578,500
カーリットホールディングス	1,500	650.00	975,000
日本精化	1,100	1,294.00	1,423,400
扶桑化学工業	1,400	3,130.00	4,382,000
トリケミカル研究所	300	8,400.00	2,520,000
A D E K A	6,200	1,685.00	10,447,000
日油	5,100	3,735.00	19,048,500
新日本理化	2,300	211.00	485,300
ハリマ化成グループ	1,100	1,190.00	1,309,000
花王	33,000	8,972.00	296,076,000
第一工業製薬	500	4,475.00	2,237,500
石原ケミカル	400	1,986.00	794,400
日華化学	500	934.00	467,000
ニイタカ	200	1,769.00	353,800
三洋化成工業	800	5,620.00	4,496,000
有機合成薬品工業	1,000	302.00	302,000
大日本塗料	1,500	1,204.00	1,806,000
日本ペイントホールディングス	11,100	5,440.00	60,384,000
関西ペイント	15,100	2,696.00	40,709,600
神東塗料	1,100	226.00	248,600
中国塗料	3,800	1,057.00	4,016,600
日本特殊塗料	1,000	1,492.00	1,492,000
藤倉化成	1,900	576.00	1,094,400
太陽ホールディングス	1,000	4,315.00	4,315,000
D I C	5,700	3,090.00	17,613,000
サカタインクス	2,900	1,222.00	3,543,800
東洋インキS Cホールディングス	2,800	2,722.00	7,621,600
T & K T O K A	1,100	1,032.00	1,135,200
富士フイルムホールディングス	26,400	5,298.00	139,867,200
資生堂	27,400	7,830.00	214,542,000
ライオン	17,900	2,161.00	38,681,900
高砂香料工業	900	2,645.00	2,380,500
マンダム	3,100	3,000.00	9,300,000

ミルボン	1,800	6,140.00	11,052,000
ファンケル	5,600	2,831.00	15,853,600
コーセー	2,600	16,530.00	42,978,000
コタ	700	1,520.00	1,064,000
ポーラ・オルビスホールディングス	5,900	2,720.00	16,048,000
ノエビアホールディングス	1,300	5,840.00	7,592,000
アジュバンコスメジャパン	300	953.00	285,900
エステー	900	1,733.00	1,559,700
アグロ カネショウ	400	1,455.00	582,000
コニシ	2,200	1,515.00	3,333,000
長谷川香料	1,800	1,995.00	3,591,000
星光PMC	800	1,058.00	846,400
小林製薬	3,900	9,060.00	35,334,000
荒川化学工業	1,300	1,702.00	2,212,600
メック	1,000	1,625.00	1,625,000
日本高純度化学	400	2,644.00	1,057,600
タカラバイオ	3,600	2,072.00	7,459,200
JCU	1,700	3,160.00	5,372,000
新田ゼラチン	800	692.00	553,600
OATアグリオ	200	1,708.00	341,600
デクセリアルズ	3,500	1,111.00	3,888,500
アース製薬	1,000	5,730.00	5,730,000
北興化学工業	1,400	601.00	841,400
大成ラミック	500	2,926.00	1,463,000
クミアイ化学工業	5,700	1,055.00	6,013,500
日本農薬	2,500	583.00	1,457,500
アキレス	1,000	1,896.00	1,896,000
有沢製作所	2,200	1,026.00	2,257,200
日東電工	9,500	6,310.00	59,945,000
レック	1,500	1,343.00	2,014,500
三光合成	1,600	451.00	721,600
きもと	2,400	180.00	432,000
藤森工業	1,200	3,505.00	4,206,000
前澤化成工業	900	1,212.00	1,090,800
未来工業	700	2,193.00	1,535,100
ウェーブロックホールディングス	500	808.00	404,000
JSP	800	1,949.00	1,559,200
エフピコ	1,500	6,690.00	10,035,000
天馬	900	2,022.00	1,819,800
信越ポリマー	2,500	1,003.00	2,507,500
東リ	3,400	338.00	1,149,200
ニフコ	5,000	3,090.00	15,450,000

バルカー	1,100	2,610.00	2,871,000	
ユニ・チャーム	26,500	3,640.00	96,460,000	
ショーエイコーポレーション	200	735.00	147,000	
協和キリン	13,800	2,417.00	33,354,600	
武田薬品工業	114,500	4,438.00	508,151,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	121,100	1,850.00	224,035,000	
大日本住友製薬	10,200	2,100.00	21,420,000	
塩野義製薬	17,600	6,427.00	113,115,200	
田辺三菱製薬	16,800	2,005.00	33,684,000	
わかもと製薬	1,500	271.00	406,500	
あすか製薬	1,600	1,262.00	2,019,200	
日本新薬	3,600	8,870.00	31,932,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,378.00	475,600	
中外製薬	14,400	10,045.00	144,648,000	
科研製薬	2,300	6,080.00	13,984,000	
エーザイ	16,500	8,272.00	136,488,000	
ロート製薬	7,100	3,360.00	23,856,000	
小野薬品工業	31,600	2,462.00	77,799,200	
久光製薬	4,100	5,280.00	21,648,000	
持田製薬	1,900	4,510.00	8,569,000	
参天製薬	25,600	1,978.00	50,636,800	
扶桑薬品工業	500	2,062.00	1,031,000	
日本ケミファ	200	2,989.00	597,800	
ツムラ	4,300	3,190.00	13,717,000	
日医工	3,900	1,377.00	5,370,300	
キッセイ薬品工業	2,400	3,080.00	7,392,000	
生化学工業	2,600	1,270.00	3,302,000	
栄研化学	2,400	2,013.00	4,831,200	
日水製薬	600	1,306.00	783,600	
鳥居薬品	800	2,987.00	2,389,600	
JCRファーマ	1,000	8,770.00	8,770,000	
東和薬品	1,700	2,904.00	4,936,800	
富士製薬工業	900	1,391.00	1,251,900	
沢井製薬	2,800	6,800.00	19,040,000	
ゼリア新薬工業	2,500	2,114.00	5,285,000	
第一三共	39,400	7,281.00	286,871,400	
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	1,905.00	5,715,000	
大幸薬品	500	3,040.00	1,520,000	
ダイト	800	3,190.00	2,552,000	
大塚ホールディングス	26,200	4,960.00	129,952,000	
大正製薬ホールディングス	2,900	8,040.00	23,316,000	
ペプチドリーム	7,000	5,060.00	35,420,000	

日本コークス工業	11,900	77.00	916,300
ニチレキ	1,600	1,319.00	2,110,400
ユシロ化学工業	800	1,457.00	1,165,600
ビーピー・カストロール	500	1,583.00	791,500
富士石油	3,700	246.00	910,200
MORESCO	500	1,410.00	705,000
出光興産	15,500	3,005.00	46,577,500
JXTGホールディングス	213,400	502.10	107,148,140
コスモエネルギーホールディングス	4,000	2,566.00	10,264,000
横浜ゴム	8,000	2,307.00	18,456,000
TOYO TIRE	7,900	1,644.00	12,987,600
ブリヂストン	42,300	4,277.00	180,917,100
住友ゴム工業	12,400	1,419.00	17,595,600
藤倉コンポジット	1,200	507.00	608,400
オカモト	800	4,140.00	3,312,000
フコク	600	740.00	444,000
ニッタ	1,500	3,305.00	4,957,500
住友理工	2,700	1,065.00	2,875,500
三ツ星ベルト	1,800	2,170.00	3,906,000
バンドー化学	2,400	953.00	2,287,200
日東紡績	2,000	4,250.00	8,500,000
AGC	13,600	4,020.00	54,672,000
日本板硝子	6,600	664.00	4,382,400
石塚硝子	200	2,402.00	480,400
日本山村硝子	600	1,285.00	771,000
日本電気硝子	5,500	2,432.00	13,376,000
オハラ	600	1,297.00	778,200
住友大阪セメント	2,600	4,870.00	12,662,000
太平洋セメント	8,700	3,345.00	29,101,500
日本ヒューム	1,400	869.00	1,216,600
日本コンクリート工業	3,000	290.00	870,000
三谷セキサン	700	3,790.00	2,653,000
アジアパイルホールディングス	1,900	623.00	1,183,700
東海カーボン	14,400	1,128.00	16,243,200
日本カーボン	700	4,400.00	3,080,000
東洋炭素	800	2,402.00	1,921,600
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,710.00	3,768,000
TOTO	9,800	4,850.00	47,530,000
日本碍子	16,800	1,908.00	32,054,400
日本特殊陶業	10,700	2,171.00	23,229,700
ダントーホールディングス	1,100	119.00	130,900
MARUWA	500	8,320.00	4,160,000

品川リフラクトリーズ	400	3,500.00	1,400,000
黒崎播磨	300	6,470.00	1,941,000
ヨータイ	1,100	750.00	825,000
イソライト工業	700	692.00	484,400
東京窯業	1,800	349.00	628,200
ニッカトー	700	835.00	584,500
フジインコーポレーテッド	1,200	2,994.00	3,592,800
クニミネ工業	600	1,355.00	813,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,391.00	278,200
ニチアス	3,800	2,731.00	10,377,800
ニチハ	1,900	2,783.00	5,287,700
日本製鉄	61,100	1,760.50	107,566,550
神戸製鋼所	25,000	624.00	15,600,000
合同製鐵	700	2,847.00	1,992,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	36,900	1,505.00	55,534,500
東京製鐵	6,700	792.00	5,306,400
共英製鋼	1,500	2,125.00	3,187,500
大和工業	2,900	2,812.00	8,154,800
東京鐵鋼	600	1,610.00	966,000
大阪製鐵	800	1,421.00	1,136,800
淀川製鋼所	1,800	2,088.00	3,758,400
丸一鋼管	4,400	3,155.00	13,882,000
モリ工業	400	2,575.00	1,030,000
大同特殊鋼	2,200	4,980.00	10,956,000
日本高周波鋼業	600	431.00	258,600
日本冶金工業	1,100	2,405.00	2,645,500
山陽特殊製鋼	1,000	1,643.00	1,643,000
愛知製鋼	800	3,920.00	3,136,000
日立金属	14,700	1,539.00	22,623,300
日本金属	400	973.00	389,200
大平洋金属	900	2,608.00	2,347,200
新日本電工	9,100	187.00	1,701,700
栗本鐵工所	700	2,113.00	1,479,100
虹技	200	1,481.00	296,200
日本鑄鉄管	200	1,376.00	275,200
三菱製鋼	1,100	1,112.00	1,223,200
日亜鋼業	2,100	356.00	747,600
日本精線	200	3,295.00	659,000
エンビプロ・ホールディングス	600	801.00	480,600
シンニッタン	2,300	447.00	1,028,100
新家工業	400	1,486.00	594,400
大紀アルミニウム工業所	2,300	785.00	1,805,500

日本軽金属ホールディングス	34,400	240.00	8,256,000
三井金属鉱業	3,700	2,896.00	10,715,200
東邦亜鉛	700	2,208.00	1,545,600
三菱マテリアル	9,000	3,085.00	27,765,000
住友金属鉱山	17,400	3,663.00	63,736,200
D O W Aホールディングス	3,400	4,175.00	14,195,000
古河機械金属	2,400	1,507.00	3,616,800
エス・サイエンス	6,200	48.00	297,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,400	1,570.00	2,198,000
東邦チタニウム	2,500	1,007.00	2,517,500
U A C J	2,100	2,607.00	5,474,700
C Kサンエツ	300	3,115.00	934,500
古河電気工業	4,200	3,070.00	12,894,000
住友電気工業	50,900	1,674.00	85,206,600
フジクラ	16,400	486.00	7,970,400
昭和電線ホールディングス	1,600	1,231.00	1,969,600
タツタ電線	2,700	620.00	1,674,000
カナレ電気	200	1,868.00	373,600
平河ヒューテック	500	1,551.00	775,500
リョービ	1,700	2,174.00	3,695,800
アーレスティ	1,800	570.00	1,026,000
アサヒホールディングス	2,400	2,670.00	6,408,000
稲葉製作所	800	1,447.00	1,157,600
宮地エンジニアリンググループ	400	2,139.00	855,600
トーカロ	3,800	1,152.00	4,377,600
アルファC o	500	1,305.00	652,500
S U M C O	16,300	1,837.00	29,943,100
川田テクノロジーズ	300	6,880.00	2,064,000
R S T e c h n o l o g i e s	400	3,815.00	1,526,000
信和	600	1,080.00	648,000
東洋製罐グループホールディングス	8,700	1,986.00	17,278,200
ホッカンホールディングス	700	1,965.00	1,375,500
コロナ	700	1,139.00	797,300
横河ブリッジホールディングス	2,500	2,005.00	5,012,500
駒井ハルテック	200	1,775.00	355,000
高田機工	100	2,651.00	265,100
三和ホールディングス	13,100	1,267.00	16,597,700
文化シャッター	4,000	1,000.00	4,000,000
三協立山	1,900	1,288.00	2,447,200
アルインコ	1,000	1,297.00	1,297,000
東洋シャッター	300	739.00	221,700
L I X I Lグループ	20,100	1,914.00	38,471,400

日本ファイルコン	1,100	513.00	564,300
ノーリツ	2,800	1,520.00	4,256,000
長府製作所	1,400	2,510.00	3,514,000
リンナイ	2,700	8,620.00	23,274,000
ダイニチ工業	800	697.00	557,600
日東精工	1,900	646.00	1,227,400
三洋工業	200	2,034.00	406,800
岡部	2,800	964.00	2,699,200
ジーテクト	1,700	1,820.00	3,094,000
東プレ	2,500	1,826.00	4,565,000
高周波熱錬	2,600	906.00	2,355,600
東京製綱	1,000	1,348.00	1,348,000
サンコール	800	584.00	467,200
モリテック スチール	1,100	440.00	484,000
パイオラックス	2,000	2,216.00	4,432,000
エイチワン	1,300	866.00	1,125,800
日本発條	14,600	1,015.00	14,819,000
中央発條	200	3,100.00	620,000
アドバネクス	200	1,629.00	325,800
立川ブラインド工業	600	1,409.00	845,400
三益半導体工業	1,200	2,176.00	2,611,200
日本ドライケミカル	400	1,722.00	688,800
日本製鋼所	4,100	2,222.00	9,110,200
三浦工業	5,900	3,790.00	22,361,000
タクマ	4,600	1,332.00	6,127,200
ツガミ	2,900	1,123.00	3,256,700
オークマ	1,600	6,120.00	9,792,000
東芝機械	1,500	3,130.00	4,695,000
アマダホールディングス	17,300	1,300.00	22,490,000
アイダエンジニアリング	3,700	1,027.00	3,799,900
滝澤鉄工所	400	1,435.00	574,000
F U J I	5,900	2,050.00	12,095,000
牧野フライス製作所	1,600	5,200.00	8,320,000
オーエスジー	6,300	2,150.00	13,545,000
ダイジェット工業	200	1,499.00	299,800
旭ダイヤモンド工業	3,600	667.00	2,401,200
D M G 森精機	8,600	1,777.00	15,282,200
ソディック	3,200	1,015.00	3,248,000
ディスコ	1,800	25,680.00	46,224,000
日東工器	800	2,396.00	1,916,800
日進工具	400	2,468.00	987,200
パンチ工業	1,200	563.00	675,600

富士ダイス	600	678.00	406,800
豊和工業	700	848.00	593,600
OKK	600	677.00	406,200
東洋機械金属	1,000	562.00	562,000
津田駒工業	300	1,317.00	395,100
島精機製作所	2,200	2,772.00	6,098,400
オプトラン	1,500	3,075.00	4,612,500
NCホールディングス	400	705.00	282,000
イワキポンプ	600	1,178.00	706,800
フリー	1,400	1,047.00	1,465,800
ヤマシンフィルタ	3,000	859.00	2,577,000
日阪製作所	1,700	1,032.00	1,754,400
やまびこ	2,700	1,242.00	3,353,400
平田機工	600	7,650.00	4,590,000
ペガサスミシン製造	1,400	522.00	730,800
マルマエ	600	999.00	599,400
タツモ	600	1,319.00	791,400
ナプテスコ	8,000	3,530.00	28,240,000
三井海洋開発	1,500	2,679.00	4,018,500
レオン自動機	1,300	1,646.00	2,139,800
S M C	4,300	51,800.00	222,740,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,200	617.00	740,400
ホソカワミクロン	500	4,730.00	2,365,000
ユニオンツール	500	3,300.00	1,650,000
オイレス工業	1,800	1,703.00	3,065,400
日精エー・エス・ビー機械	500	4,820.00	2,410,000
サトーホールディングス	1,900	3,470.00	6,593,000
技研製作所	1,200	5,010.00	6,012,000
日本エアテック	400	751.00	300,400
カワタ	400	1,180.00	472,000
日精樹脂工業	1,200	1,030.00	1,236,000
オカダアイヨン	500	1,263.00	631,500
ワイエイシイホールディングス	600	760.00	456,000
小松製作所	62,400	2,711.00	169,166,400
住友重機械工業	7,900	3,195.00	25,240,500
日立建機	5,500	3,280.00	18,040,000
日工	1,900	893.00	1,696,700
巴工業	600	2,313.00	1,387,800
井関農機	1,400	1,686.00	2,360,400
T O W A	1,400	1,200.00	1,680,000
丸山製作所	300	1,262.00	378,600
北川鉄工所	600	2,419.00	1,451,400

ローツェ	600	4,330.00	2,598,000
タカキタ	500	590.00	295,000
クボタ	73,100	1,786.00	130,556,600
荏原実業	300	2,252.00	675,600
三菱化工機	500	1,968.00	984,000
月島機械	2,600	1,668.00	4,336,800
帝国電機製作所	1,200	1,388.00	1,665,600
新東工業	3,300	1,093.00	3,606,900
澁谷工業	1,200	3,200.00	3,840,000
アイチ コーポレーション	2,400	766.00	1,838,400
小森コーポレーション	3,500	1,161.00	4,063,500
鶴見製作所	1,100	2,047.00	2,251,700
住友精密工業	200	3,360.00	672,000
酒井重工業	200	3,020.00	604,000
荏原製作所	5,700	3,450.00	19,665,000
石井鐵工所	200	2,522.00	504,400
西島製作所	1,400	951.00	1,331,400
北越工業	1,500	1,298.00	1,947,000
ダイキン工業	17,500	15,900.00	278,250,000
オルガノ	500	6,770.00	3,385,000
トーヨーカネツ	600	2,379.00	1,427,400
栗田工業	7,500	3,220.00	24,150,000
椿本チエイン	2,000	3,945.00	7,890,000
大同工業	700	838.00	586,600
木村化工機	1,200	685.00	822,000
アネスト岩田	2,200	1,084.00	2,384,800
ダイフク	7,000	6,680.00	46,760,000
サムコ	400	1,438.00	575,200
加藤製作所	800	1,790.00	1,432,000
油研工業	300	1,744.00	523,200
タダノ	6,700	1,056.00	7,075,200
フジテック	5,000	1,798.00	8,990,000
C K D	3,800	1,933.00	7,345,400
キトー	1,100	1,717.00	1,888,700
平和	3,900	2,248.00	8,767,200
理想科学工業	1,200	1,942.00	2,330,400
S A N K Y O	3,100	3,640.00	11,284,000
日本金銭機械	1,600	920.00	1,472,000
マースグループホールディングス	900	2,101.00	1,890,900
フクシマガリレイ	900	4,090.00	3,681,000
オーイズミ	600	584.00	350,400
ダイコク電機	700	1,665.00	1,165,500

竹内製作所	2,300	1,682.00	3,868,600
アマノ	3,600	3,375.00	12,150,000
JUKI	2,000	912.00	1,824,000
サンデンホールディングス	1,800	856.00	1,540,800
蛇の目ミシン工業	1,300	416.00	540,800
マックス	2,100	2,136.00	4,485,600
グローリー	3,800	3,360.00	12,768,000
新晃工業	1,300	2,024.00	2,631,200
大和冷機工業	2,000	1,315.00	2,630,000
セガサミーホールディングス	13,700	1,616.00	22,139,200
日本ピストンリング	500	1,532.00	766,000
リケン	700	4,365.00	3,055,500
T P R	1,900	2,155.00	4,094,500
ツバキ・ナカシマ	2,800	1,682.00	4,709,600
ホシザキ	4,000	10,010.00	40,040,000
大豊工業	1,200	902.00	1,082,400
日本精工	26,000	1,083.00	28,158,000
NTN	32,000	362.00	11,584,000
ジェイテクト	13,200	1,379.00	18,202,800
不二越	1,300	5,050.00	6,565,000
日本トムソン	4,100	509.00	2,086,900
T H K	8,000	3,085.00	24,680,000
ユーシン精機	1,100	1,045.00	1,149,500
前澤給装工業	500	2,179.00	1,089,500
イーグル工業	1,700	1,142.00	1,941,400
前澤工業	1,000	391.00	391,000
日本ピラー工業	1,400	1,538.00	2,153,200
キッツ	5,600	755.00	4,228,000
マキタ	18,000	3,765.00	67,770,000
日立造船	11,000	440.00	4,840,000
三菱重工業	23,100	4,237.00	97,874,700
I H I	9,900	2,614.00	25,878,600
スター精密	2,200	1,576.00	3,467,200
日清紡ホールディングス	9,200	1,080.00	9,936,000
イビデン	8,400	2,607.00	21,898,800
コニカミノルタ	30,100	723.00	21,762,300
ブラザー工業	16,800	2,333.00	39,194,400
ミネベアミツミ	25,600	2,312.00	59,187,200
日立製作所	66,200	4,318.00	285,851,600
三菱電機	137,700	1,549.00	213,297,300
富士電機	8,300	3,475.00	28,842,500
東洋電機製造	600	1,566.00	939,600

安川電機	14,800	4,315.00	63,862,000
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,388.00	2,498,400
明電舎	2,500	2,259.00	5,647,500
オリジン	400	1,534.00	613,600
山洋電気	700	5,620.00	3,934,000
デンヨー	1,200	2,119.00	2,542,800
東芝テック	1,700	4,550.00	7,735,000
芝浦メカトロニクス	300	3,990.00	1,197,000
マブチモーター	3,800	4,205.00	15,979,000
日本電産	16,600	15,610.00	259,126,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	566.00	509,400
トレックス・セミコンダクター	800	1,563.00	1,250,400
東光高岳	800	1,217.00	973,600
ダブル・スコープ	2,100	993.00	2,085,300
ダイヘン	1,500	3,770.00	5,655,000
ヤーマン	2,000	714.00	1,428,000
JVCケンウッド	11,300	274.00	3,096,200
ミマキエンジニアリング	1,300	530.00	689,000
第一精工	500	2,645.00	1,322,500
日新電機	3,200	1,339.00	4,284,800
大崎電気工業	2,800	730.00	2,044,000
オムロン	12,800	6,700.00	85,760,000
日東工業	2,000	2,576.00	5,152,000
I D E C	2,000	2,325.00	4,650,000
正興電機製作所	300	857.00	257,100
不二電機工業	200	1,300.00	260,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,600	2,426.00	11,159,600
サクサホールディングス	300	1,957.00	587,100
メルコホールディングス	500	3,105.00	1,552,500
テクノメディカ	300	2,097.00	629,100
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	200	1,015.00	203,000
日本電気	16,700	4,455.00	74,398,500
富士通	13,300	10,100.00	134,330,000
沖電気工業	5,600	1,563.00	8,752,800
岩崎通信機	700	829.00	580,300
電気興業	700	3,185.00	2,229,500
サンケン電気	1,500	3,355.00	5,032,500
ナカヨ	300	1,680.00	504,000
アイホン	800	1,919.00	1,535,200
ルネサスエレクトロニクス	65,700	744.00	48,880,800
セイコーエプソン	17,100	1,738.00	29,719,800
ワコム	9,200	484.00	4,452,800

アルバック	2,700	4,550.00	12,285,000
アクセル	600	784.00	470,400
E I Z O	1,100	4,055.00	4,460,500
日本信号	3,500	1,493.00	5,225,500
京三製作所	3,300	583.00	1,923,900
能美防災	1,800	2,484.00	4,471,200
ホーチキ	1,000	1,803.00	1,803,000
星和電機	700	582.00	407,400
エレコム	1,500	4,280.00	6,420,000
パナソニック	157,300	1,036.50	163,041,450
シャープ	15,900	1,780.00	28,302,000
アンリツ	8,900	2,173.00	19,339,700
富士通ゼネラル	3,700	2,418.00	8,946,600
ソニー	87,000	7,466.00	649,542,000
T D K	6,600	12,610.00	83,226,000
帝国通信工業	600	1,216.00	729,600
タムラ製作所	4,600	695.00	3,197,000
アルプスアルパイン	12,200	2,549.00	31,097,800
池上通信機	500	1,048.00	524,000
日本電波工業	1,300	540.00	702,000
鈴木	700	820.00	574,000
日本トリム	200	4,630.00	926,000
ローランド ディー . ジー .	800	2,245.00	1,796,000
フォスター電機	1,500	2,035.00	3,052,500
S M K	400	3,065.00	1,226,000
ヨコオ	900	3,280.00	2,952,000
ホシデン	3,800	1,421.00	5,399,800
ヒロセ電機	2,100	13,930.00	29,253,000
日本航空電子工業	3,200	2,281.00	7,299,200
T O A	1,500	1,144.00	1,716,000
マクセルホールディングス	3,000	1,509.00	4,527,000
古野電気	1,800	1,368.00	2,462,400
ユニデンホールディングス	400	1,889.00	755,600
スミダコーポレーション	1,100	1,319.00	1,450,900
アイコム	800	2,738.00	2,190,400
リオン	600	2,908.00	1,744,800
本多通信工業	1,200	568.00	681,600
船井電機	1,400	702.00	982,800
横河電機	12,600	1,944.00	24,494,400
新電元工業	500	3,830.00	1,915,000
アズビル	8,700	3,205.00	27,883,500
東亜ディーケーケー	700	985.00	689,500

日本光電工業	5,700	2,905.00	16,558,500
チノー	500	1,446.00	723,000
共和電業	1,500	442.00	663,000
日本電子材料	600	855.00	513,000
堀場製作所	2,700	7,720.00	20,844,000
アドバンテスト	10,200	5,790.00	59,058,000
小野測器	600	558.00	334,800
エスペック	1,200	2,266.00	2,719,200
キーエンス	12,500	40,100.00	501,250,000
日置電機	700	3,920.00	2,744,000
シスメックス	9,800	7,532.00	73,813,600
日本マイクロニクス	2,400	1,157.00	2,776,800
メガチップス	1,300	2,060.00	2,678,000
O B A R A G R O U P	700	3,820.00	2,674,000
澤藤電機	200	2,180.00	436,000
原田工業	700	1,045.00	731,500
コーセル	1,700	1,321.00	2,245,700
イリソ電子工業	1,200	5,120.00	6,144,000
オブテックスグループ	2,200	1,581.00	3,478,200
千代田インテグレ	600	2,475.00	1,485,000
アイ・オー・データ機器	600	1,084.00	650,400
レーザーテック	2,800	9,920.00	27,776,000
スタンレー電気	9,700	3,175.00	30,797,500
岩崎電気	600	1,494.00	896,400
ウシオ電機	8,000	1,671.00	13,368,000
岡谷電機産業	1,200	402.00	482,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,300	475.00	617,500
エノモト	500	1,170.00	585,000
日本セラミック	1,400	2,882.00	4,034,800
遠藤照明	800	726.00	580,800
古河電池	1,000	850.00	850,000
双信電機	700	508.00	355,600
山一電機	1,000	1,695.00	1,695,000
図研	900	2,542.00	2,287,800
日本電子	2,700	3,230.00	8,721,000
カシオ計算機	12,200	2,161.00	26,364,200
ファナック	13,100	21,700.00	284,270,000
日本シイエムケイ	3,300	657.00	2,168,100
エンプラス	700	3,625.00	2,537,500
大真空	500	1,788.00	894,000
ローム	6,100	9,070.00	55,327,000
浜松ホトニクス	9,900	4,570.00	45,243,000

三井ハイテック	1,500	1,629.00	2,443,500	
新光電気工業	4,600	1,233.00	5,671,800	
京セラ	19,400	7,492.00	145,344,800	
太陽誘電	6,100	3,125.00	19,062,500	
村田製作所	40,400	6,610.00	267,044,000	
双葉電子工業	2,200	1,429.00	3,143,800	
北陸電気工業	600	1,170.00	702,000	
ニチコン	4,700	1,138.00	5,348,600	
日本ケミコン	1,100	2,145.00	2,359,500	
K O A	2,100	1,464.00	3,074,400	
市光工業	2,100	827.00	1,736,700	
小糸製作所	8,200	5,490.00	45,018,000	
ミツバ	2,600	800.00	2,080,000	
S C R E E Nホールディングス	2,400	7,960.00	19,104,000	
キャノン電子	1,500	2,165.00	3,247,500	
キャノン	74,100	3,080.00	228,228,000	代用有価証券 10,000株
リコー	35,000	1,187.00	41,545,000	
象印マホービン	4,000	1,843.00	7,372,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,753.00	350,600	
東京エレクトロン	9,200	24,910.00	229,172,000	
トヨタ紡織	4,000	1,826.00	7,304,000	
芦森工業	300	1,406.00	421,800	
ユニプレス	2,700	1,595.00	4,306,500	
豊田自動織機	11,100	6,570.00	72,927,000	
モリタホールディングス	2,400	1,767.00	4,240,800	
三櫻工業	1,800	1,296.00	2,332,800	
デンソー	30,300	5,108.00	154,772,400	
東海理化電機製作所	3,600	2,245.00	8,082,000	
三井E & Sホールディングス	5,000	1,000.00	5,000,000	
川崎重工業	10,700	2,564.00	27,434,800	
名村造船所	4,500	273.00	1,228,500	
サノヤスホールディングス	1,900	180.00	342,000	
日本車輛製造	500	3,105.00	1,552,500	
三菱ロジスネクスト	1,900	1,328.00	2,523,200	
近畿車輛	200	1,535.00	307,000	
日産自動車	162,400	678.00	110,107,200	
いすゞ自動車	39,900	1,383.50	55,201,650	
トヨタ自動車	153,400	7,785.00	1,194,219,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,200	1,168.00	20,089,600	
三菱自動車工業	51,000	483.00	24,633,000	
エフテック	1,000	776.00	776,000	

レシップホールディングス	600	677.00	406,200
GMB	300	810.00	243,000
ファルテック	300	1,126.00	337,800
武蔵精密工業	3,100	1,498.00	4,643,800
日産車体	2,700	1,062.00	2,867,400
新明和工業	3,700	1,500.00	5,550,000
極東開発工業	2,600	1,653.00	4,297,800
日信工業	2,800	2,222.00	6,221,600
トピー工業	1,100	2,169.00	2,385,900
ティラド	500	2,025.00	1,012,500
タチエス	2,300	1,499.00	3,447,700
NOK	7,400	1,746.00	12,920,400
フタバ産業	3,900	802.00	3,127,800
KYB	1,500	3,335.00	5,002,500
大同メタル工業	2,700	782.00	2,111,400
プレス工業	6,900	444.00	3,063,600
ミクニ	1,800	349.00	628,200
太平洋工業	2,900	1,505.00	4,364,500
ケーヒン	3,200	2,568.00	8,217,600
河西工業	1,900	919.00	1,746,100
アイシン精機	11,300	4,195.00	47,403,500
マツダ	40,500	957.00	38,758,500
今仙電機製作所	1,300	992.00	1,289,600
本田技研工業	108,400	3,206.00	347,530,400
スズキ	27,300	4,730.00	129,129,000
SUBARU	42,700	2,821.00	120,456,700
安永	700	1,302.00	911,400
ヤマハ発動機	18,000	2,317.00	41,706,000
ショーワ	3,300	2,272.00	7,497,600
TBK	1,700	445.00	756,500
エクセディ	1,900	2,547.00	4,839,300
豊田合成	4,500	2,738.00	12,321,000
愛三工業	2,200	850.00	1,870,000
盟和産業	200	1,149.00	229,800
日本プラスト	1,100	744.00	818,400
ヨロズ	1,300	1,459.00	1,896,700
エフ・シー・シー	2,300	2,422.00	5,570,600
シマノ	5,200	17,630.00	91,676,000
テイ・エス テック	3,200	3,495.00	11,184,000
ジャムコ	700	1,511.00	1,057,700
テルモ	39,000	3,875.00	151,125,000
クリエートメディック	500	1,104.00	552,000

日機装	4,100	1,417.00	5,809,700
日本エム・ディ・エム	800	2,151.00	1,720,800
島津製作所	16,500	3,390.00	55,935,000
JMS	1,200	823.00	987,600
長野計器	1,000	834.00	834,000
ブイ・テクノロジー	600	6,110.00	3,666,000
東京計器	900	1,046.00	941,400
愛知時計電機	200	4,395.00	879,000
インターアクション	800	2,762.00	2,209,600
オーバル	1,200	254.00	304,800
東京精密	2,500	4,210.00	10,525,000
マニー	5,500	2,950.00	16,225,000
ニコン	22,300	1,466.00	32,691,800
トプコン	6,900	1,468.00	10,129,200
オリンパス	76,200	1,607.00	122,453,400
理研計器	1,200	2,327.00	2,792,400
タムロン	1,100	2,654.00	2,919,400
HOYA	27,700	9,722.00	269,299,400
シード	600	1,060.00	636,000
ノーリツ鋼機	900	1,718.00	1,546,200
エー・アンド・デイ	1,300	1,062.00	1,380,600
朝日インテック	11,700	3,125.00	36,562,500
シチズン時計	16,100	616.00	9,917,600
リズム時計工業	400	952.00	380,800
大研医器	1,000	620.00	620,000
メニコン	1,900	4,370.00	8,303,000
シンシア	200	622.00	124,400
松風	600	1,717.00	1,030,200
セイコーホールディングス	1,900	2,849.00	5,413,100
ニプロ	9,500	1,319.00	12,530,500
中本パックス	300	1,574.00	472,200
スノーピーク	600	1,062.00	637,200
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,560.00	6,840,000
トランザクション	900	1,018.00	916,200
SHO-BI	400	396.00	158,400
ニホンフラッシュ	700	2,896.00	2,027,200
前田工織	1,600	2,106.00	3,369,600
永大産業	1,800	353.00	635,400
アートネイチャー	1,500	816.00	1,224,000
バンダイナムコホールディングス	14,200	6,700.00	95,140,000
アイフィスジャパン	400	795.00	318,000
共立印刷	2,400	169.00	405,600

SHOEI	700	5,360.00	3,752,000
フランスベッドホールディングス	2,000	989.00	1,978,000
パイロットコーポレーション	2,400	4,655.00	11,172,000
萩原工業	800	1,702.00	1,361,600
トッパン・フォームズ	3,000	1,218.00	3,654,000
フジシールインターナショナル	3,100	2,504.00	7,762,400
タカラトミー	6,200	1,287.00	7,979,400
廣濟堂	1,000	826.00	826,000
エステールホールディングス	400	688.00	275,200
アーク	5,400	95.00	513,000
タカノ	500	842.00	421,000
プロネクサス	1,200	1,230.00	1,476,000
ホクシン	800	170.00	136,000
ウッドワン	500	1,226.00	613,000
大建工業	900	2,000.00	1,800,000
凸版印刷	19,500	2,259.00	44,050,500
大日本印刷	18,000	3,050.00	54,900,000
共同印刷	400	3,000.00	1,200,000
NISSHA	2,900	1,177.00	3,413,300
光村印刷	100	1,789.00	178,900
TAKARA & COMPANY	700	1,718.00	1,202,600
アシックス	11,400	1,804.00	20,565,600
ツツミ	400	2,143.00	857,200
小松ウオール工業	400	2,389.00	955,600
ヤマハ	8,200	6,180.00	50,676,000
河合楽器製作所	400	3,770.00	1,508,000
クリナップ	1,300	765.00	994,500
ピジョン	8,300	4,085.00	33,905,500
オリバー	300	3,770.00	1,131,000
兼松サステック	100	1,803.00	180,300
キングジム	1,200	887.00	1,064,400
リンテック	3,300	2,494.00	8,230,200
イトーキ	2,900	581.00	1,684,900
任天堂	8,400	45,460.00	381,864,000
三菱鉛筆	2,300	1,709.00	3,930,700
タカラスタANDARD	2,900	2,059.00	5,971,100
コクヨ	6,700	1,722.00	11,537,400
ナカバヤシ	1,400	614.00	859,600
グローブライド	600	2,618.00	1,570,800
オカムラ	4,900	1,090.00	5,341,000
美津濃	1,300	2,793.00	3,630,900
東京電力ホールディングス	109,900	484.00	53,191,600

中部電力	42,100	1,555.50	65,486,550
関西電力	52,200	1,266.50	66,111,300
中国電力	19,000	1,468.00	27,892,000
北陸電力	12,600	816.00	10,281,600
東北電力	34,400	1,106.00	38,046,400
四国電力	12,400	1,096.00	13,590,400
九州電力	28,400	967.00	27,462,800
北海道電力	12,900	531.00	6,849,900
沖縄電力	2,500	2,028.00	5,070,000
電源開発	11,000	2,726.00	29,986,000
エフオン	700	751.00	525,700
イーレックス	1,900	1,787.00	3,395,300
レノバ	2,300	1,120.00	2,576,000
東京瓦斯	26,500	2,672.00	70,808,000
大阪瓦斯	26,700	2,191.00	58,499,700
東邦瓦斯	6,800	4,465.00	30,362,000
北海道瓦斯	700	1,647.00	1,152,900
広島ガス	2,900	364.00	1,055,600
西部瓦斯	1,500	2,603.00	3,904,500
静岡ガス	3,900	996.00	3,884,400
メタウォーター	700	4,285.00	2,999,500
SBSホールディングス	1,200	1,984.00	2,380,800
東武鉄道	14,500	4,060.00	58,870,000
相鉄ホールディングス	4,400	3,010.00	13,244,000
東急	34,800	2,072.00	72,105,600
京浜急行電鉄	17,700	2,116.00	37,453,200
小田急電鉄	20,500	2,594.00	53,177,000
京王電鉄	7,200	6,730.00	48,456,000
京成電鉄	9,600	4,325.00	41,520,000
富士急行	1,900	4,260.00	8,094,000
東日本旅客鉄道	24,200	9,903.00	239,652,600
西日本旅客鉄道	12,300	9,570.00	117,711,000
東海旅客鉄道	11,400	22,130.00	252,282,000
西武ホールディングス	18,500	1,847.00	34,169,500
鴻池運輸	2,200	1,702.00	3,744,400
西日本鉄道	3,800	2,593.00	9,853,400
ハマキョウレックス	1,100	3,535.00	3,888,500
サカイ引越センター	700	7,020.00	4,914,000
近鉄グループホールディングス	13,100	5,930.00	77,683,000
阪急阪神ホールディングス	17,400	4,745.00	82,563,000
南海電気鉄道	6,200	2,994.00	18,562,800
京阪ホールディングス	5,800	5,320.00	30,856,000

神戸電鉄	300	3,970.00	1,191,000
名古屋鉄道	10,700	3,410.00	36,487,000
山陽電気鉄道	900	2,181.00	1,962,900
日本通運	4,600	6,590.00	30,314,000
ヤマトホールディングス	22,900	1,881.00	43,074,900
山九	3,600	5,570.00	20,052,000
丸運	800	307.00	245,600
丸全昭和運輸	1,100	3,105.00	3,415,500
センコーグループホールディングス	7,300	929.00	6,781,700
トナミホールディングス	300	5,340.00	1,602,000
ニッコンホールディングス	4,700	2,749.00	12,920,300
日本石油輸送	100	2,858.00	285,800
福山通運	1,700	4,095.00	6,961,500
セイノーホールディングス	9,800	1,497.00	14,670,600
エスライン	400	1,044.00	417,600
神奈川中央交通	300	4,065.00	1,219,500
日立物流	2,400	3,010.00	7,224,000
丸和運輸機関	1,400	2,446.00	3,424,400
C & F ロジホールディングス	1,300	1,455.00	1,891,500
九州旅客鉄道	11,700	3,675.00	42,997,500
S Gホールディングス	13,700	2,541.00	34,811,700
日本郵船	10,900	2,013.00	21,941,700
商船三井	8,200	2,997.00	24,575,400
川崎汽船	4,000	1,897.00	7,588,000
N S ユナイテッド海運	700	2,277.00	1,593,900
明治海運	1,400	361.00	505,400
飯野海運	6,200	372.00	2,306,400
共栄タンカー	100	1,814.00	181,400
乾汽船	800	1,150.00	920,000
日本航空	23,900	3,383.00	80,853,700
A N Aホールディングス	23,800	3,706.00	88,202,800
パスコ	300	1,963.00	588,900
トランコム	400	7,880.00	3,152,000
日新	1,100	1,876.00	2,063,600
三菱倉庫	4,100	2,892.00	11,857,200
三井倉庫ホールディングス	1,500	1,985.00	2,977,500
住友倉庫	4,800	1,509.00	7,243,200
澁澤倉庫	700	2,345.00	1,641,500
東陽倉庫	2,400	343.00	823,200
日本トランスシティ	2,900	561.00	1,626,900
ケイヒン	300	1,396.00	418,800
中央倉庫	800	1,255.00	1,004,000

川西倉庫	200	1,069.00	213,800
安田倉庫	1,000	1,045.00	1,045,000
ファイズホールディングス	300	602.00	180,600
東洋埠頭	400	1,407.00	562,800
宇徳	1,100	545.00	599,500
上組	7,500	2,404.00	18,030,000
サンリツ	300	707.00	212,100
キムラユニティー	300	1,125.00	337,500
キューソー流通システム	300	1,916.00	574,800
近鉄エクスプレス	2,800	1,877.00	5,255,600
東海運	700	289.00	202,300
エーアイティー	900	961.00	864,900
内外トランスライン	400	1,514.00	605,600
日本コンセプト	400	1,510.00	604,000
NEC ネットエスアイ	1,300	3,580.00	4,654,000
クロスキャット	400	1,159.00	463,600
システナ	4,800	1,763.00	8,462,400
デジタルアーツ	700	5,350.00	3,745,000
日鉄ソリューションズ	2,000	3,605.00	7,210,000
キューブシステム	800	793.00	634,400
エイジア	300	1,401.00	420,300
コア	600	1,417.00	850,200
ソリトンシステムズ	600	1,255.00	753,000
ソフトクリエイティブホールディングス	600	1,803.00	1,081,800
T I S	4,500	6,530.00	29,385,000
ネオス	600	806.00	483,600
電算システム	500	3,040.00	1,520,000
グリー	9,300	503.00	4,677,900
コーエーテクモホールディングス	2,800	2,701.00	7,562,800
三菱総合研究所	600	4,200.00	2,520,000
ボルテージ	300	485.00	145,500
電算	200	2,234.00	446,800
A G S	800	792.00	633,600
ファインデックス	1,200	1,324.00	1,588,800
ブレインパッド	300	5,580.00	1,674,000
K L a b	2,600	827.00	2,150,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,700	979.00	1,664,300
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,863.00	372,600
ネクソン	38,500	1,439.00	55,401,500
アイスタイル	3,500	715.00	2,502,500
エムアップ	400	2,466.00	986,400
エイチーム	1,000	1,123.00	1,123,000

エニグモ	1,000	917.00	917,000
テクノスジャパン	1,100	499.00	548,900
e n i s h	700	635.00	444,500
コロプラ	4,400	1,206.00	5,306,400
ブロードリーフ	6,700	676.00	4,529,200
クロス・マーケティンググループ	700	368.00	257,600
デジタルハーツホールディングス	700	1,051.00	735,700
システム情報	700	1,009.00	706,300
メディアドゥホールディングス	400	3,905.00	1,562,000
じげん	3,400	527.00	1,791,800
ブイキューブ	900	590.00	531,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	906.00	271,800
サイバーリンクス	200	1,225.00	245,000
フィックスターズ	1,500	1,457.00	2,185,500
CARTA HOLDINGS	700	1,281.00	896,700
オブティム	400	3,245.00	1,298,000
セレス	500	1,179.00	589,500
S H I F T	400	7,780.00	3,112,000
ティーガイア	1,200	2,654.00	3,184,800
セック	200	3,685.00	737,000
日本アジアグループ	1,500	369.00	553,500
豆蔵ホールディングス	900	1,416.00	1,274,400
テクマトリックス	1,000	2,327.00	2,327,000
プロシップ	400	1,401.00	560,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,300	2,400.00	7,920,000
GMOペイメントゲートウェイ	2,200	7,230.00	15,906,000
ザッパラス	700	414.00	289,800
システムリサーチ	300	1,725.00	517,500
インターネットイニシアティブ	2,000	2,679.00	5,358,000
さくらインターネット	1,500	688.00	1,032,000
ヴィンクス	400	1,246.00	498,400
GMOクラウド	200	2,659.00	531,800
S R Aホールディングス	700	2,614.00	1,829,800
M i n o r iソリューションズ	300	2,682.00	804,600
システムインテグレータ	500	824.00	412,000
朝日ネット	900	628.00	565,200
e B A S E	900	1,158.00	1,042,200
アバント	1,000	975.00	975,000
アドソル日進	500	2,296.00	1,148,000
フリービット	800	851.00	680,800
コムチュア	1,500	2,417.00	3,625,500
サイバーコム	300	2,114.00	634,200

アステリア	900	630.00	567,000
アイル	400	1,967.00	786,800
マークラインズ	700	2,028.00	1,419,600
メディカル・データ・ビジョン	1,100	861.00	947,100
g u m i	1,800	906.00	1,630,800
ショーケース	400	637.00	254,800
モバイルファクトリー	300	1,345.00	403,500
テラスカイ	500	2,371.00	1,185,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,608.00	964,800
P C Iホールディングス	300	2,194.00	658,200
パイプドHD	200	1,666.00	333,200
アイビーシー	300	1,232.00	369,600
ネオジャパン	300	1,029.00	308,700
P R T I M E S	100	2,207.00	220,700
ランドコンピュータ	200	1,152.00	230,400
ダブルスタンダード	200	4,835.00	967,000
オープンドア	700	1,597.00	1,117,900
マイネット	500	627.00	313,500
アカツキ	500	5,820.00	2,910,000
ベネフィットジャパン	100	1,616.00	161,600
U b i c o mホールディングス	300	1,177.00	353,100
L I N E	3,100	5,200.00	16,120,000
カナミックネットワーク	900	715.00	643,500
ノムラシステムコーポレーション	400	576.00	230,400
チェンジ	300	2,657.00	797,100
シンクロ・フード	600	555.00	333,000
オークネット	900	1,421.00	1,278,900
エイトレッド	200	1,623.00	324,600
A O I T Y O H o l d i n g s	1,400	745.00	1,043,000
マクロミル	2,400	986.00	2,366,400
ビーグリー	300	1,234.00	370,200
オロ	400	3,695.00	1,478,000
テモナ	300	471.00	141,300
サインポスト	200	2,349.00	469,800
ソルクシーズ	600	931.00	558,600
フェイス	500	809.00	404,500
プロトコーポレーション	1,200	1,181.00	1,417,200
ハイマックス	200	1,992.00	398,400
野村総合研究所	22,600	2,289.00	51,731,400
サイバネットシステム	1,000	811.00	811,000
C Eホールディングス	900	448.00	403,200
日本システム技術	200	1,261.00	252,200

インテージホールディングス	1,700	948.00	1,611,600
東邦システムサイエンス	400	926.00	370,400
ソースネクスト	6,400	430.00	2,752,000
インフォコム	1,500	2,496.00	3,744,000
ラクスル	700	3,575.00	2,502,500
F I G	1,600	312.00	499,200
システムサポート	100	1,990.00	199,000
イーソル	500	1,938.00	969,000
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,657.00	2,485,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,579.00	473,700
フォーカスシステムズ	800	885.00	708,000
クレスコ	400	3,520.00	1,408,000
フジ・メディア・ホールディングス	13,000	1,572.00	20,436,000
オービック	4,700	14,470.00	68,009,000
ジャストシステム	2,200	5,950.00	13,090,000
T D C ソフト	1,200	913.00	1,095,600
Zホールディングス	185,600	414.00	76,838,400
トレンドマイクロ	6,000	5,800.00	34,800,000
I Dホールディングス	500	1,461.00	730,500
日本オラクル	2,700	10,070.00	27,189,000
アルファシステムズ	400	2,839.00	1,135,600
フューチャー	1,600	1,826.00	2,921,600
C A C Holdings	900	1,614.00	1,452,600
S Bテクノロジー	500	1,935.00	967,500
トーセ	400	916.00	366,400
オービックビジネスコンサルタント	1,400	4,970.00	6,958,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,200	3,040.00	18,848,000
アイティフォー	1,700	859.00	1,460,300
東計電算	200	3,675.00	735,000
エクスネット	200	975.00	195,000
大塚商会	7,300	4,660.00	34,018,000
サイボウズ	1,600	1,197.00	1,915,200
ソフトブレーン	900	576.00	518,400
電通国際情報サービス	800	4,205.00	3,364,000
デジタルガレージ	2,400	4,420.00	10,608,000
E Mシステムズ	1,000	2,069.00	2,069,000
ウェザーニューズ	500	3,420.00	1,710,000
C I J	1,100	973.00	1,070,300
ビジネスエンジニアリング	200	3,125.00	625,000
日本エンタープライズ	1,400	230.00	322,000
WOWOW	700	2,780.00	1,946,000
スカラ	1,000	744.00	744,000

インテリジェント ウェイブ	600	739.00	443,400
I M A G I C A G R O U P	1,100	601.00	661,100
ネットワンシステムズ	5,200	2,770.00	14,404,000
システムソフト	3,500	111.00	388,500
アルゴグラフィックス	1,100	3,430.00	3,773,000
マーベラス	2,100	750.00	1,575,000
エイベックス	2,300	1,260.00	2,898,000
日本ユニシス	4,200	3,545.00	14,889,000
兼松エレクトロニクス	700	3,655.00	2,558,500
東京放送ホールディングス	8,200	1,815.00	14,883,000
日本テレビホールディングス	11,300	1,478.00	16,701,400
朝日放送グループホールディングス	1,400	762.00	1,066,800
テレビ朝日ホールディングス	3,700	2,113.00	7,818,100
スカパーJ S A Tホールディングス	8,900	480.00	4,272,000
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,434.00	2,677,400
日本BS放送	500	1,085.00	542,500
ビジョン	1,300	1,743.00	2,265,900
スマートバリュー	400	810.00	324,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	500	1,254.00	627,000
コネクシオ	800	1,558.00	1,246,400
クロップス	300	761.00	228,300
日本電信電話	90,300	5,586.00	504,415,800
K D D I	100,700	3,214.00	323,649,800
ソフトバンク	122,800	1,451.00	178,182,800
光通信	1,400	26,800.00	37,520,000
N T T ドコモ	99,800	3,028.00	302,194,400
エムティーアイ	1,400	727.00	1,017,800
G M O インターネット	5,300	2,172.00	11,511,600
アйдママーケティングコミュニケーション	400	689.00	275,600
K A D O K A W A	3,600	1,935.00	6,966,000
学研ホールディングス	400	7,370.00	2,948,000
ゼンリン	2,700	1,955.00	5,278,500
昭文社	700	413.00	289,100
インプレスホールディングス	1,300	189.00	245,700
アイネット	700	1,557.00	1,089,900
松竹	900	16,330.00	14,697,000
東宝	8,100	4,435.00	35,923,500
東映	500	16,910.00	8,455,000
エヌ・ティ・ティ・データ	36,000	1,469.00	52,884,000
ピー・シー・エー	200	4,855.00	971,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,290.00	458,000
D T S	3,000	2,481.00	7,443,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,800	5,480.00	31,784,000
シーイーシー	1,400	2,107.00	2,949,800
カブコン	6,400	2,911.00	18,630,400
アイ・エス・ビー	300	1,975.00	592,500
ジャステック	900	1,126.00	1,013,400
S C S K	3,100	5,800.00	17,980,000
日本システムウエア	500	2,467.00	1,233,500
アイネス	1,400	1,324.00	1,853,600
T K C	1,100	5,380.00	5,918,000
富士ソフト	1,700	4,170.00	7,089,000
N S D	2,200	3,585.00	7,887,000
コナミホールディングス	4,900	4,470.00	21,903,000
福井コンピュータホールディングス	500	3,605.00	1,802,500
J B C Cホールディングス	900	1,872.00	1,684,800
ミロク情報サービス	1,200	3,450.00	4,140,000
ソフトバンクグループ	107,200	4,456.00	477,683,200
ハウスイ	100	888.00	88,800
高千穂交易	500	1,110.00	555,000
伊藤忠食品	300	5,250.00	1,575,000
エレマテック	1,300	1,204.00	1,565,200
J A L U X	400	2,522.00	1,008,800
あらた	1,100	4,455.00	4,900,500
トーメンデバイス	200	3,230.00	646,000
東京エレクトロン デバイス	500	2,596.00	1,298,000
フィールズ	1,100	543.00	597,300
双日	75,000	358.00	26,850,000
アルフレッサ ホールディングス	15,100	2,288.00	34,548,800
横浜冷凍	3,800	1,027.00	3,902,600
神栄	200	737.00	147,400
ラサ商事	700	942.00	659,400
ラクーンホールディングス	700	820.00	574,000
アルコニックス	1,500	1,477.00	2,215,500
神戸物産	4,700	3,650.00	17,155,000
あい ホールディングス	1,900	1,976.00	3,754,400
ディーブイエックス	500	876.00	438,000
ダイワボウホールディングス	1,200	6,370.00	7,644,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,200	1,938.00	6,201,600
ラクト・ジャパン	500	3,500.00	1,750,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,079.00	2,805,400
八洲電機	1,100	916.00	1,007,600
メディアスホールディングス	800	818.00	654,400
レスターホールディングス	1,400	2,038.00	2,853,200

ジューテックホールディングス	300	1,158.00	347,400
大光	600	683.00	409,800
OCHIホールディングス	400	1,470.00	588,000
TOKAIホールディングス	7,200	1,140.00	8,208,000
黒谷	400	459.00	183,600
Cominix	300	822.00	246,600
三洋貿易	700	2,369.00	1,658,300
ビューティガレージ	200	2,466.00	493,200
ウイン・パートナーズ	1,000	1,528.00	1,528,000
ミタチ産業	400	765.00	306,000
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,790.00	10,538,000
明治電機工業	400	1,729.00	691,600
デリカフーズホールディングス	500	708.00	354,000
スターティアホールディングス	400	734.00	293,600
コメダホールディングス	3,000	2,084.00	6,252,000
アセンテック	100	1,893.00	189,300
富士興産	400	717.00	286,800
協栄産業	100	1,666.00	166,600
小野建	1,300	1,385.00	1,800,500
南陽	300	1,946.00	583,800
佐島電機	1,000	943.00	943,000
エコートレーディング	400	549.00	219,600
伯東	800	1,390.00	1,112,000
コンドーテック	1,100	1,131.00	1,244,100
中山福	900	539.00	485,100
ナガイレーベン	2,000	2,631.00	5,262,000
三菱食品	1,500	3,105.00	4,657,500
松田産業	1,000	1,621.00	1,621,000
第一興商	2,000	5,440.00	10,880,000
メディバルホールディングス	14,600	2,389.00	34,879,400
SPK	300	2,920.00	876,000
萩原電気ホールディングス	500	2,887.00	1,443,500
アズワン	900	9,830.00	8,847,000
スズデン	500	1,528.00	764,000
シモジマ	900	1,269.00	1,142,100
ドウシシャ	1,300	1,828.00	2,376,400
小津産業	300	1,789.00	536,700
高速	800	1,234.00	987,200
たけびし	500	1,459.00	729,500
リックス	300	1,750.00	525,000
丸文	1,300	620.00	806,000
ハピネット	1,200	1,396.00	1,675,200

橋本総業ホールディングス	300	1,967.00	590,100
日本ライフライン	4,000	1,532.00	6,128,000
タカショー	700	503.00	352,100
エクセル	400	1,594.00	637,600
マルカ	500	2,370.00	1,185,000
I D O M	3,700	604.00	2,234,800
進和	800	2,481.00	1,984,800
エスケイジャパン	400	445.00	178,000
ダイترون	600	1,884.00	1,130,400
シークス	1,700	1,644.00	2,794,800
田中商事	400	709.00	283,600
オーハシテクニカ	800	1,501.00	1,200,800
白銅	500	1,569.00	784,500
伊藤忠商事	93,200	2,539.50	236,681,400
丸紅	141,200	829.00	117,054,800
高島	200	1,781.00	356,200
長瀬産業	7,600	1,666.00	12,661,600
蝶理	900	2,227.00	2,004,300
豊田通商	15,100	4,000.00	60,400,000
三共生興	2,100	597.00	1,253,700
兼松	5,100	1,476.00	7,527,600
ツカモトコーポレーション	200	1,091.00	218,200
三井物産	119,200	1,983.00	236,373,600
日本紙パルプ商事	800	4,280.00	3,424,000
日立ハイテクノロジーズ	4,700	7,470.00	35,109,000
カメイ	1,800	1,374.00	2,473,200
東都水産	200	2,669.00	533,800
O U G ホールディングス	200	2,640.00	528,000
スターゼン	500	4,350.00	2,175,000
山善	5,300	1,087.00	5,761,100
椿本興業	300	4,055.00	1,216,500
住友商事	85,600	1,668.50	142,823,600
内田洋行	600	8,150.00	4,890,000
三菱商事	95,300	2,924.00	278,657,200
第一実業	700	3,895.00	2,726,500
キャノンマーケティングジャパン	3,900	2,598.00	10,132,200
西華産業	800	1,391.00	1,112,800
佐藤商事	1,200	994.00	1,192,800
菱洋エレクトロ	1,400	2,059.00	2,882,600
東京産業	1,300	609.00	791,700
ユアサ商事	1,300	3,715.00	4,829,500
神鋼商事	300	2,758.00	827,400

小林産業	900	299.00	269,100
阪和興業	2,500	2,938.00	7,345,000
正栄食品工業	900	3,745.00	3,370,500
カナデン	1,100	1,348.00	1,482,800
菱電商事	1,000	1,683.00	1,683,000
フルサト工業	800	1,700.00	1,360,000
岩谷産業	3,000	3,725.00	11,175,000
すてきナイスグループ	600	1,244.00	746,400
昭光通商	500	716.00	358,000
ニチモウ	200	2,015.00	403,000
極東貿易	400	2,244.00	897,600
イワキ	1,800	467.00	840,600
三愛石油	3,300	1,183.00	3,903,900
稲畑産業	3,000	1,613.00	4,839,000
G S Iクレオス	400	1,301.00	520,400
明和産業	1,300	638.00	829,400
クワザワ	500	616.00	308,000
ワキタ	2,900	1,143.00	3,314,700
東邦ホールディングス	4,300	2,467.00	10,608,100
サンゲツ	3,700	2,089.00	7,729,300
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,444.00	3,032,400
シナネンホールディングス	600	1,937.00	1,162,200
伊藤忠エネクス	3,000	911.00	2,733,000
サンリオ	3,800	2,189.00	8,318,200
サンワテクノス	1,000	1,210.00	1,210,000
リョーサン	1,500	2,866.00	4,299,000
新光商事	2,100	886.00	1,860,600
トーホー	600	1,919.00	1,151,400
三信電気	700	1,751.00	1,225,700
東陽テクニカ	1,600	1,210.00	1,936,000
モスフードサービス	1,800	3,075.00	5,535,000
加賀電子	1,400	2,622.00	3,670,800
ソーダニッカ	1,400	622.00	870,800
立花エレテック	1,000	1,830.00	1,830,000
フォーバル	600	1,023.00	613,800
P A L T A C	2,200	5,130.00	11,286,000
三谷産業	1,800	342.00	615,600
太平洋興発	600	814.00	488,400
西本W i s m e t t a cホールディングス	300	3,900.00	1,170,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,530.00	153,000
国際紙パルプ商事	3,300	311.00	1,026,300
ヤマタネ	700	1,551.00	1,085,700

丸紅建材リース	100	1,751.00	175,100
日鉄物産	1,000	5,210.00	5,210,000
泉州電業	400	3,385.00	1,354,000
トラスコ中山	2,800	2,932.00	8,209,600
オートバックスセブン	5,000	1,741.00	8,705,000
モリト	1,000	801.00	801,000
加藤産業	2,100	3,750.00	7,875,000
北恵	300	964.00	289,200
イノテック	800	1,054.00	843,200
イエローハット	2,600	1,969.00	5,119,400
J Kホールディングス	1,300	670.00	871,000
日伝	1,200	2,127.00	2,552,400
北沢産業	1,100	281.00	309,100
杉本商事	700	2,078.00	1,454,600
因幡電機産業	3,900	2,844.00	11,091,600
東テク	500	2,554.00	1,277,000
ミスミグループ本社	17,000	2,777.00	47,209,000
アルテック	1,200	230.00	276,000
タキヒヨー	400	1,977.00	790,800
蔵王産業	300	1,473.00	441,900
スズケン	5,700	4,605.00	26,248,500
ジェコス	1,000	1,076.00	1,076,000
グローセル	1,400	458.00	641,200
ローソン	3,400	6,290.00	21,386,000
サンエー	1,100	4,955.00	5,450,500
カワチ薬品	1,100	2,156.00	2,371,600
エービーシー・マート	2,100	7,530.00	15,813,000
ハードオフコーポレーション	600	814.00	488,400
アスクル	1,400	2,971.00	4,159,400
ゲオホールディングス	2,400	1,318.00	3,163,200
アダストリア	1,900	2,581.00	4,903,900
ジーフット	900	623.00	560,700
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	678.00	135,600
くら寿司	700	4,915.00	3,440,500
キャンドウ	700	1,655.00	1,158,500
パルグループホールディングス	700	3,480.00	2,436,000
エディオン	6,200	1,229.00	7,619,800
サーラコーポレーション	2,800	634.00	1,775,200
ワッツ	600	605.00	363,000
ハローズ	500	2,767.00	1,383,500
フジオフードシステム	600	3,640.00	2,184,000
あみやき亭	300	3,705.00	1,111,500

ひらまつ	2,600	305.00	793,000
大黒天物産	300	3,180.00	954,000
ハニーズホールディングス	1,200	1,575.00	1,890,000
ファーマライズホールディングス	300	640.00	192,000
アルペン	1,100	1,848.00	2,032,800
ハブ	400	999.00	399,600
クオールホールディングス	2,000	1,529.00	3,058,000
ジinzホールディングス	700	7,240.00	5,068,000
ビックカメラ	8,100	1,242.00	10,060,200
D C Mホールディングス	7,300	1,065.00	7,774,500
MonotaRO	9,700	2,803.00	27,189,100
東京一番フーズ	400	627.00	250,800
DDホールディングス	600	1,481.00	888,600
きちりホールディングス	400	836.00	334,400
アークランドサービスホールディングス	1,000	1,893.00	1,893,000
J.フロント リテイリング	16,200	1,492.00	24,170,400
ドトール・日レスホールディングス	2,200	2,180.00	4,796,000
マツモトキヨシホールディングス	5,600	4,175.00	23,380,000
ブロンコピリー	700	2,751.00	1,925,700
Z O Z O	9,300	2,085.00	19,390,500
トレジャー・ファクトリー	400	1,086.00	434,400
物語コーポレーション	300	8,390.00	2,517,000
ココカラファイン	1,400	6,260.00	8,764,000
三越伊勢丹ホールディングス	23,700	1,028.00	24,363,600
Hamee	400	1,273.00	509,200
ウエルシアホールディングス	4,000	6,600.00	26,400,000
クリエイティブSDホールディングス	2,000	2,708.00	5,416,000
丸善C H Iホールディングス	1,600	377.00	603,200
ミサワ	300	782.00	234,600
ティーライフ	200	859.00	171,800
エー・ピーカンパニー	300	570.00	171,000
チムニー	400	2,328.00	931,200
シュッピン	900	1,121.00	1,008,900
ネクステージ	1,900	1,247.00	2,369,300
ジョイフル本田	4,000	1,441.00	5,764,000
鳥貴族	500	2,322.00	1,161,000
麒麟堂ホールディングス	500	2,082.00	1,041,000
ホットランド	900	1,363.00	1,226,700
すかいらーくホールディングス	15,200	2,189.00	33,272,800
S F Pホールディングス	600	2,256.00	1,353,600
綿半ホールディングス	500	1,930.00	965,000
ヨシックス	200	2,853.00	570,600

ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	968.00	3,775,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	688.00	412,800
B E E N O S	500	1,394.00	697,000
あさひ	1,000	1,310.00	1,310,000
日本調剤	400	3,725.00	1,490,000
コスモス薬品	600	22,920.00	13,752,000
トーエル	700	790.00	553,000
オンリー	200	805.00	161,000
セブン&アイ・ホールディングス	53,100	4,068.00	216,010,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,600	1,807.00	6,505,200
ツルハホールディングス	3,000	12,830.00	38,490,000
サンマルクホールディングス	1,100	2,316.00	2,547,600
フェリシモ	300	1,021.00	306,300
トリドールホールディングス	1,700	2,731.00	4,642,700
T O K Y O B A S E	1,200	659.00	790,800
ウイルプラスホールディングス	200	1,001.00	200,200
ジャパンミート	700	2,126.00	1,488,200
サツドラホールディングス	200	1,786.00	357,200
デファクトスタンダード	200	399.00	79,800
アレンザホールディングス	700	931.00	651,700
串カツ田中ホールディングス	200	2,114.00	422,800
パロックジャパンリミテッド	1,000	960.00	960,000
クスリのアオキホールディングス	1,400	7,150.00	10,010,000
力の源ホールディングス	600	876.00	525,600
スシローグローバルホールディングス	1,500	8,740.00	13,110,000
L I X I L ビバ	1,400	1,917.00	2,683,800
メディカルシステムネットワーク	1,300	539.00	700,700
はるやまホールディングス	700	864.00	604,800
ノジマ	2,400	2,279.00	5,469,600
カッパ・クリエイト	1,900	1,508.00	2,865,200
ライトオン	1,000	608.00	608,000
ジーンズメイト	500	312.00	156,000
良品計画	18,000	2,532.00	45,576,000
三城ホールディングス	1,500	287.00	430,500
アドヴァン	2,100	1,334.00	2,801,400
アルビス	500	2,327.00	1,163,500
コナカ	1,600	421.00	673,600
ハウス オブ ローゼ	200	1,661.00	332,200
G - 7ホールディングス	400	4,625.00	1,850,000
イオン北海道	1,400	785.00	1,099,000
コジマ	2,300	506.00	1,163,800

ヒマラヤ	500	840.00	420,000
コーナン商事	1,900	2,575.00	4,892,500
エコス	500	1,687.00	843,500
ワタミ	1,600	1,305.00	2,088,000
マルシェ	300	779.00	233,700
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	32,500	1,819.00	59,117,500
西松屋チェーン	3,000	940.00	2,820,000
ゼンショーホールディングス	6,500	2,440.00	15,860,000
幸楽苑ホールディングス	900	2,039.00	1,835,100
ハークスレイ	300	1,073.00	321,900
サイゼリヤ	2,200	2,617.00	5,757,400
V Tホールディングス	5,700	486.00	2,770,200
魚力	400	1,561.00	624,400
ポプラ	400	524.00	209,600
フジ・コーポレーション	400	2,339.00	935,600
ユナイテッドアローズ	1,400	3,235.00	4,529,000
ハイデイ日高	2,000	2,213.00	4,426,000
京都きもの友禅	800	353.00	282,400
コロワイド	4,500	2,191.00	9,859,500
ピーシーデポコーポレーション	1,900	530.00	1,007,000
壱番屋	1,000	5,510.00	5,510,000
P L A N T	400	653.00	261,200
スギホールディングス	2,700	6,000.00	16,200,000
薬王堂ホールディングス	600	2,530.00	1,518,000
ヴィア・ホールディングス	1,700	678.00	1,152,600
スクロール	2,100	359.00	753,900
ヨンドシーホールディングス	1,400	2,625.00	3,675,000
ファミリーマート	10,900	2,682.00	29,233,800
木曽路	1,800	3,000.00	5,400,000
S R Sホールディングス	1,600	1,046.00	1,673,600
千趣会	2,500	489.00	1,222,500
タカキュー	1,100	191.00	210,100
ケーヨー	2,800	549.00	1,537,200
上新電機	1,600	2,620.00	4,192,000
日本瓦斯	2,100	3,610.00	7,581,000
ロイヤルホールディングス	2,400	2,517.00	6,040,800
東天紅	100	1,262.00	126,200
いなげや	1,700	1,505.00	2,558,500
島忠	2,600	3,025.00	7,865,000
チヨダ	1,400	1,619.00	2,266,600
ライフコーポレーション	1,000	2,535.00	2,535,000
リンガーハット	1,700	2,528.00	4,297,600

MrMaxHD	1,900	500.00	950,000
テンアライド	1,300	443.00	575,900
AOKIホールディングス	2,700	1,131.00	3,053,700
オークワ	2,200	1,481.00	3,258,200
コメリ	2,100	2,366.00	4,968,600
青山商事	2,800	1,578.00	4,418,400
しまむら	1,600	9,090.00	14,544,000
はせがわ	700	402.00	281,400
高島屋	9,900	1,288.00	12,751,200
松屋	2,700	900.00	2,430,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,400	1,324.00	8,473,600
近鉄百貨店	500	3,810.00	1,905,000
パルコ	1,300	1,339.00	1,740,700
丸井グループ	12,400	2,699.00	33,467,600
アクシアル リテイリング	1,100	3,970.00	4,367,000
イオン	52,200	2,293.00	119,694,600
イズミ	2,800	4,070.00	11,396,000
平和堂	2,800	2,096.00	5,868,800
フジ	1,600	1,979.00	3,166,400
ヤオコー	1,500	5,440.00	8,160,000
ゼビオホールディングス	1,600	1,339.00	2,142,400
ケーズホールディングス	13,100	1,408.00	18,444,800
Olympicグループ	700	661.00	462,700
日産東京販売ホールディングス	2,100	288.00	604,800
Genky DrugStores	700	2,447.00	1,712,900
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,343.00	268,600
総合メディカルホールディングス	1,200	2,040.00	2,448,000
ブックオフグループホールディングス	800	1,071.00	856,800
アインホールディングス	1,800	6,480.00	11,664,000
元気寿司	400	2,923.00	1,169,200
ヤマダ電機	41,400	552.00	22,852,800
アークランドサカモト	2,100	1,282.00	2,692,200
ニトリホールディングス	5,900	17,490.00	103,191,000
愛眼	1,100	243.00	267,300
ケーユーホールディングス	700	936.00	655,200
吉野家ホールディングス	4,500	2,712.00	12,204,000
松屋フーズホールディングス	700	4,390.00	3,073,000
サガミホールディングス	1,800	1,380.00	2,484,000
関西スーパーマーケット	1,100	1,068.00	1,174,800
王将フードサービス	1,000	6,470.00	6,470,000
プレナス	1,500	1,953.00	2,929,500
ミニストップ	1,000	1,470.00	1,470,000

アークス	2,800	2,292.00	6,417,600	
パローホールディングス	3,000	2,065.00	6,195,000	
藤久	100	793.00	79,300	
ベルク	700	5,380.00	3,766,000	
大庄	700	1,645.00	1,151,500	
ファーストリテイリング	1,800	66,990.00	120,582,000	
サンドラッグ	5,100	3,975.00	20,272,500	
サクスパー ホールディングス	1,200	911.00	1,093,200	
ヤマザワ	300	1,697.00	509,100	
やまや	300	2,231.00	669,300	
ペルーナ	2,900	701.00	2,032,900	
島根銀行	300	654.00	196,200	
じもとホールディングス	9,100	112.00	1,019,200	
めぶきフィナンシャルグループ	70,600	284.00	20,050,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	1,576.00	2,836,800	
九州フィナンシャルグループ	22,300	487.00	10,860,100	
ゆうちょ銀行	38,500	1,072.00	41,272,000	
富山第一銀行	3,200	365.00	1,168,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	79,900	458.00	36,594,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,300	877.00	8,156,100	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,900	710.00	5,609,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,748.00	2,272,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	3,090.00	7,107,000	
新生銀行	10,000	1,720.00	17,200,000	
あおぞら銀行	8,100	2,890.00	23,409,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	934,800	593.00	554,336,400	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	149,200	486.90	72,645,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	25,700	4,291.00	110,278,700	
三井住友フィナンシャルグループ	93,900	4,062.00	381,421,800	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	46,800	646.00	30,232,800	
群馬銀行	26,700	387.00	10,332,900	
武蔵野銀行	2,000	1,954.00	3,908,000	
千葉興業銀行	3,700	369.00	1,365,300	
筑波銀行	5,600	240.00	1,344,000	
七十七銀行	4,600	1,838.00	8,454,800	
青森銀行	1,100	2,920.00	3,212,000	
秋田銀行	900	2,233.00	2,009,700	
山形銀行	1,500	1,660.00	2,490,000	
岩手銀行	900	2,906.00	2,615,400	
東邦銀行	12,000	281.00	3,372,000	
東北銀行	700	1,043.00	730,100	

みちのく銀行	900	1,533.00	1,379,700
ふくおかフィナンシャルグループ	11,500	2,167.00	24,920,500
静岡銀行	33,700	841.00	28,341,700
十六銀行	1,700	2,626.00	4,464,200
スルガ銀行	13,900	541.00	7,519,900
八十二銀行	32,800	484.00	15,875,200
山梨中央銀行	1,600	1,186.00	1,897,600
大垣共立銀行	2,700	2,472.00	6,674,400
福井銀行	1,200	1,886.00	2,263,200
北國銀行	1,400	3,720.00	5,208,000
清水銀行	500	2,156.00	1,078,000
富山銀行	200	2,479.00	495,800
滋賀銀行	2,700	2,805.00	7,573,500
南都銀行	2,200	2,776.00	6,107,200
百五銀行	12,100	358.00	4,331,800
京都銀行	4,900	4,850.00	23,765,000
紀陽銀行	4,800	1,691.00	8,116,800
ほくほくフィナンシャルグループ	9,000	1,155.00	10,395,000
広島銀行	20,000	545.00	10,900,000
山陰合同銀行	8,000	687.00	5,496,000
中国銀行	11,700	1,127.00	13,185,900
鳥取銀行	500	1,377.00	688,500
伊予銀行	19,400	620.00	12,028,000
百十四銀行	1,400	2,206.00	3,088,400
四国銀行	2,100	1,068.00	2,242,800
阿波銀行	2,200	2,603.00	5,726,600
大分銀行	800	2,800.00	2,240,000
宮崎銀行	900	2,733.00	2,459,700
佐賀銀行	800	1,803.00	1,442,400
沖縄銀行	1,200	3,660.00	4,392,000
琉球銀行	3,100	1,231.00	3,816,100
セブン銀行	45,400	359.00	16,298,600
みずほフィナンシャルグループ	1,845,500	170.20	314,104,100
高知銀行	500	939.00	469,500
山口フィナンシャルグループ	16,900	777.00	13,131,300
長野銀行	400	1,682.00	672,800
名古屋銀行	1,100	3,400.00	3,740,000
北洋銀行	20,300	253.00	5,135,900
愛知銀行	500	3,880.00	1,940,000
中京銀行	500	2,252.00	1,126,000
大光銀行	500	1,712.00	856,000
愛媛銀行	1,900	1,198.00	2,276,200

トマト銀行	500	1,078.00	539,000
京葉銀行	5,700	639.00	3,642,300
栃木銀行	6,500	240.00	1,560,000
北日本銀行	400	2,171.00	868,400
東和銀行	2,400	926.00	2,222,400
福島銀行	1,200	271.00	325,200
大東銀行	700	650.00	455,000
トモニホールディングス	10,400	433.00	4,503,200
フィデアホールディングス	13,400	137.00	1,835,800
池田泉州ホールディングス	15,400	220.00	3,388,000
F P G	4,200	1,015.00	4,263,000
マーキュリアインベストメント	600	761.00	456,600
S B Iホールディングス	15,200	2,317.00	35,218,400
ジャフコ	2,100	4,315.00	9,061,500
大和証券グループ本社	109,000	557.00	60,713,000
野村ホールディングス	238,900	556.20	132,876,180
岡三証券グループ	11,500	402.00	4,623,000
丸三証券	4,100	526.00	2,156,600
東洋証券	4,900	158.00	774,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,500	333.00	5,161,500
光世証券	300	682.00	204,600
水戸証券	4,000	234.00	936,000
いちよし証券	2,600	659.00	1,713,400
松井証券	7,700	885.00	6,814,500
だいこう証券ビジネス	700	695.00	486,500
マネックスグループ	10,300	275.00	2,832,500
極東証券	1,800	775.00	1,395,000
岩井コスモホールディングス	1,300	1,297.00	1,686,100
藍澤證券	2,500	755.00	1,887,500
マネーパートナーズグループ	1,500	241.00	361,500
スパークス・グループ	4,700	260.00	1,222,000
かんぽ生命保険	4,800	1,978.00	9,494,400
S O M P Oホールディングス	25,500	4,440.00	113,220,000
アニコムホールディングス	1,100	3,535.00	3,888,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,500	3,730.00	132,415,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,200	2,670.00	29,904,000
第一生命ホールディングス	76,800	1,865.00	143,232,000
東京海上ホールディングス	48,600	6,232.00	302,875,200
T & Dホールディングス	42,000	1,374.00	57,708,000
アドバンスクリエイト	300	1,929.00	578,700
全国保証	3,800	4,600.00	17,480,000
ジェイリース	400	312.00	124,800

イントラスト	500	705.00	352,500
日本モーゲージサービス	300	1,571.00	471,300
C a s a	400	1,277.00	510,800
アルヒ	2,200	2,351.00	5,172,200
プレミアグループ	800	2,266.00	1,812,800
クレディセゾン	9,500	1,888.00	17,936,000
芙蓉総合リース	1,400	7,270.00	10,178,000
みずほリース	2,100	3,370.00	7,077,000
東京センチュリー	2,700	5,940.00	16,038,000
日本証券金融	6,000	540.00	3,240,000
アイフル	20,700	243.00	5,030,100
リコーリース	1,100	4,100.00	4,510,000
イオンフィナンシャルサービス	8,300	1,710.00	14,193,000
アコム	27,300	482.00	13,158,600
ジャックス	1,500	2,765.00	4,147,500
オリエントコーポレーション	36,700	163.00	5,982,100
日立キャピタル	3,200	2,817.00	9,014,400
アプラスフィナンシャル	6,400	92.00	588,800
オリックス	84,900	1,844.50	156,598,050
三菱UFJリース	34,500	703.00	24,253,500
九州リースサービス	700	600.00	420,000
日本取引所グループ	39,000	1,960.00	76,440,000
イー・ギャランティ	1,500	1,322.00	1,983,000
アサックス	700	665.00	465,500
NECキャピタルソリューション	600	2,451.00	1,470,600
いちご	17,300	460.00	7,958,000
日本駐車場開発	15,200	161.00	2,447,200
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,666.00	1,166,200
ヒューリック	29,000	1,330.00	38,570,000
三栄建築設計	500	1,580.00	790,000
野村不動産ホールディングス	8,200	2,660.00	21,812,000
三重交通グループホールディングス	2,900	623.00	1,806,700
サムティ	1,900	2,114.00	4,016,600
ディア・ライフ	1,900	567.00	1,077,300
コーセーアールイー	400	801.00	320,400
エー・ディー・ワークス	26,200	31.00	812,200
日本商業開発	900	1,626.00	1,463,400
プレサンスコーポレーション	2,200	1,769.00	3,891,800
ユニゾホールディングス	2,100	4,900.00	10,290,000
THEグローバル社	800	487.00	389,600
ハウスコム	200	1,576.00	315,200
日本管理センター	900	1,310.00	1,179,000

サンセイランディック	500	926.00	463,000
エストラスト	200	810.00	162,000
フージャースホールディングス	2,800	735.00	2,058,000
オープンハウス	4,000	3,080.00	12,320,000
東急不動産ホールディングス	37,000	765.00	28,305,000
飯田グループホールディングス	11,400	1,943.00	22,150,200
イーランド	300	842.00	252,600
ムゲンエステート	1,000	798.00	798,000
ビーロット	300	1,975.00	592,500
ファーストブラザーズ	300	1,296.00	388,800
ハウズドゥ	800	1,526.00	1,220,800
シーアールイー	400	1,106.00	442,400
プロパティエージェント	200	1,153.00	230,600
ケイアイスター不動産	400	2,133.00	853,200
アグレ都市デザイン	300	550.00	165,000
グッドコムアセット	300	1,901.00	570,300
ジェイ・エス・ビー	100	5,230.00	523,000
テンポイノベーション	200	1,035.00	207,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	646.00	193,800
パーク24	7,300	2,487.00	18,155,100
パラカ	400	2,026.00	810,400
三井不動産	67,800	2,739.00	185,704,200
三菱地所	95,200	2,125.00	202,300,000
平和不動産	2,500	2,973.00	7,432,500
東京建物	14,900	1,715.00	25,553,500
ダイビル	3,500	1,219.00	4,266,500
京阪神ビルディング	2,200	1,452.00	3,194,400
住友不動産	30,500	3,934.00	119,987,000
テーオーシー	2,700	915.00	2,470,500
東京楽天地	200	6,250.00	1,250,000
レオパレス21	17,900	367.00	6,569,300
スターツコーポレーション	1,900	2,766.00	5,255,400
フジ住宅	1,600	686.00	1,097,600
空港施設	1,400	555.00	777,000
明和地所	800	615.00	492,000
ゴールドクレスト	1,100	2,142.00	2,356,200
エスリード	500	2,168.00	1,084,000
日神不動産	2,100	559.00	1,173,900
日本エスコン	2,500	1,010.00	2,525,000
タカラレーベン	6,300	510.00	3,213,000
サンヨーハウジング名古屋	800	1,023.00	818,400
イオンモール	6,800	1,896.00	12,892,800

毎日コムネット	300	866.00	259,800
ファースト住建	600	1,262.00	757,200
カチタス	1,700	4,640.00	7,888,000
トーセイ	1,900	1,516.00	2,880,400
サンフロンティア不動産	1,900	1,346.00	2,557,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,200	1,138.00	1,365,600
インテリックス	400	713.00	285,200
ランドビジネス	600	751.00	450,600
グランディハウス	1,200	485.00	582,000
日本空港ビルデング	4,300	6,070.00	26,101,000
日本工営	900	3,820.00	3,438,000
L I F U L L	4,600	547.00	2,516,200
ジェイエイシーリクルートメント	900	2,065.00	1,858,500
日本M&Aセンター	9,900	3,780.00	37,422,000
メンバーズ	400	2,219.00	887,600
中広	100	542.00	54,200
アイティメディア	400	741.00	296,400
タケエイ	1,300	1,298.00	1,687,400
E・Jホールディングス	200	1,689.00	337,800
トラスト・テック	1,500	1,307.00	1,960,500
コシダカホールディングス	3,200	1,511.00	4,835,200
アルトナー	300	800.00	240,000
パソナグループ	1,600	1,665.00	2,664,000
C D S	400	1,489.00	595,600
リンクアンドモチベーション	2,900	644.00	1,867,600
G C A	1,600	938.00	1,500,800
エス・エム・エス	4,100	3,055.00	12,525,500
サニーサイドアップ	300	1,021.00	306,300
パーソルホールディングス	13,200	1,999.00	26,386,800
リニカル	600	1,144.00	686,400
クックパッド	4,700	364.00	1,710,800
エスクリ	400	774.00	309,600
アイ・ケイ・ケイ	700	716.00	501,200
学情	500	2,021.00	1,010,500
スタジオアリス	700	1,924.00	1,346,800
シミックホールディングス	700	1,892.00	1,324,400
エプコ	200	1,513.00	302,600
N J S	300	1,825.00	547,500
総合警備保障	5,200	5,860.00	30,472,000
カカクコム	9,900	2,703.00	26,759,700
アイロムグループ	500	1,472.00	736,000
セントケア・ホールディング	900	464.00	417,600

サイネックス	200	694.00	138,800
ルネサンス	700	1,735.00	1,214,500
ディップ	1,900	3,195.00	6,070,500
オプトホールディング	700	1,682.00	1,177,400
新日本科学	1,400	774.00	1,083,600
ツクイ	3,100	560.00	1,736,000
キャリアデザインセンター	400	1,312.00	524,800
ベネフィット・ワン	3,600	2,244.00	8,078,400
エムスリー	29,000	3,085.00	89,465,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	621.00	558,900
プラス	200	944.00	188,800
アウトソーシング	7,500	1,203.00	9,022,500
ウェルネット	1,300	780.00	1,014,000
ワールドホールディングス	400	1,971.00	788,400
ディー・エヌ・エー	6,400	1,780.00	11,392,000
博報堂D Yホールディングス	18,300	1,779.00	32,555,700
ぐるなび	2,300	997.00	2,293,100
タカミヤ	1,400	705.00	987,000
ジャパンベストレスキューシステム	900	1,150.00	1,035,000
ファンコミュニケーションズ	3,700	502.00	1,857,400
ライク	500	1,578.00	789,000
ビジネス・ブレークスルー	600	349.00	209,400
エスプール	2,600	742.00	1,929,200
WDBホールディングス	600	2,549.00	1,529,400
ティア	800	606.00	484,800
C D G	200	1,416.00	283,200
バリューコマース	700	2,380.00	1,666,000
インフォマート	7,200	1,926.00	13,867,200
J Pホールディングス	4,100	317.00	1,299,700
エコナックホールディングス	2,300	140.00	322,000
E P Sホールディングス	2,000	1,442.00	2,884,000
レグス	300	1,632.00	489,600
プレステージ・インターナショナル	4,900	975.00	4,777,500
アミューズ	700	3,025.00	2,117,500
ドリームインキュベータ	400	1,597.00	638,800
クイック	800	1,677.00	1,341,600
T A C	900	231.00	207,900
ケネディクス	12,500	582.00	7,275,000
電通	13,600	4,140.00	56,304,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,301.00	650,500
ぴあ	400	4,775.00	1,910,000
イオンファンタジー	500	3,080.00	1,540,000

シーティーエス	1,500	783.00	1,174,500
ネクシィーズグループ	500	1,807.00	903,500
みらかホールディングス	3,700	2,625.00	9,712,500
アルプス技研	1,200	1,990.00	2,388,000
ダイオーズ	300	1,346.00	403,800
日本空調サービス	1,400	824.00	1,153,600
オリエンタルランド	14,000	14,795.00	207,130,000
ダスキン	3,400	3,045.00	10,353,000
明光ネットワークジャパン	1,600	1,015.00	1,624,000
ファルコホールディングス	700	1,756.00	1,229,200
秀英予備校	300	459.00	137,700
田谷	300	620.00	186,000
ラウンドワン	3,700	1,044.00	3,862,800
リゾートトラスト	6,000	1,853.00	11,118,000
ビー・エム・エル	1,700	3,100.00	5,270,000
ワタベウェディング	200	585.00	117,000
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,405.00	3,372,000
リソー教育	6,000	384.00	2,304,000
早稲田アカデミー	400	930.00	372,000
ユー・エス・エス	14,700	2,098.00	30,840,600
東京個別指導学院	500	710.00	355,000
サイバーエージェント	7,600	3,885.00	29,526,000
楽天	61,300	937.00	57,438,100
クリーク・アンド・リバー社	700	1,139.00	797,300
テー・オー・ダブリュー	1,200	884.00	1,060,800
山田コンサルティンググループ	600	1,682.00	1,009,200
セントラルスポーツ	500	3,245.00	1,622,500
フルキャストホールディングス	1,300	2,398.00	3,117,400
エン・ジャパン	2,300	5,370.00	12,351,000
リソルホールディングス	100	4,130.00	413,000
テクノプロ・ホールディングス	2,600	7,640.00	19,864,000
アトラ	300	369.00	110,700
インターワークス	300	535.00	160,500
アイ・アールジャパンホールディングス	500	4,315.00	2,157,500
Keeper 技研	500	1,301.00	650,500
ファーストロジック	300	634.00	190,200
三機サービス	300	1,061.00	318,300
Gunosy	900	1,520.00	1,368,000
デザインワン・ジャパン	300	335.00	100,500
イー・ガーディアン	700	1,974.00	1,381,800
リブセンス	800	304.00	243,200
ジャパンマテリアル	4,000	1,741.00	6,964,000

ベクトル	1,700	1,023.00	1,739,100
ウチヤマホールディングス	700	543.00	380,100
チャーム・ケア・コーポレーション	500	1,892.00	946,000
ライクキッズ	300	817.00	245,100
キャリアリンク	400	584.00	233,600
I B J	900	1,072.00	964,800
アサンテ	500	2,031.00	1,015,500
N・フィールド	900	689.00	620,100
バリューHR	300	3,600.00	1,080,000
M&Aキャピタルパートナーズ	900	4,275.00	3,847,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	2,007.00	1,003,500
E R Iホールディングス	400	783.00	313,200
アビスト	200	2,633.00	526,600
シグマクシス	900	2,174.00	1,956,600
ウィルグループ	900	1,203.00	1,082,700
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	1,900	234.00	444,600
リクルートホールディングス	94,200	4,139.00	389,893,800
エラン	800	1,607.00	1,285,600
土木管理総合試験所	600	479.00	287,400
ネットマーケティング	500	936.00	468,000
日本郵政	107,800	1,060.00	114,268,000
ベルシステム24ホールディングス	2,200	1,663.00	3,658,600
鎌倉新書	1,000	1,647.00	1,647,000
S M N	200	841.00	168,200
一蔵	200	745.00	149,000
L I T A L I C O	500	2,288.00	1,144,000
グローバルキッズCOMPANY	200	728.00	145,600
エボラブルアジア	600	2,001.00	1,200,600
アトラエ	300	3,395.00	1,018,500
ストライク	500	4,180.00	2,090,000
ソラスト	3,600	1,193.00	4,294,800
セラク	400	761.00	304,400
インソース	600	3,405.00	2,043,000
ベイカレント・コンサルティング	800	5,300.00	4,240,000
Orchestra Holdings	300	1,062.00	318,600
アイモバイル	400	628.00	251,200
キャリアインデックス	500	452.00	226,000
M S - J a p a n	400	1,562.00	624,800
船場	200	1,160.00	232,000
グレイステクノロジー	600	2,759.00	1,655,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	2,746.00	3,844,400
フルテック	200	1,414.00	282,800

グリーンズ	500	1,167.00	583,500
ツナググループ・ホールディングス	200	627.00	125,400
GameWith	300	787.00	236,100
ソウルドアウト	200	1,916.00	383,200
MS&Consulting	200	1,015.00	203,000
日総工産	900	1,015.00	913,500
キュービーネットホールディングス	800	2,345.00	1,876,000
RPAホールディングス	800	1,161.00	928,800
スプリックス	500	1,167.00	583,500
マネジメントソリューションズ	100	2,450.00	245,000
アドバンテッジリスクマネジメント	700	1,019.00	713,300
リログループ	7,200	2,953.00	21,261,600
東祥	800	2,523.00	2,018,400
エイチ・アイ・エス	2,000	3,160.00	6,320,000
ラックランド	300	2,527.00	758,100
共立メンテナンス	2,200	4,985.00	10,967,000
イチネンホールディングス	1,500	1,506.00	2,259,000
建設技術研究所	900	2,176.00	1,958,400
スペース	900	1,314.00	1,182,600
長大	500	1,296.00	648,000
燦ホールディングス	600	1,410.00	846,000
スバル興業	100	8,760.00	876,000
東京テアトル	500	1,386.00	693,000
タナベ経営	200	1,297.00	259,400
ナガワ	400	8,140.00	3,256,000
よみうりランド	300	4,620.00	1,386,000
東京都競馬	900	3,500.00	3,150,000
常磐興産	500	1,659.00	829,500
カナモト	2,200	2,945.00	6,479,000
東京ドーム	5,300	1,055.00	5,591,500
西尾レントオール	1,300	3,235.00	4,205,500
トランス・コスモス	1,200	2,974.00	3,568,800
乃村工藝社	5,600	1,413.00	7,912,800
藤田観光	600	2,919.00	1,751,400
KNT-CTホールディングス	800	1,496.00	1,196,800
日本管財	1,400	1,970.00	2,758,000
トーカイ	1,300	2,895.00	3,763,500
白洋舎	200	2,927.00	585,400
セコム	14,000	9,855.00	137,970,000
セントラル警備保障	600	6,300.00	3,780,000
丹青社	2,500	1,292.00	3,230,000
メイテック	1,600	6,170.00	9,872,000

応用地質	1,400	1,529.00	2,140,600	
船井総研ホールディングス	2,700	2,511.00	6,779,700	
進学会ホールディングス	500	528.00	264,000	
オオバ	1,100	909.00	999,900	
いであ	200	3,005.00	601,000	
学究社	400	1,379.00	551,600	
ベネッセホールディングス	4,400	2,910.00	12,804,000	
イオンディライト	1,600	3,900.00	6,240,000	
ナック	800	1,036.00	828,800	
ニチイ学館	1,900	1,541.00	2,927,900	
ダイセキ	2,200	3,245.00	7,139,000	
ステップ	500	1,540.00	770,000	
合 計	16,088,900		33,752,819,650	

(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)

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
預金	145,237,307	166,523,489
金銭信託	87,190,501	-
コール・ローン	2,103,949,507	3,145,255,097
出資金	15,104,556	-
株式	118,809,162,527	210,467,110,343
投資証券	3,394,632,713	5,815,239,695
派生商品評価勘定	79,991,679	79,198,902
未収入金	3,051,084	440,681
未収配当金	186,858,836	259,500,406
差入委託証拠金	472,191,905	413,076,384
流動資産合計	125,297,370,615	220,346,344,997
資産合計		
	125,297,370,615	220,346,344,997
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,166,676	257,183
未払金	12,623,324	-

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
未払解約金	24,761,992	43,733,713
未払利息	3,260	3,646
流動負債合計	47,555,252	43,994,542
負債合計	47,555,252	43,994,542
純資産の部		
元本等		
元本	50,023,894,747	79,674,652,979
剰余金		
剰余金又は欠損金()	75,225,920,616	140,627,697,476
元本等合計	125,249,815,363	220,302,350,455
純資産合計	125,249,815,363	220,302,350,455
負債純資産合計	125,297,370,615	220,346,344,997

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)

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
1. 期首	2018年12月18日	2019年 6月18日
期首元本額	39,566,377,247円	50,023,894,747円
期首からの追加設定元本額	12,496,514,600円	31,663,114,820円
期首からの一部解約元本額	2,038,997,100円	2,012,356,588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)	17,854,644,176円	18,640,569,871円
DCインデックスバランス(株式20)	101,931,648円	109,992,860円
DCインデックスバランス(株式40)	270,453,423円	288,224,996円
DCインデックスバランス(株式60)	516,401,157円	559,244,998円
DCインデックスバランス(株式80)	539,060,037円	579,155,862円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,081,523,584円	2,024,843,992円
日興五大陸株式ファンド	5,215,211,662円	4,919,411,603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)	79,477,525円	71,920,825円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	149,883,088円	141,714,299円
インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	6,970,502,622円	6,921,196,311円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	7,505,308,494円	36,975,565,997円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,927,820円	4,901,851円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	4,247,998円	4,020,522円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	7,619,790円	6,013,161円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	6,156,373円	5,617,117円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,120,343,469円	3,856,501,168円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	27,728,167円	27,269,522円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	79,735,404円	77,445,621円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	113,117,510円	111,907,219円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	111,654,745円	110,203,312円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,263,966,055円	4,238,931,872円
計	50,023,894,747円	79,674,652,979円
2. 受益権の総数	50,023,894,747口	79,674,652,979口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月17日現在	2019年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2019年12月16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	7,980,366,329
投資証券	262,710,251
合計	7,717,656,078

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2019年 6月17日現在)

(単位:円)

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

(2019年12月16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	4,880,243,533	-	4,933,804,832	53,561,299
合計		4,880,243,533	-	4,933,804,832	53,561,299

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2019年 6月17日現在)

(単位：円)

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

(2019年12月16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	4,305,586,080	-	4,330,966,500	25,380,420
	米ドル	3,495,233,180	-	3,515,387,000	20,153,820
	ユーロ	810,352,900	-	815,579,500	5,226,600
	合計	4,305,586,080	-	4,330,966,500	25,380,420

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年 6月17日現在		2019年12月16日現在	
1口当たり純資産額	2.5038円	1口当たり純資産額	2.7650円
(1万口当たり純資産額)	(25,038円)	(1万口当たり純資産額)	(27,650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	21.35	336,347.90	
	BAKER HUGHES CO	33,175	23.64	784,257.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	17,770	16.10	286,097.00	
	CHENIERE ENERGY INC	12,390	60.99	755,666.10	
	CHEVRON CORP	93,371	117.96	11,014,043.16	
	CONCHO RESOURCES INC	9,175	78.75	722,531.25	
	CONOCOPHILLIPS	54,930	62.70	3,444,111.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,640	33.38	188,263.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	18,101	23.48	425,011.48	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,280	85.09	619,455.20	
	EOG RESOURCES INC	28,742	75.49	2,169,733.58	

EXXON MOBIL CORP	208,011	69.23	14,400,601.53
HALLIBURTON CO	40,547	23.99	972,722.53
HESS CORP	12,950	62.32	807,044.00
HOLLYFRONTIER CORP	7,740	50.19	388,470.60
KINDER MORGAN INC	98,100	20.20	1,981,620.00
MARATHON OIL CORP	36,877	12.72	469,075.44
MARATHON PETROLEUM CORP	32,682	58.61	1,915,492.02
NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,851	23.80	543,853.80
NOBLE ENERGY INC	26,342	22.38	589,533.96
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,481	37.71	1,639,668.51
ONEOK INC	20,900	73.17	1,529,253.00
PHILLIPS 66	21,635	112.99	2,444,538.65
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,620	139.99	1,066,723.80
SCHLUMBERGER LTD	69,741	39.00	2,719,899.00
TARGA RESOURCES CORP	12,250	37.11	454,597.50
TECHNIPFMC PLC	24,891	20.00	497,820.00
VALERO ENERGY CORP	20,572	93.81	1,929,859.32
WILLIAMS COS INC	59,504	22.71	1,351,335.84
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,075	230.74	2,555,445.50
ALBEMARLE CORP	4,530	66.63	301,833.90
AMCOR PLC	87,230	10.56	921,148.80
AVERY DENNISON CORP	4,640	129.99	603,153.60
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,870	30.24	298,468.80
BALL CORP	15,170	63.34	960,867.80
CELANESE CORP	5,540	124.47	689,563.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,140	45.14	547,999.60
CORTEVA INC	35,652	26.49	944,421.48
CROWN HOLDINGS INC	6,965	71.74	499,669.10
DOW INC	35,615	53.28	1,897,567.20
DUPONT DE NEMOURS INC	37,532	64.80	2,432,073.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,125	78.57	481,241.25
ECOLAB INC	12,990	185.50	2,409,645.00
FMC CORP	6,990	99.18	693,268.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	70,748	12.87	910,526.76
INTERNATIONAL PAPER CO	16,760	46.36	776,993.60

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,235	133.98	701,385.30
LINDE PLC	26,640	209.05	5,569,092.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,300	92.62	1,139,226.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,865	276.30	791,599.50
MOSAIC CO/THE	17,490	18.63	325,838.70
NEWMONT GOLDCORP CORP	39,642	41.29	1,636,818.18
NUCOR CORP	13,279	56.47	749,865.13
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,220	111.04	579,628.80
PPG INDUSTRIES INC	11,414	133.01	1,518,176.14
RPM INTERNATIONAL INC	6,400	75.10	480,640.00
SEALED AIR CORP	7,116	38.01	270,479.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,167	572.23	2,384,482.41
STEEL DYNAMICS INC	9,050	34.68	313,854.00
VULCAN MATERIALS CO	6,393	143.00	914,199.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,320	70.50	163,560.00
WESTROCK CO	13,449	40.89	549,929.61
3M CO	28,356	168.79	4,786,209.24
ACUITY BRANDS INC	1,510	130.80	197,508.00
AERCAP HOLDINGS NV	6,440	61.91	398,700.40
ALLEGION PLC	4,710	123.01	579,377.10
AMETEK INC	11,333	98.56	1,116,980.48
ARCONIC INC	20,893	31.65	661,263.45
BOEING CO/THE	26,262	341.67	8,972,937.54
CATERPILLAR INC	27,766	145.53	4,040,785.98
CUMMINS INC	7,375	182.48	1,345,790.00
DEERE & CO	14,840	172.50	2,559,900.00
DOVER CORP	6,500	113.65	738,725.00
EATON CORP PLC	21,276	93.60	1,991,433.60
EMERSON ELECTRIC CO	29,990	75.98	2,278,640.20
FASTENAL CO	28,436	37.03	1,052,985.08
FLOWSERVE CORP	5,495	48.41	266,012.95
FORTIVE CORP	13,514	75.19	1,016,117.66
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,000	65.09	455,630.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,392	179.03	2,218,539.76
GENERAL ELECTRIC CO	430,213	11.34	4,878,615.42

HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	40.22	359,969.00	
HEICO CORP	2,000	126.18	252,360.00	
HEICO CORP-CLASS A	4,070	97.00	394,790.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	35,436	176.98	6,271,463.28	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,230	251.24	560,265.20	
IDEX CORP	3,580	167.37	599,184.60	
ILLINOIS TOOL WORKS	15,995	177.27	2,835,433.65	
INGERSOLL-RAND PLC	12,616	133.81	1,688,146.96	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,090	90.03	548,282.70	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,370	54.00	613,980.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	10,600	31.08	329,448.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	40,824	40.44	1,650,922.56	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,035	200.18	2,208,986.30	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,730	255.39	441,824.70	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,381	386.47	4,784,885.07	
MASCO CORP	15,489	47.01	728,137.89	
MIDDLEBY CORP	3,030	108.26	328,027.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,924	344.65	2,731,006.60	
OWENS CORNING	4,700	64.58	303,526.00	
PACCAR INC	17,054	82.01	1,398,598.54	
PARKER HANNIFIN CORP	5,820	206.49	1,201,771.80	
PENTAIR PLC	8,438	45.85	386,882.30	
RAYTHEON COMPANY	13,752	217.40	2,989,684.80	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,333	203.47	1,085,105.51	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,040	350.50	1,766,520.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,030	51.98	365,419.40	
SMITH (A.O.) CORP	7,970	46.52	370,764.40	
SNAP-ON INC	2,170	170.38	369,724.60	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5,040	80.14	403,905.60	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,056	164.54	1,160,994.24	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	347.71	608,492.50	
TEXTRON INC	11,916	43.45	517,750.20	
TRANSDIGM GROUP INC	2,310	575.81	1,330,121.10	
UNITED RENTALS INC	3,670	162.74	597,255.80	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	40,318	149.07	6,010,204.26	

WABCO HOLDINGS INC	2,630	135.34	355,944.20
WABTEC CORP	8,250	75.16	620,070.00
WW GRAINGER INC	2,277	332.31	756,669.87
XYLEM INC	8,868	77.72	689,220.96
CINTAS CORP	4,387	261.81	1,148,560.47
COPART INC	9,920	88.62	879,110.40
COSTAR GROUP INC	1,825	580.56	1,059,522.00
EQUIFAX INC	5,844	138.70	810,562.80
IHS MARKIT LTD	18,113	74.60	1,351,229.80
MANPOWERGROUP INC	2,437	96.67	235,584.79
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,295	19.95	305,135.25
REPUBLIC SERVICES INC	10,350	89.15	922,702.50
ROBERT HALF INTL INC	4,995	61.64	307,891.80
ROLLINS INC	8,030	32.95	264,588.50
TRANSUNION	8,850	85.40	755,790.00
VERISK ANALYTICS INC	7,610	149.19	1,135,335.90
WASTE CONNECTIONS INC	12,896	89.67	1,156,384.32
WASTE MANAGEMENT INC	21,624	112.02	2,422,320.48
AMERCO	375	359.89	134,958.75
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6,490	27.48	178,345.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,670	76.55	510,588.50
CSX CORP	37,513	72.78	2,730,196.14
DELTA AIR LINES INC	8,455	56.73	479,652.15
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,947	76.15	605,164.05
FEDEX CORP	11,838	165.67	1,961,201.46
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	113.00	508,500.00
KANSAS CITY SOUTHERN	5,060	151.44	766,286.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,140	37.40	267,036.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,650	190.07	2,404,385.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,940	186.41	548,045.40
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,860	54.15	317,319.00
UBER TECHNOLOGIES INC	7,540	28.49	214,814.60
UNION PACIFIC CORP	34,706	177.03	6,144,003.18
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,925	87.58	256,171.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	34,447	118.62	4,086,103.14

XPO LOGISTICS INC	3,850	83.31	320,743.50
APTIV PLC	13,350	93.55	1,248,892.50
AUTOLIV INC	4,250	84.62	359,635.00
BORGWARNER INC	9,890	43.80	433,182.00
FORD MOTOR COMPANY	196,405	9.23	1,812,818.15
GENERAL MOTORS CORP	64,135	35.65	2,286,412.75
HARLEY-DAVIDSON INC	6,229	37.35	232,653.15
LEAR CORP	2,710	129.35	350,538.50
TESLA INC	6,670	358.39	2,390,461.30
CAPRI HOLDINGS LTD	5,890	38.78	228,414.20
DR HORTON INC	17,266	54.81	946,349.46
GARMIN LTD	7,065	97.43	688,342.95
HANESBRANDS INC	20,690	14.40	297,936.00
HASBRO INC	6,698	103.92	696,056.16
LEGGETT & PLATT INC	7,658	50.72	388,413.76
LENNAR CORP-CL A	13,220	58.30	770,726.00
LULULEMON ATHLETICA INC	5,190	223.55	1,160,224.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,488	137.94	343,194.72
NEWELL BRANDS INC	19,156	19.21	367,986.76
NIKE INC -CL B	61,648	97.77	6,027,324.96
NVR INC	180	3,798.35	683,703.00
POLARIS INC	3,190	98.86	315,363.40
PULTE GROUP INC	11,880	40.38	479,714.40
PVH CORP	3,580	104.41	373,787.80
RALPH LAUREN CORP	2,895	116.92	338,483.40
TAPESTRY INC	14,446	25.94	374,729.24
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,060	19.53	196,471.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	9,412	17.78	167,345.36
VF CORP	17,120	93.15	1,594,728.00
WHIRLPOOL CORP	3,114	148.42	462,179.88
ARAMARK	12,490	43.78	546,812.20
CARNIVAL CORP	19,417	47.45	921,336.65
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,275	815.32	1,039,533.00
DARDEN RESTAURANTS INC	6,553	115.58	757,395.74
DOMINO'S PIZZA INC	2,000	294.93	589,860.00

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,070	107.20	1,508,304.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,880	69.04	1,234,435.20	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,173	146.16	2,071,525.68	
MCDONALD'S CORP	37,301	197.12	7,352,773.12	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,700	23.58	205,146.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,750	32.75	745,062.50	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,670	55.78	595,172.60	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,988	125.64	1,003,612.32	
STARBUCKS CORP	58,974	88.67	5,229,224.58	
VAIL RESORTS INC	2,220	242.89	539,215.80	
WYNN RESORTS LTD	4,590	129.78	595,690.20	
YUM! BRANDS INC	15,214	100.11	1,523,073.54	
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,550	58.65	2,202,307.50	
ALPHABET INC-CL A	14,720	1,346.87	19,825,926.40	
ALPHABET INC-CL C	15,362	1,347.83	20,705,364.46	
ALTICE USA INC- A	8,400	26.58	223,272.00	
CHARTER COMMUNICATION-A	7,651	475.27	3,636,290.77	
COMCAST CORP-CLASS A	223,094	43.58	9,722,436.52	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,520	32.34	307,876.80	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	17,930	30.06	538,975.80	
DISH NETWORK CORP-A	12,729	34.12	434,377.12	
ELECTRONIC ARTS INC	14,054	104.55	1,469,345.70	
FACEBOOK INC-CLASS A	118,290	194.11	22,961,271.90	
FOX CORP - CLASS A	17,524	36.77	644,357.48	
FOX CORP- CLASS B	7,746	35.86	277,771.56	
IAC/INTERACTIVECORP	3,470	224.64	779,500.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17,186	23.03	395,793.58	
LIBERTY BROADBAND-C	5,240	121.89	638,703.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	22.03	167,097.55	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,871	21.05	439,334.55	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,160	43.85	445,516.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	8,020	47.11	377,822.20	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,315	47.59	157,760.85	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,820	64.34	503,138.80	
MATCH GROUP INC	3,070	71.91	220,763.70	

NETFLIX INC	21,560	298.50	6,435,660.00
NEWS CORP - CLASS A	18,680	13.59	253,861.20
OMNICOM GROUP	10,017	82.04	821,794.68
PINTEREST INC- CLASS A	8,700	17.45	151,815.00
ROKU INC	4,330	132.49	573,681.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,730	6.92	468,691.60
SNAP INC - A	33,980	15.09	512,758.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,240	121.82	638,336.80
THE WALT DISNEY CO.	88,572	146.38	12,965,169.36
TRIPADVISOR INC	5,300	29.25	155,025.00
TWITTER INC	33,560	30.39	1,019,888.40
VIACOMCBS INC - CLASS B	27,993	38.64	1,081,649.52
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	42.27	286,167.90
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,368	155.21	522,747.28
AMAZON.COM INC	20,655	1,760.94	36,372,215.70
AUTOZONE INC	1,182	1,235.32	1,460,148.24
BEST BUY CO INC	11,264	84.79	955,074.56
BOOKING HOLDINGS INC	2,103	1,973.60	4,150,480.80
BURLINGTON STORES INC	3,090	225.90	698,031.00
CARMAX INC	7,439	97.88	728,129.32
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	12,850	154.63	1,986,995.50
DOLLAR TREE INC	11,346	93.59	1,061,872.14
EBAY INC	40,437	35.48	1,434,704.76
EXPEDIA INC	6,602	112.76	744,441.52
GAP INC/THE	8,676	16.69	144,802.44
GENUINE PARTS CO	7,321	105.16	769,876.36
GRUBHUB INC	5,500	43.54	239,470.00
HOME DEPOT INC	53,850	214.08	11,528,208.00
KOHL'S CORP	7,462	48.28	360,265.36
LKQ CORP	16,840	36.11	608,092.40
LOWE'S COS INC	38,262	118.50	4,534,047.00
MERCADOLIBRE INC	2,160	567.67	1,226,167.20
NORDSTROM INC	6,650	38.38	255,227.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,835	441.35	1,692,577.25
ROSS STORES INC	18,332	115.49	2,117,162.68

TARGET CORP	25,230	127.22	3,209,760.60
TIFFANY & CO	5,820	133.70	778,134.00
TJX COMPANIES INC	59,676	60.37	3,602,640.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,990	94.93	568,630.70
ULTA BEAUTY INC	2,610	253.50	661,635.00
WAYFAIR INC- CLASS A	2,530	89.93	227,522.90
COSTCO WHOLESALE CORP	21,659	291.87	6,321,612.33
KROGER CO	36,870	28.09	1,035,678.30
SYSCO CORP	24,636	83.54	2,058,091.44
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,992	57.88	2,141,096.96
WALMART INC	70,242	120.29	8,449,410.18
ALTRIA GROUP INC	92,098	50.16	4,619,635.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,953	45.20	1,173,075.60
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,940	63.85	1,017,769.00
BUNGE LTD	6,327	55.77	352,856.79
CAMPBELL SOUP CO	8,995	47.86	430,500.70
COCA-COLA CO/THE	199,292	54.42	10,845,470.64
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11,720	50.04	586,468.80
CONAGRA BRANDS INC	22,860	28.38	648,766.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,050	182.06	1,465,583.00
GENERAL MILLS INC	30,509	51.60	1,574,264.40
HERSHEY CO/THE	7,275	147.15	1,070,516.25
HORMEL FOODS CORP	14,400	44.90	646,560.00
INGREDION INC	3,120	87.69	273,592.80
JM SMUCKER CO/THE	5,690	101.51	577,591.90
KELLOGG CO	11,938	66.25	790,892.50
KRAFT HEINZ CO/THE	34,181	31.60	1,080,119.60
LAMB WESTON HOLDING INC	7,620	84.10	640,842.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,155	167.50	1,030,962.50
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,870	50.81	450,684.70
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	71,175	53.24	3,789,357.00
MONSTER BEVERAGE CORP	19,800	62.21	1,231,758.00
PEPSICO INC	68,601	137.94	9,462,821.94
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	76,568	84.67	6,483,012.56
TYSON FOODS INC-CL A	13,586	87.97	1,195,160.42

CHURCH & DWIGHT CO INC	11,360	69.99	795,086.40
CLOROX COMPANY	6,046	151.70	917,178.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	40,570	68.69	2,786,753.30
COTY INC-CL A	16,590	11.08	183,817.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,060	203.21	2,247,502.60
KIMBERLY-CLARK CORP	16,893	135.94	2,296,434.42
PROCTER & GAMBLE CO	122,839	125.47	15,412,609.33
ABBOTT LABORATORIES	86,996	86.35	7,512,104.60
ABIOMED INC	2,390	181.85	434,621.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,500	266.06	931,210.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,464	84.85	633,320.40
ANTHEM INC	12,631	284.12	3,588,719.72
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,429	83.96	2,051,058.84
BECTON DICKINSON AND CO	13,337	268.72	3,583,918.64
BOSTON SCIENTIFIC CORP	68,838	45.09	3,103,905.42
CARDINAL HEALTH INC	14,485	53.66	777,265.10
CENTENE CORP	19,720	57.71	1,138,041.20
CERNER CORP	15,440	72.23	1,115,231.20
CIGNA CORP	18,640	189.87	3,539,176.80
COOPER COS INC/THE	2,200	316.92	697,224.00
CVS HEALTH CORP	64,108	73.59	4,717,707.72
DANAHER CORP	31,909	148.52	4,739,124.68
DAVITA INC	5,038	72.71	366,312.98
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	56.38	648,482.76
DEXCOM INC	4,250	203.83	866,277.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,420	232.64	2,424,108.80
HCA HEALTHCARE INC	13,405	142.86	1,915,038.30
HENRY SCHEIN INC	8,370	68.49	573,261.30
HOLOGIC INC	12,828	53.15	681,808.20
HUMANA INC	6,585	353.13	2,325,361.05
IDEXX LABORATORIES INC	3,840	252.90	971,136.00
INSULET CORP	2,990	175.65	525,193.50
INTUITIVE SURGICAL INC	5,695	579.65	3,301,106.75
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,735	166.59	788,803.65
MCKESSON CORP	9,024	140.60	1,268,774.40

MEDTRONIC PLC	66,048	113.52	7,497,768.96
QUEST DIAGNOSTICS	6,386	105.20	671,807.20
RESMED INC	7,050	153.63	1,083,091.50
STERIS PLC	4,280	151.93	650,260.40
STRYKER CORP	16,633	202.93	3,375,334.69
TELEFLEX INC	2,300	359.88	827,724.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	46,600	285.48	13,303,368.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,440	144.34	640,869.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,684	141.53	662,926.52
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,070	146.10	886,827.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,520	312.49	787,474.80
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,630	146.37	531,323.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,932	148.07	1,470,631.24
ABBVIE INC	72,776	87.84	6,392,643.84
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,880	83.71	1,245,604.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,800	110.42	1,192,536.00
ALLERGAN PLC	16,215	188.34	3,053,933.10
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,420	117.74	638,150.80
AMGEN INC	29,501	236.74	6,984,066.74
BEIGENE LTD-ADR	1,840	176.03	323,895.20
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,150	354.62	407,813.00
BIOGEN INC	9,123	296.83	2,707,980.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,430	80.17	675,833.10
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	115,255	63.82	7,355,574.10
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	19,906	27.78	552,988.68
ELI LILLY & CO	42,764	121.53	5,197,108.92
EXACT SCIENCES CORP	7,120	87.20	620,864.00
GILEAD SCIENCES INC	62,474	65.77	4,108,914.98
ILLUMINA INC	7,350	324.72	2,386,692.00
INCYTE CORP	9,490	91.51	868,429.90
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,140	63.05	387,127.00
IQVIA HOLDINGS INC	8,253	144.85	1,195,447.05
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,330	147.88	344,560.40
JOHNSON & JOHNSON	129,711	141.38	18,338,541.18
MERCK & CO. INC.	125,673	89.19	11,208,774.87

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,125	769.70	865,912.50
MYLAN NV	26,285	19.14	503,094.90
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,250	110.59	470,007.50
PERKINELMER INC	4,880	94.39	460,623.20
PERRIGO CO PLC	7,139	53.93	385,006.27
PFIZER INC	272,060	38.33	10,428,059.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,850	376.42	1,449,217.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,680	132.05	485,944.00
SEATTLE GENETICS INC	5,740	113.87	653,613.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	54,870	9.64	528,946.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,744	320.50	6,327,952.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,710	218.98	2,783,235.80
WATERS CORP	3,666	234.11	858,247.26
ZOETIS INC	23,610	124.45	2,938,264.50
BANK OF AMERICA CORP	434,269	34.44	14,956,224.36
CITIGROUP INC	111,277	76.39	8,500,450.03
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,180	40.12	809,621.60
COMERICA INC	7,850	71.93	564,650.50
EAST WEST BANCORP INC	7,460	47.77	356,364.20
FIFTH THIRD BANCORP	33,759	30.97	1,045,516.23
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,600	114.88	987,968.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	54,250	15.35	832,737.50
JPMORGAN CHASE & CO	156,850	136.81	21,458,648.50
KEYCORP	47,768	20.06	958,226.08
M & T BANK CORP	6,383	170.10	1,085,748.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	27,220	16.65	453,213.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,580	158.64	3,423,451.20
REGIONS FINANCIAL CORP	50,584	17.17	868,527.28
SIGNATURE BANK	2,310	134.99	311,826.90
SVB FINANCIAL GROUP	2,610	249.31	650,699.10
TRUIST FINANCIAL CORP	65,430	56.02	3,665,388.60
US BANCORP	73,691	60.27	4,441,356.57
WELLS FARGO & CO	205,590	53.79	11,058,686.10
ZIONS BANCORP NA	9,240	51.15	472,626.00
ALLY FINANCIAL INC	20,430	31.46	642,727.80

AMERICAN EXPRESS CO	34,794	124.72	4,339,507.68
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,910	167.44	989,570.40
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,170	24.64	570,908.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	42,542	50.22	2,136,459.24
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,750	225.37	14,592,707.50
BLACKROCK INC	5,730	498.61	2,857,035.30
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	31,800	53.63	1,705,434.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,905	104.37	2,494,964.85
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,210	115.50	601,755.00
CME GROUP INC	17,600	204.59	3,600,784.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,510	86.68	1,344,406.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,630	45.15	479,944.50
EATON VANCE CORP	5,440	47.31	257,366.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	271.28	474,740.00
FRANKLIN RESOURCES INC	15,725	25.99	408,692.75
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,978	225.00	3,595,050.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,680	91.91	2,544,068.80
INVESCO LTD	15,877	17.62	279,752.74
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	11,015	21.49	236,712.35
KKR & CO INC -A	22,350	29.15	651,502.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,690	373.89	631,874.10
MOODY'S CORP	8,637	235.08	2,030,385.96
MORGAN STANLEY	61,255	50.24	3,077,451.20
MSCI INC	3,820	260.09	993,543.80
NASDAQ INC	5,765	104.48	602,327.20
NORTHERN TRUST CORP	9,520	108.04	1,028,540.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,000	90.88	545,280.00
S&P GLOBAL INC	12,162	271.20	3,298,334.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	58,154	49.95	2,904,792.30
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,385	65.80	354,333.00
STATE STREET CORP	18,197	79.13	1,439,928.61
SYNCHRONY FINANCIAL	28,360	37.69	1,068,888.40
T ROWE PRICE GROUP INC	12,365	123.22	1,523,615.30
TD AMERITRADE HOLDING CORP	14,090	52.06	733,525.40
VOYA FINANCIAL INC	6,040	57.92	349,836.80

AFLAC INC	35,954	53.17	1,911,674.18
ALLEGHANY CORP	630	794.68	500,648.40
ALLSTATE CORP	16,543	109.70	1,814,767.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,240	109.82	355,816.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	42,465	51.60	2,191,194.00
AON PLC	11,392	206.15	2,348,460.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,805	41.75	910,358.75
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,000	94.45	944,500.00
ASSURANT INC	3,300	130.15	429,495.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,320	45.32	286,422.40
BROWN & BROWN INC	11,750	38.86	456,605.00
CHUBB LTD	22,435	154.64	3,469,348.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,310	105.45	770,839.50
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	168.80	200,872.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,314	274.67	635,586.38
FNF GROUP	12,811	47.06	602,885.66
GLOBE LIFE INC	5,426	105.62	573,094.12
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	17,382	61.07	1,061,518.74
LINCOLN NATIONAL CORP	10,013	59.73	598,076.49
LOEWS CORP	13,585	50.61	687,536.85
MARKEL CORP	635	1,137.33	722,204.55
MARSH & MCLENNAN COS	25,593	110.54	2,829,050.22
METLIFE INC	38,345	50.38	1,931,821.10
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,440	54.29	729,657.60
PROGRESSIVE CORP	28,580	72.17	2,062,618.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,632	94.14	1,848,156.48
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,610	164.68	594,494.80
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,887	194.80	367,587.60
TRAVELERS COS INC/THE	12,714	135.66	1,724,781.24
UNUM GROUP	8,138	30.34	246,906.92
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,478	200.04	1,295,859.12
WR BERKLEY CORP	7,244	69.56	503,892.64
CBRE GROUP INC - A	14,560	58.26	848,265.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	56,500	5.54	313,010.00
JONES LANG LASALLE INC	2,120	170.10	360,612.00

ACCENTURE PLC-CL A	31,288	206.66	6,465,978.08
ADOBE INC	23,899	317.94	7,598,448.06
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,580	84.69	726,640.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,040	110.05	224,502.00
ANSYS INC	4,070	253.93	1,033,495.10
AUTODESK INC	11,140	179.41	1,998,627.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21,421	168.26	3,604,297.46
BLACK KNIGHT INC	7,350	63.14	464,079.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,030	70.56	496,036.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	6,100	119.72	730,292.00
CADENCE DESIGN SYS INC	13,530	67.92	918,957.60
CDK GLOBAL INC	5,890	54.96	323,714.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,460	113.31	618,672.60
CITRIX SYSTEMS INC	6,758	110.35	745,745.30
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,358	61.64	1,624,707.12
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,090	126.35	264,071.50
DOCUSIGN INC	4,660	73.72	343,535.20
DROPBOX INC-CLASS A	10,440	16.80	175,392.00
DXC TECHNOLOGY CO	14,753	37.52	553,532.56
EPAM SYSTEMS INC	3,010	210.02	632,160.20
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	30,248	138.19	4,179,971.12
FISERV INC	28,494	116.75	3,326,674.50
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,120	304.72	1,255,446.40
FORTINET INC	7,370	105.64	778,566.80
GARTNER INC	4,890	157.67	771,006.30
GLOBAL PAYMENTS INC	14,959	178.93	2,676,613.87
GODADDY INC-CLASS A	8,370	67.25	562,882.50
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,100	104.73	429,393.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,612	134.21	5,853,166.52
INTUIT INC	12,846	259.64	3,335,335.44
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,950	145.86	576,147.00
LEIDOS HOLDINGS INC	7,300	91.84	670,432.00
MASTERCARD INC	44,290	296.09	13,113,826.10
MICROSOFT CORP	356,064	154.53	55,022,569.92
MONGODB INC	2,320	128.41	297,911.20

NORTONLIFELOCK INC	27,555	26.00	716,430.00
OKTA INC	5,090	116.69	593,952.10
ORACLE CORP	114,683	54.51	6,251,370.33
PALO ALTO NETWORKS INC	4,550	226.99	1,032,804.50
PAYCHEX INC	15,492	85.08	1,318,059.36
PAYCOM SOFTWARE INC	2,590	256.99	665,604.10
PAYPAL HOLDINGS INC	55,067	107.65	5,927,962.55
PTC INC	5,940	74.63	443,302.20
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,550	163.75	581,312.50
SABRE CORP	16,350	22.52	368,283.75
SALESFORCE.COM INC	41,005	161.13	6,607,135.65
SERVICENOW INC	9,010	272.98	2,459,549.80
SPLUNK INC	7,220	143.51	1,036,142.20
SQUARE INC - A	17,410	64.80	1,128,168.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,590	59.05	684,389.50
SYNOPSYS INC	7,257	136.70	992,031.90
TWILIO INC - A	5,300	97.98	519,294.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,880	284.70	535,236.00
VERISIGN INC	4,810	191.49	921,066.90
VISA INC-CLASS A SHARES	84,782	185.14	15,696,539.48
VMWARE INC	3,795	151.30	574,183.50
WESTERN UNION CO	19,111	27.23	520,392.53
WIX.COM LTD	1,980	119.08	235,778.40
WORKDAY INC-CLASS A	7,560	159.46	1,205,517.60
AMPHENOL CORP-CL A	14,620	107.14	1,566,386.80
APPLE INC	222,032	275.15	61,092,104.80
ARISTA NETWORKS INC	2,530	192.92	488,087.60
ARROW ELECTRONICS INC	3,320	84.45	280,374.00
CDW CORP/DE	7,170	137.77	987,810.90
CISCO SYSTEMS INC	210,600	45.30	9,540,180.00
COGNEX CORP	8,270	54.53	450,963.10
CORNING INC	36,988	28.74	1,063,035.12
DELL TECHNOLOGIES -C	7,702	49.35	380,093.70
F5 NETWORKS INC	2,825	139.25	393,381.25
FLEX LTD	28,486	12.00	341,832.00

FLIR SYSTEMS INC	5,685	53.17	302,271.45
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	60,245	16.03	965,727.35
HP INC	72,985	20.35	1,485,244.75
IPG PHOTONICS CORP	1,840	144.62	266,100.80
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	24.13	445,270.89
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,050	107.81	975,680.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,935	160.50	1,273,567.50
NETAPP INC	11,346	63.24	717,521.04
SEAGATE TECHNOLOGY	11,144	58.76	654,821.44
TE CONNECTIVITY LTD	17,565	94.00	1,651,110.00
TRIMBLE INC	13,610	40.35	549,163.50
WESTERN DIGITAL CORP	15,448	54.30	838,826.40
XEROX HOLDINGS CORP	11,298	36.84	416,218.32
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,600	257.80	670,280.00
AT&T INC	358,987	38.26	13,734,842.62
CENTURYLINK INC	47,846	13.60	650,705.60
SPRINT CORP	33,770	5.21	175,941.70
T-MOBILE US INC	15,642	75.47	1,180,501.74
VERIZON COMMUNICATIONS INC	203,047	60.81	12,347,288.07
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	10,290	34.25	352,432.50
AES CORP	34,668	18.92	655,918.56
ALLIANT ENERGY CORP	12,110	52.92	640,921.75
AMEREN CORPORATION	13,372	75.02	1,003,167.44
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,038	92.05	2,212,697.90
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,305	119.20	989,956.00
AQUA AMERICA INC	10,640	45.02	479,012.80
ATMOS ENERGY CORP	5,480	107.05	586,634.00
CENTERPOINT ENERGY INC	25,212	25.94	653,999.28
CMS ENERGY CORP	12,590	60.99	767,864.10
CONSOLIDATED EDISON INC	17,116	87.83	1,503,298.28
DOMINION ENERGY INC	40,591	80.88	3,283,000.08
DTE ENERGY COMPANY	8,778	124.86	1,096,021.08
DUKE ENERGY CORP	35,986	90.10	3,242,338.60
EDISON INTERNATIONAL	17,259	72.69	1,254,556.71
ENTERGY CORP	9,577	118.30	1,132,959.10

EVERGY INC	12,630	62.76	792,658.80
EVERSOURCE ENERGY	15,430	81.34	1,255,076.20
EXELON CORP	46,646	43.82	2,044,027.72
FIRSTENERGY CORP	25,835	47.95	1,238,788.25
NEXTERA ENERGY INC	23,605	236.95	5,593,204.75
NISOURCE INC	17,890	26.88	480,883.20
NRG ENERGY INC	11,980	39.37	471,652.60
OGE ENERGY CORP	7,900	43.31	342,149.00
PINNACLE WEST CAPITAL	5,629	86.14	484,882.06
PPL CORP	34,628	35.64	1,234,141.92
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,048	58.55	1,408,010.40
SEMPRA ENERGY	13,427	148.78	1,997,669.06
SOUTHERN CO	51,635	60.76	3,137,342.60
UGI CORP	9,220	43.96	405,311.20
VISTRA ENERGY CORP	20,980	23.71	497,435.80
WEC ENERGY GROUP INC	15,220	89.18	1,357,319.60
XCEL ENERGY INC	24,624	62.26	1,533,090.24
ADVANCED MICRO DEVICES	49,490	41.15	2,036,513.50
ANALOG DEVICES INC	17,590	118.77	2,089,164.30
APPLIED MATERIALS INC	46,233	59.87	2,767,969.71
BROADCOM INC	19,610	315.42	6,185,386.20
INTEL CORP	217,842	57.79	12,589,089.18
KLA CORP	7,269	171.24	1,244,743.56
LAM RESEARCH CORP	7,317	281.95	2,063,028.15
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	33,904	25.72	872,010.88
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,590	59.59	809,828.10
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,844	102.09	1,107,063.96
MICRON TECHNOLOGY INC	54,367	51.20	2,783,590.40
NVIDIA CORP	28,545	223.99	6,393,794.55
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,107	123.88	1,747,575.16
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,620	23.13	407,550.60
QORVO INC	6,090	113.41	690,666.90
QUALCOMM INC	59,922	87.83	5,262,949.26
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,620	111.86	964,233.20
TERADYNE INC	8,400	66.69	560,196.00

	TEXAS INSTRUMENTS INC	46,002	126.64	5,825,693.28	
	XILINX INC	11,855	96.23	1,140,806.65	
米ドル小計		14,722,750		1,324,770,302.35	(144,969,614,186)
加ドル	CAMECO CORP	19,892	12.03	239,300.76	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	57,474	40.08	2,303,557.92	
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	12.76	704,135.08	
	ENBRIDGE INC	99,877	50.57	5,050,779.89	
	ENCANA CORP	75,808	5.56	421,492.48	
	HUSKY ENERGY INC	17,673	9.93	175,492.89	
	IMPERIAL OIL LTD	12,902	33.36	430,410.72	
	INTER PIPELINE LTD	24,540	22.46	551,168.40	
	KEYERA CORP	12,200	33.61	410,042.00	
	PARKLAND FUEL CORP	7,370	46.85	345,284.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,042	47.12	1,132,859.04	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	11,690	14.65	171,258.50	
	SUNCOR ENERGY INC	76,229	41.90	3,193,995.10	
	TC ENERGY CORP	47,183	67.22	3,171,641.26	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,805	80.64	951,955.20	
	BARRICK GOLD CORP	87,034	23.24	2,022,670.16	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	57.08	456,640.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,400	13.56	452,904.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,525	129.90	1,107,397.50	
	KINROSS GOLD CORP	57,165	5.71	326,412.15	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,760	56.64	496,166.40	
	LUNDIN MINING CORP	35,450	7.64	270,838.00	
	METHANEX CORP	2,760	50.33	138,910.80	
	NUTRIEN LTD	26,108	62.81	1,639,843.48	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	22.21	563,578.75	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,460	54.05	132,963.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,735	37.21	771,549.35	
	BOMBARDIER INC 'B'	91,096	1.92	174,904.32	
	CAE INC	14,195	34.25	486,178.75	
	WSP GLOBAL INC	5,830	88.03	513,214.90	
	THOMSON REUTERS CORP	9,046	95.23	861,450.58	

AIR CANADA	7,190	49.50	355,905.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	35,478	118.72	4,211,948.16
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,715	331.38	2,225,216.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,538	72.41	980,286.58
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	37.71	375,214.50
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,338	87.84	1,083,769.92
STARS GROUP INC/THE	12,310	32.76	403,275.60
QUEBECOR INC -CL B	10,270	33.08	339,731.60
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,045	26.65	560,849.25
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,560	142.96	365,977.60
DOLLARAMA INC	14,590	44.91	655,236.90
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	42,470	42.68	1,812,619.60
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	30.48	252,679.20
LOBLAW COMPANIES LTD	8,629	69.25	597,558.25
METRO INC	12,760	55.42	707,159.20
WESTON (GEORGE) LTD	2,998	105.54	316,408.92
SAPUTO INC	10,250	39.98	409,795.00
AURORA CANNABIS INC	38,070	3.47	132,102.90
BAUSCH HEALTH COS INC	13,194	40.89	539,502.66
CANOPY GROWTH CORP	8,750	27.28	238,700.00
CRONOS GROUP INC	7,240	9.61	69,576.40
BANK OF MONTREAL	31,971	101.47	3,244,097.37
BANK OF NOVA SCOTIA	60,269	73.82	4,449,057.58
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,765	109.43	2,491,173.95
NATIONAL BANK OF CANADA	16,230	72.20	1,171,806.00
ROYAL BANK OF CANADA	70,159	104.84	7,355,469.56
TORONTO-DOMINION BANK	89,220	74.31	6,629,938.20
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	44,173	75.70	3,343,896.10
CI FINANCIAL CORP	9,570	21.61	206,807.70
IGM FINANCIAL INC	3,295	38.21	125,901.95
ONEX CORPORATION	3,805	80.22	305,237.10
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,460	593.65	866,729.00
GREAT-WEST LIFECO INC	14,894	33.62	500,736.28
IA FINANCIAL CORP INC	6,525	68.93	449,768.25
INTACT FINANCIAL CORP	6,255	136.79	855,621.45

	MANULIFE FINANCIAL CORP	98,551	25.40	2,503,195.40	
	POWER CORP OF CANADA	12,630	34.42	434,724.60	
	POWER FINANCIAL CORP	15,495	36.02	558,129.90	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	28,694	58.76	1,686,059.44	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	9,730	20.99	204,232.70	
	BLACKBERRY LTD	27,808	7.47	207,725.76	
	CGI INC	12,830	109.44	1,404,115.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,015	1,266.87	1,285,873.05	
	OPEN TEXT CORP	13,510	56.91	768,854.10	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	4,930	508.43	2,506,559.90	
	BCE INC	6,980	62.69	437,576.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	17,925	63.91	1,145,586.75	
	TELUS CORP	10,666	49.93	532,553.38	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	18.59	503,417.20	
	ALTAGAS LTD	11,800	18.78	221,604.00	
	ATCO LTD -CLASS I	3,260	50.37	164,206.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,320	39.77	291,116.40	
	EMERA INC	12,030	54.91	660,567.30	
	FORTIS INC	19,925	53.84	1,072,762.00	
	HYDRO ONE LTD	13,000	25.73	334,490.00	
加ドル小計		2,024,212		95,222,099.79	(7,907,243,166)
ユーロ	ENI SPA	125,826	13.60	1,711,736.90	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,185	14.61	338,848.77	
	NESTE OYJ	19,170	28.16	539,827.20	
	OMV AG	6,310	50.06	315,878.60	
	REPSOL SA	68,969	14.32	987,980.92	
	TENARIS SA	19,815	10.18	201,815.77	
	TOTAL SA	118,207	47.82	5,652,658.74	
	VOPAK	3,530	47.33	167,074.90	
	AIR LIQUIDE SA	23,310	123.75	2,884,612.50	
	AKZO NOBEL	10,907	90.45	986,538.15	
	ARCELORMITTAL	35,962	16.27	585,317.51	
	ARKEMA	3,145	94.84	298,271.80	
	BASF SE	45,355	68.38	3,101,374.90	

COVESTRO AG	9,190	42.82	393,515.80
CRH PLC	38,560	35.72	1,377,363.20
EVONIK INDUSTRIES AG	11,440	26.75	306,020.00
FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,920	42.92	125,326.40
HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	67.54	509,589.30
KONINKLIJKE DSM NV	8,762	114.85	1,006,315.70
LANXESS AG	3,295	61.02	201,060.90
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,140	33.02	301,802.80
SOLVAY SA	3,701	104.70	387,494.70
STORA ENSO OYJ-R SHS	27,755	12.28	340,970.17
SYMRISE AG	6,470	88.12	570,136.40
THYSSENKRUPP AG	19,305	11.64	224,806.72
UMICORE	8,650	42.58	368,317.00
UPM-KYMMENE OYJ	25,138	30.96	778,272.48
VOESTALPINE AG	7,119	25.14	178,971.66
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,456	35.34	440,195.04
AIRBUS GROUP SE	28,658	125.90	3,608,042.20
ALSTOM	9,320	41.38	385,661.60
ANDRITZ AG	3,810	38.38	146,227.80
BOUYGUES SA	8,880	38.22	339,393.60
BRENTAG AG	6,625	49.51	328,003.75
CNH INDUSTRIAL NV	47,220	9.79	462,378.24
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	24,196	38.07	921,141.72
DASSAULT AVIATION SA	135	1,112.00	150,120.00
EIFFAGE	3,680	100.90	371,312.00
FERROVIAL SA	23,945	27.18	650,825.10
GEA GROUP AG	6,580	29.54	194,373.20
HOCHTIEF AG	1,490	115.60	172,244.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,880	53.40	420,792.00
KION GROUP AG	3,820	64.48	246,313.60
KNORR-BREMSE AG	2,970	85.00	252,450.00
KONE OYJ-B	16,024	57.26	917,534.24
LEGRAND SA	12,518	72.48	907,304.64
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	22,040	10.53	232,191.40
METSO OYJ	4,110	35.28	145,000.80

MTU AERO ENGINES AG	2,430	247.30	600,939.00
PRYSMIAN SPA	10,595	21.17	224,296.15
SAFRAN SA	16,220	144.75	2,347,845.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,028	92.50	2,592,590.00
SIEMENS AG-REG	37,866	117.78	4,459,857.48
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	15.21	178,928.40
THALES SA	4,675	86.26	403,265.50
VINCI SA	25,010	98.26	2,457,482.60
WARTSILA OYJ ABP	21,180	9.63	203,963.40
BUREAU VERITAS SA	14,440	23.11	333,708.40
EDENRED	13,336	44.31	590,918.16
RANDSTAD NV	5,235	54.56	285,621.60
TELEPERFORMANCE	2,760	210.20	580,152.00
WOLTERS KLUWER	13,377	63.14	844,623.78
ADP	1,740	177.10	308,154.00
AENA SA	3,010	174.95	526,599.50
ATLANTIA SPA	23,620	20.88	493,185.60
BOLLORE	34,310	3.93	134,906.92
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	16.79	200,532.30
DEUTSCHE POST AG-REG	50,093	34.62	1,734,219.66
FRAPORT AG	1,680	75.52	126,873.60
GETLINK	17,870	15.62	279,129.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,325	75.87	1,238,577.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	57.15	164,592.00
CONTINENTAL AG	5,225	119.14	622,506.50
DAIMLER AG	44,462	50.63	2,251,111.06
FAURECIA	4,660	50.60	235,796.00
FERRARI NV	5,664	147.50	835,440.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	52,577	13.32	700,641.10
MICHELIN (CGDE)-B	8,719	111.15	969,116.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,675	24.82	190,493.50
PEUGEOT SA	29,240	21.89	640,063.60
PIRELLI & C SPA	24,100	5.22	125,898.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	8,230	68.88	566,882.40
RENAULT SA	8,677	42.46	368,425.42

VALEO SA	9,660	33.96	328,053.60
VOLKSWAGEN AG	1,951	180.70	352,545.70
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,643	183.30	1,584,261.90
ADIDAS AG	8,901	278.60	2,479,818.60
ESSILORLUXOTTICA	14,015	140.60	1,970,509.00
HERMES INTERNATIONAL	1,507	664.40	1,001,250.80
KERING	3,627	562.00	2,038,374.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	13,664	403.80	5,517,523.20
MONCLER SPA	8,620	40.90	352,558.00
PUMA SE	3,260	66.10	215,486.00
SEB SA	1,300	135.80	176,540.00
ACCOR SA	8,656	40.79	353,078.24
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,650	106.10	387,265.00
SODEXO	4,510	104.95	473,324.50
ALTICE EUROPE NV	34,400	5.49	188,856.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	10,035	15.18	152,331.30
JC DECAUX SA	5,130	26.82	137,586.60
PUBLICIS GROUPE	10,945	40.06	438,456.70
SES	15,290	12.50	191,125.00
TELENET GROUP HOLDING NV	2,110	38.88	82,036.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,800	60.66	291,168.00
VIVENDI	40,450	25.21	1,019,744.50
DELIVERY HERO SE	5,320	61.84	328,988.80
INDITEX	52,675	30.55	1,609,221.25
PROSUS	23,170	61.78	1,431,442.60
ZALANDO SE	7,390	42.69	315,479.10
CARREFOUR SA	30,103	14.91	448,986.24
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,304	41.97	96,698.88
COLRUYT SA	2,315	47.30	109,499.50
JERONIMO MARTINS	15,165	14.86	225,427.72
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	57,818	22.44	1,297,435.92
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	7,040	13.95	98,208.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	37,471	70.21	2,630,838.91
DANONE	29,924	73.38	2,195,823.12
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	24,900	8.06	200,694.00

HEINEKEN HOLDING NV	6,325	85.25	539,206.25	
HEINEKEN NV	12,903	93.26	1,203,333.78	
KERRY GROUP PLC-A	7,310	112.90	825,299.00	
PERNOD-RICARD SA	10,366	161.00	1,668,926.00	
REMY COINTREAU	1,360	113.00	153,680.00	
BEIERSDORF AG	5,415	102.95	557,474.25	
HENKEL AG & CO KGAA	5,210	84.25	438,942.50	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	9,023	90.92	820,371.16	
L'OREAL	12,411	256.30	3,180,939.30	
UNILEVER NV	71,775	54.18	3,888,769.50	
BIOMERIEUX	1,820	79.70	145,054.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	111.30	211,470.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,583	65.96	632,094.68	
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,755	50.81	1,003,751.55	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	44,901	42.51	1,908,966.01	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,570	184.50	289,665.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,700	42.18	324,786.00	
BAYER AG-REG	45,964	71.01	3,263,903.64	
EUROFINS SCIENTIFIC	470	492.20	231,334.00	
GALAPAGOS NV	2,140	188.05	402,427.00	
GRIFOLS SA	16,550	31.24	517,022.00	
IPSEN	2,270	78.40	177,968.00	
MERCK KGAA	6,470	102.70	664,469.00	
ORION OYJ-CLASS B	5,150	39.50	203,425.00	
QIAGEN N.V.	10,894	37.00	403,078.00	
RECORDATI SPA	4,230	36.39	153,929.70	
SANOFI	55,316	89.15	4,931,421.40	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,120	139.90	156,688.00	
UCB SA	6,598	71.74	473,340.52	
ABN AMRO BANK NV-CVA	22,380	16.11	360,653.70	
AIB GROUP PLC	42,660	3.30	140,778.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	325,273	4.94	1,609,938.71	
BANCO DE SABADELL SA	227,252	1.08	246,000.29	
BANCO SANTANDER SA	816,259	3.71	3,029,137.14	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	40,719	5.05	205,834.54	

BANKIA SA	56,390	1.85	104,744.42
BANKINTER SA	40,610	6.66	270,462.60
BNP PARIBAS	54,702	52.05	2,847,239.10
CAIXABANK S.A	188,150	2.75	518,165.10
COMMERZBANK AG	48,544	5.47	265,681.31
CREDIT AGRICOLE SA	57,392	13.05	749,252.56
ERSTE GROUP BANK AG	14,558	32.58	474,299.64
FINECOBANK SPA	25,930	10.99	284,970.70
ING GROEP NV-CVA	193,515	10.70	2,070,610.50
INTESA SANPAOLO	749,993	2.32	1,745,983.70
KBC GROEP NV	12,529	66.64	834,932.56
MEDIOBANCA SPA	33,950	9.93	337,259.30
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	22.44	174,134.40
SOCIETE GENERALE	37,689	30.29	1,141,788.25
UNICREDIT SPA	93,136	13.08	1,218,777.69
AMUNDI SA	3,300	68.70	226,710.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	103,735	6.72	697,202.93
DEUTSCHE BOERSE AG	9,570	137.75	1,318,267.50
EURAZEO SE	1,877	61.00	114,497.00
EXOR NV	5,564	68.78	382,691.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,452	93.24	415,104.48
NATIXIS	49,540	3.90	193,206.00
WENDEL	1,010	121.20	122,412.00
AEGON NV	86,259	4.15	358,319.88
AGEAS	9,104	54.02	491,798.08
ALLIANZ SE-REG	20,758	219.70	4,560,532.60
ASSICURAZIONI GENERALI	49,318	18.34	904,492.12
AXA	94,412	24.78	2,339,529.36
CNP ASSURANCES	10,340	17.94	185,499.60
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	171.70	524,543.50
MAPFRE SA	59,864	2.56	153,670.88
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,956	263.90	1,835,688.40
NN GROUP NV	15,660	34.35	537,921.00
POSTE ITALIANE SPA	25,780	10.17	262,182.60
SAMPO OYJ-A SHS	21,389	37.70	806,365.30

SCOR SE	7,452	38.22	284,815.44
AROUNDTOWN SA	46,620	7.80	364,008.96
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,830	35.65	599,989.50
VONOVIA SE	25,338	46.00	1,165,548.00
ADYEN NV	480	699.20	335,616.00
AMADEUS IT GROUP SA	20,650	72.66	1,500,429.00
ATOS SE	5,240	75.00	393,000.00
CAP GEMINI SA	7,749	104.95	813,257.55
DASSAULT SYSTEMES SA	6,280	141.60	889,248.00
SAP SE	48,252	124.16	5,990,968.32
WIRECARD AG	5,480	104.45	572,386.00
WORLDLINE SA	5,770	60.25	347,642.50
INGENICO GROUP	2,900	94.00	272,600.00
NOKIA OYJ	276,466	3.21	889,252.88
CELLNEX TELECOM SA	13,230	37.65	498,109.50
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	164,006	14.76	2,421,056.57
ELISA OYJ	6,135	47.79	293,191.65
ILIAD SA	1,500	114.50	171,750.00
KONINKLIJKE KPN NV	194,906	2.61	508,899.56
ORANGE S.A.	101,394	13.27	1,346,005.35
PROXIMUS	8,290	25.90	214,711.00
TELECOM ITALIA SPA	352,713	0.55	194,097.96
TELECOM ITALIA-RSP	334,757	0.54	181,438.29
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	54,770	2.66	145,797.74
TELEFONICA SA	236,739	6.72	1,592,306.51
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,700	29.38	196,846.00
E.ON SE	110,179	9.37	1,032,487.40
EDF	32,475	9.66	313,838.40
ENAGAS SA	12,350	22.26	274,911.00
ENDESA SA	16,390	24.28	397,949.20
ENEL SPA	401,917	6.92	2,783,275.22
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	123,071	3.75	461,516.25
ENGIE	89,684	14.58	1,308,041.14
FORTUM OYJ	21,025	21.36	449,094.00
IBERDROLA SA	298,752	8.99	2,688,170.49

	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	22.79	345,314.08	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	21,960	17.48	383,970.60	
	RWE AG	30,745	25.97	798,447.65	
	SNAM SPA	119,980	4.44	532,951.16	
	SUEZ	20,969	13.30	278,887.70	
	TERNA SPA	77,357	5.66	437,995.33	
	UNIPER SE	11,740	29.58	347,269.20	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,224	23.31	704,521.44	
	VERBUND AG	2,990	45.62	136,403.80	
	ASML HOLDING NV	20,862	259.85	5,420,990.70	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	59,585	21.04	1,253,966.32	
	STMICROELECTRONICS NV	33,663	24.58	827,436.54	
ユーロ小計		9,578,916		203,464,803.83	(24,769,805,218)
英ポンド	BP PLC	1,003,308	4.62	4,639,797.84	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	210,218	21.52	4,524,942.45	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	183,689	21.35	3,922,678.59	
	ANGLO AMERICAN PLC	54,404	21.34	1,160,981.36	
	ANTOFAGASTA PLC	14,940	9.29	138,792.60	
	BHP GROUP PLC	105,941	17.38	1,841,466.46	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	48.76	298,947.56	
	EVRAZ PLC	27,180	3.76	102,278.34	
	GLENCORE PLC	528,213	2.25	1,192,704.95	
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,079	28.81	319,185.99	
	MONDI PLC	21,700	16.96	368,140.50	
	RIO TINTO PLC	55,835	43.20	2,412,351.17	
	ASHTREAD GROUP PLC	23,130	23.13	534,996.90	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	148,515	5.74	853,367.19	
	BUNZL PLC	14,996	20.61	309,067.56	
	DCC PLC	3,950	64.70	255,565.00	
	FERGUSON PLC	10,352	66.52	688,615.04	
	MEGGITT PLC	43,785	6.57	287,667.45	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	239,080	2.34	560,164.44	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	84,565	6.86	580,454.16	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGSPLC-ENT-C	3,290,610	0.00	3,290.61	

SMITHS GROUP PLC	21,173	16.19	342,896.73
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	86.00	338,840.00
WEIR GROUP PLC/THE	10,140	15.21	154,280.10
EXPERIAN PLC	43,228	24.47	1,057,789.16
G4S PLC	58,799	2.15	126,947.04
INTERTEK GROUP PLC	8,065	55.10	444,381.50
RELX PLC	96,105	18.04	1,734,214.72
RENTOKIL INITIAL PLC	92,700	4.26	395,365.50
EASYJET PLC	6,550	14.70	96,285.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	49,140	7.65	375,921.00
BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	51.42	343,485.60
BURBERRY GROUP PLC	19,084	21.20	404,580.80
PERSIMMON PLC	16,300	28.16	459,008.00
TAYLOR WIMPEY PLC	146,790	1.99	293,066.23
CARNIVAL PLC	8,760	33.12	290,131.20
COMPASS GROUP PLC	78,488	18.38	1,443,001.88
GVC HOLDINGS PLC	27,190	8.69	236,335.48
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,283	48.90	453,938.70
TUI AG-DI	22,603	9.74	220,243.63
WHITBREAD PLC	5,410	49.61	268,390.10
AUTO TRADER GROUP PLC	48,880	5.73	280,473.44
INFORMA PLC	54,470	8.05	438,483.50
ITV PLC	197,275	1.52	301,041.65
PEARSON PLC	44,059	6.60	290,789.40
WPP PLC	60,674	10.23	620,695.02
JD SPORTS FASHION PLC	22,530	7.82	176,364.84
KINGFISHER PLC	114,937	2.21	255,045.20
MARKS & SPENCER GROUP PLC	108,264	2.23	242,078.30
NEXT PLC	6,767	71.90	486,547.30
OCADO GROUP PLC	20,770	12.39	257,444.15
SAINSBURY (J) PLC	72,601	2.23	162,045.43
TESCO PLC	449,364	2.51	1,129,251.73
WM MORRISON SUPERMARKETS	129,955	1.95	254,516.86
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,905	25.99	491,340.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	113,117	30.39	3,437,625.63

COCA-COLA HBC AG-CDI	8,420	24.78	208,647.60
DIAGEO PLC	116,612	30.51	3,557,832.12
IMPERIAL BRANDS PLC	45,752	17.65	807,614.30
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,305	60.37	2,070,992.85
UNILEVER PLC	54,817	45.45	2,491,432.65
NMC HEALTH PLC	3,660	24.64	90,182.40
SMITH & NEPHEW PLC	46,976	17.34	814,798.72
ASTRAZENECA PLC	64,573	72.17	4,660,233.41
GLAXOSMITHKLINE PLC	245,781	17.25	4,239,722.25
BARCLAYS PLC	867,751	1.82	1,583,472.02
HSBC HOLDINGS PLC	993,781	5.74	5,710,265.62
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,440,536	0.64	2,213,296.80
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	236,130	2.51	594,575.34
STANDARD CHARTERED PLC	129,930	7.04	915,746.64
3I GROUP PLC	45,549	10.71	488,057.53
HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,320	19.53	279,669.60
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,397	71.72	1,032,552.84
M&G PLC	109,522	2.44	267,233.68
SCHRODERS PLC	6,901	33.60	231,873.60
ST JAMES'S PLACE PLC	32,650	11.48	374,985.25
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	3.15	391,592.25
ADMIRAL GROUP PLC	10,865	22.02	239,247.30
AVIVA PLC	184,725	4.15	768,086.55
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	3.13	230,662.20
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,501	3.05	899,111.55
PRUDENTIAL PLC	125,292	13.88	1,739,052.96
RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	5.70	314,396.87
AVEVA GROUP PLC	3,440	45.42	156,244.80
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	13,079	10.52	137,669.55
SAGE GROUP PLC/THE	57,710	7.32	422,668.04
HALMA PLC	18,330	20.74	380,164.20
BT GROUP PLC	410,052	2.01	826,869.85
VODAFONE GROUP PLC	1,333,428	1.46	1,950,005.10
CENTRICA PLC	272,675	0.87	239,408.65
NATIONAL GRID PLC	167,438	9.28	1,553,992.07

	SEVERN TRENT PLC	11,503	24.20	278,372.60	
	SSE PLC	49,417	14.15	699,497.63	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	28,615	9.05	259,194.67	
英債券小計		18,021,056		87,417,723.99 (12,774,352,006)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,550	21.07	159,078.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	460	626.00	287,960.00	
	GIVAUDAN-REG	463	2,900.00	1,342,700.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	23,759	52.48	1,246,872.32	
	SIKA AG-REG	6,380	178.00	1,135,640.00	
	ABB LTD-REG	93,195	23.27	2,168,647.65	
	GEBERIT AG-REG	1,720	539.80	928,456.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	241.20	253,260.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,220	251.50	558,330.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,547	61.62	403,426.14	
	SGS SA-REG	258	2,602.00	671,316.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,550	163.90	417,945.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	26,229	75.30	1,975,043.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,670	276.90	462,423.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,150	52.30	164,745.00	
	DUFREY AG-REG	1,570	96.00	150,720.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	175	2,054.00	359,450.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	48	7,445.00	357,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	83,800.00	502,800.00	
	NESTLE SA-REG	145,863	102.94	15,015,137.22	
	ALCON INC	19,664	54.84	1,078,373.76	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,610	214.70	560,367.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	934.20	448,416.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,588	335.60	1,204,132.80	
	NOVARTIS AG-REG	105,533	91.21	9,625,664.93	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	34,428	300.55	10,347,335.40	
	VIFOR PHARMA AG	2,520	173.90	438,228.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	122,418	13.12	1,606,124.16	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,750	48.31	567,642.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,185	80.50	175,892.50	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	885	861.40	762,339.00	
	UBS GROUP AG-REG	193,882	12.07	2,340,155.74	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	174.10	433,509.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,600	488.40	781,440.00	
	SWISS RE AG	14,599	107.85	1,574,502.15	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,261	394.10	2,861,560.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,291	106.70	457,849.70	
	TEMENOS AG	2,850	152.00	433,200.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,154	517.60	597,310.40	
	スイスフラン小計	859,051		64,855,353.67 (7,211,266,774)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	7,310	304.10	2,222,971.00	
	BOLIDEN AB	14,670	250.40	3,673,368.00	
	ALFA LAVAL AB	13,200	233.20	3,078,240.00	
	ASSA ABLOY AB-B	51,530	220.00	11,336,600.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	32,235	377.20	12,159,042.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	20,160	328.40	6,620,544.00	
	EPIROC AB-A	29,345	115.20	3,380,544.00	
	EPIROC AB-B	23,530	111.75	2,629,477.50	
	SANDVIK AB	54,530	187.00	10,197,110.00	
	SKANSKA AB-B SHS	19,210	211.50	4,062,915.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	194.65	3,875,286.85	
	VOLVO AB-B SHS-B	72,910	148.15	10,801,616.50	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	161.50	2,362,583.50	
	ELECTROLUX AB - B	13,585	250.80	3,407,118.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,170	76.68	1,930,035.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,888	190.62	7,412,830.56	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	418.00	1,768,140.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,100	459.00	3,717,900.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,985	291.50	8,740,627.50	
	NORDEA BANK ABP	155,312	71.79	11,149,848.48	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	84,320	88.24	7,440,396.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,130	101.00	7,790,130.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,140	129.05	5,825,317.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,060	221.60	2,229,296.00	

	INVESTOR AB-B SHS	21,495	513.20	11,031,234.00	
	KINNEVIK AB - B	12,405	224.30	2,782,441.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	396.20	1,576,876.00	
	ERICSSON LM-B SHS	143,285	85.04	12,184,956.40	
	HEXAGON AB-B SHS	12,660	575.00	7,279,500.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,030	431.00	1,736,930.00	
	TELE2 AB-B SHS	21,615	137.05	2,962,335.75	
	TELIA CO AB	122,530	40.54	4,967,366.20	
スウェーデンクローナ小計		1,207,088		182,333,578.14	(2,126,009,521)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	6,510	271.80	1,769,418.00	
	EQUINOR ASA	50,654	169.80	8,601,049.20	
	NORSK HYDRO A S	62,840	32.70	2,054,868.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,800	357.50	2,788,500.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	243.60	1,252,104.00	
	MOWI ASA	20,670	228.60	4,725,162.00	
	ORKLA ASA	38,170	88.08	3,362,013.60	
	DNB ASA	49,355	157.55	7,775,880.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,470	184.15	2,112,200.50	
	TELENOR ASA	34,555	160.05	5,530,527.75	
ノルウェークローネ小計		287,164		39,971,723.30	(484,057,569)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,680	523.00	2,447,640.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,675	326.00	3,806,050.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	9,700	681.00	6,605,700.00	
	ISS A/S	7,930	158.25	1,254,922.50	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	195	9,405.00	1,833,975.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	323	10,060.00	3,249,380.00	
	DSV PANALPINA A S	11,110	757.20	8,412,492.00	
	PANDORA A/S	4,560	275.20	1,254,912.00	
	CARLSBERG AS-B	5,470	962.40	5,264,328.00	
	COLOPLAST-B	5,825	773.40	4,505,055.00	
	DEMANT A/S	4,440	211.00	936,840.00	
	GENMAB A/S	3,070	1,469.00	4,509,830.00	
H LUNDBECK A/S	4,200	261.50	1,098,300.00		

	NOVO NORDISK A/S-B	86,625	383.00	33,177,375.00	
	DANSKE BANK A/S	31,805	104.00	3,307,720.00	
	TRYG A/S	6,075	194.40	1,180,980.00	
	ORSTED A/S	9,210	653.80	6,021,498.00	
	デンマーククローネ小計	206,893		88,866,997.50 (1,447,643,389)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,105	34.09	480,839.45	
	OIL SEARCH LTD	68,980	7.35	507,003.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	89,820	8.70	781,434.00	
	SANTOS LTD	79,625	8.25	656,906.25	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	44,633	34.63	1,545,640.79	
	WORLEY LTD	12,600	15.31	192,906.00	
	ALUMINA LTD	107,822	2.38	256,616.36	
	BHP GROUP LTD	145,086	39.35	5,709,134.10	
	BLUESCOPE STEEL LTD	30,460	15.21	463,296.60	
	BORAL LTD	71,995	4.50	323,977.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	68,255	10.72	731,693.60	
	INCITEC PIVOT LTD	75,040	3.15	236,376.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	18,225	27.86	507,748.50	
	NEWCREST MINING LTD	34,449	28.05	966,294.45	
	ORICA LIMITED	20,325	22.81	463,613.25	
	RIO TINTO LTD	18,988	100.60	1,910,192.80	
	SOUTH32 LTD	255,347	2.88	735,399.36	
	CIMIC GROUP LTD	4,887	34.32	167,721.84	
	BRAMBLES LTD	78,388	12.07	946,143.16	
	SEEK LTD	17,930	22.16	397,328.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	95,170	5.45	518,676.50	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	7.28	320,320.00	
	SYDNEY AIRPORT	51,686	8.75	452,252.50	
	TRANSURBAN GROUP	133,649	15.15	2,024,782.35	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,560	34.19	1,181,606.40	
	CROWN RESORTS LTD	19,095	12.22	233,340.90	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,630	44.04	71,785.20	
	TABCORP HOLDINGS LTD	97,874	4.71	460,986.54	
	REA GROUP LTD	3,030	106.02	321,240.60	

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	12,062	4.19	50,539.78	
	WESFARMERS LTD	55,385	40.95	2,268,015.75	
	COLES GROUP LTD	51,925	15.09	783,548.25	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,862	37.42	2,389,716.04	
	COCA-COLA AMATIL LTD	30,530	11.10	338,883.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,246	16.89	612,194.94	
	COCHLEAR LTD	2,917	225.10	656,616.70	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,855	71.54	490,406.70	
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,390	28.93	589,882.70	
	CSL LTD	22,252	278.12	6,188,726.24	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	135,479	24.71	3,347,686.09	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	30,168	9.87	297,758.16	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	86,557	80.06	6,929,753.42	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	140,183	25.15	3,525,602.45	
	WESTPAC BANKING CORP	171,161	24.48	4,190,021.28	
	AMP LTD	156,627	1.94	304,639.51	
	ASX LTD	10,195	79.85	814,070.75	
	CHALLENGER LTD	20,840	8.20	170,888.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	15,914	136.31	2,169,237.34	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	7,680	55.88	429,158.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	116,375	7.98	928,672.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	104,360	3.27	341,257.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	68,340	12.97	886,369.80	
	SUNCORP GROUP LTD	56,606	13.19	746,633.14	
	COMPUTERSHARE LTD	25,050	17.28	432,864.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,500	24.00	204,000.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	231,884	3.67	851,014.28	
	TPG TELECOM LTD	7,840	6.72	52,684.80	
	AGL ENERGY LTD	28,301	20.61	583,283.61	
	APA GROUP	53,448	10.82	578,307.36	
	AUSNET SERVICES	69,210	1.69	117,310.95	
豪ドル小計		3,584,796		65,834,999.94	(4,955,400,445)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	51,383	5.25	269,760.75	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	8.75	494,506.25	

	A2 MILK CO LTD	38,820	15.34	595,498.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,590	21.56	530,160.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	28,640	15.90	455,376.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,377	4.29	344,817.33	
	MERIDIAN ENERGY LTD	55,650	4.99	277,971.75	
	ニュージーランドドル小計	335,975		2,968,091.28	(214,207,147)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	135,708	74.25	10,076,319.00	
	NWS HOLDINGS LTD	82,500	10.84	894,300.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	60,000	63.45	3,807,000.00	
	MTR CORP	82,000	46.40	3,804,800.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	41,000	22.70	930,700.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	109,000	57.95	6,316,550.00	
	SANDS CHINA LTD	121,400	39.65	4,813,510.00	
	SJM HOLDINGS LTD	82,000	8.82	723,240.00	
	WYNN MACAU LTD	93,800	18.26	1,712,788.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	28.00	1,901,200.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	40,000	29.45	1,178,000.00	
	WH GROUP LTD	530,500	8.15	4,323,575.00	
	BANK OF EAST ASIA	76,040	18.08	1,374,803.20	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	189,000	27.60	5,216,400.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,600	163.00	6,291,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	57,800	255.40	14,762,120.00	
	AIA GROUP LTD	592,190	82.65	48,944,503.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	122,708	54.30	6,663,044.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,000	16.68	1,317,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	38.70	2,821,268.70	
	KERRY PROPERTIES LTD	31,950	25.75	822,712.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	283,666	10.62	3,012,532.92	
	SINO LAND CO	143,050	11.54	1,650,797.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	72,480	118.30	8,574,384.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,017	73.35	2,201,746.95	
	SWIRE PROPERTIES LTD	66,000	25.80	1,702,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	47,800	44.00	2,103,200.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	50,600	51.05	2,583,130.00	

	HKT TRUST AND HKT LTD	153,000	11.36	1,738,080.00	
	PCCW LTD	231,000	4.61	1,064,910.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	27,000	55.85	1,507,950.00	
	CLP HOLDINGS LTD	75,000	82.55	6,191,250.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	159,500	7.83	1,248,885.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	501,434	15.14	7,591,710.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS	59,000	56.15	3,312,850.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,800	110.70	1,970,460.00	
香港ドル小計		4,623,344		175,151,040.93 (2,457,369,104)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	62,360	6.72	419,059.20	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.26	47,460.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	86,700	4.00	346,800.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	120,300	2.41	289,923.00	
	SATS LTD	37,500	5.11	191,625.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	21,800	9.13	199,034.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	352,600	0.93	327,918.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	94,350	2.08	196,248.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	30.69	184,140.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	84,360	4.19	353,468.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,415	25.82	2,179,595.30	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	159,040	10.97	1,744,668.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	62,500	26.37	1,648,125.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	36,800	9.03	332,304.00	
	CAPITALAND LTD	145,700	3.68	536,176.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,200	10.70	184,040.00	
	UOL GROUP LTD	26,150	8.05	210,507.50	
	VENTURE CORP LTD	16,600	16.43	272,738.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	407,180	3.39	1,380,340.20	
シンガポールドル小計		1,842,555		11,044,170.40 (892,479,410)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	36,890	15.33	565,523.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	570.00	684,000.00	
	BANK HAPUALIM BM	60,335	27.50	1,659,212.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,505	24.60	1,734,423.00	

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,400	15.90	1,023,960.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	94.56	775,392.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,610	271.80	437,598.00	
	NICE LTD	2,455	540.00	1,325,700.00	
イスラエルシュケル小計		245,595		8,205,809.20	(257,662,408)
合 計		57,539,395		210,467,110,343	(210,467,110,343)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	31,970	559,794.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,140	804,255.80	
		AMERICAN TOWER CORP	21,869	4,647,599.88	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	66,040	626,719.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,665	1,390,585.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,937	937,258.07	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,330	560,982.50	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,560	2,727,900.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,475	1,191,112.25	
		DUKE REALTY CORPORATION	17,385	594,740.85	
		EQUINIX INC	4,318	2,382,845.12	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,580	529,463.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	17,440	1,412,814.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,480	1,045,774.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,100	726,259.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,945	504,052.65	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,815	703,533.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	39,369	706,673.55	
		INVITATION HOMES INC	25,280	733,878.40	
		IRON MOUNTAIN INC	12,895	407,353.05	
KIMCO REALTY CORPORATION	20,575	417,878.25			

		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,083	482,474.27	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,450	465,951.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,750	750,375.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,590	444,274.80	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	457,894.80	
		PROLOGIS INC	31,202	2,762,625.08	
		PUBLIC STORAGE	7,959	1,635,017.37	
		REALTY INCOME CORP	15,120	1,096,200.00	
		REGENCY CENTERS CORP	8,145	496,111.95	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,670	1,335,171.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	14,794	2,135,513.90	
		SL GREEN REALTY CORP	3,450	306,015.00	
		SUN COMMUNITIES INC	4,550	696,787.00	
		UDR INC	14,500	670,770.00	
		VENTAS INC	16,665	924,907.50	
		VEREIT INC	47,904	438,321.60	
		VICI PROPERTIES INC	23,290	566,645.70	
		VORNADO REALTY TRUST	8,131	530,710.37	
		WELLTOWER INC	19,920	1,567,106.40	
		WEYERHAEUSER CO	33,338	988,138.32	
		WP CAREY INC	9,580	740,150.80	
米ドル小計			677,419	43,102,638.98	(4,716,721,783)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	4,700	243,225.00	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,690	138,683.70	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,660	151,008.80	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	52,254.80	
加ドル小計			18,740	585,172.30	(48,592,707)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	2,655	262,977.75	
		GECINA SA	2,350	360,490.00	
		ICADE	1,175	108,628.75	
		KLEPIERRE	10,512	339,327.36	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,350	876,300.00	
			23,042	1,947,723.86	

ユーロ小計				(237,115,902)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	34,331	213,607.48
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	341,852.01
		SEGRO PLC	62,233	540,182.44
英ポンド小計			130,698	1,095,641.93 (160,106,155)
豪ドル	投資証券	DEXUS	57,587	674,343.77
		GOODMAN GROUP	81,012	1,107,434.04
		GPT GROUP	87,135	495,798.15
		LENDLEASE GROUP	28,927	547,877.38
		MIRVAC GROUP	208,775	655,553.50
		SCENTRE GROUP	268,371	1,006,391.25
		STOCKLAND	115,500	540,540.00
		VICINITY CENTRES	123,402	309,739.02
豪ドル小計			970,709	5,337,677.11 (401,766,956)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	111,500	8,975,750.00
香港ドル小計			111,500	8,975,750.00 (125,929,772)
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	160,312	466,507.92
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	162,540	320,203.80
		CAPITALAND MALL TRUST	132,400	320,408.00
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,400	274,364.00
		SUNTEC REIT	91,400	165,434.00
シンガポールドル小計			668,052	1,546,917.72 (125,006,420)
合計				5,815,239,695 (5,815,239,695)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

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

米ドル	株式	608銘柄	96.8%		66.9%
	投資証券	42銘柄		3.2%	2.2%
加ドル	株式	86銘柄	99.4%		3.7%
	投資証券	4銘柄		0.6%	0.0%
ユーロ	株式	235銘柄	99.1%		11.5%
	投資証券	5銘柄		0.9%	0.1%
英ポンド	株式	94銘柄	98.8%		5.9%
	投資証券	3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%		3.3%
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	60銘柄	92.5%		2.3%
	投資証券	8銘柄		7.5%	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	36銘柄	95.1%		1.1%
	投資証券	1銘柄		4.9%	0.1%
シンガポールドル	株式	19銘柄	87.7%		0.4%
	投資証券	5銘柄		12.3%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年12月30日現在です。

【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	33,003,908,023円
負債総額	55,710,199円
純資産総額(-)	32,948,197,824円
発行済口数	35,823,969,675口
1口当たり純資産額(/)	0.9197円

(参考)

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	118,939,347,788円
負債総額	481円
純資産総額(-)	118,939,347,307円
発行済口数	47,129,182,114口
1口当たり純資産額(/)	2.5237円

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	116,284,381,485円
負債総額	1,120,984,626円
純資産総額(-)	115,163,396,859円
発行済口数	50,486,153,483口
1口当たり純資産額(/)	2.2811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	42,986,834,142円
負債総額	330,836,417円
純資産総額（ - ）	42,655,997,725円
発行済口数	29,938,647,156口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4248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	157,247,355,479円
負債総額	215,185,140円
純資産総額（ - ）	157,032,170,339円
発行済口数	66,435,529,040口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3637円

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	33,331,856,802円
負債総額	23,813,978円
純資産総額（ - ）	33,308,042,824円
発行済口数	20,838,905,478口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5984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	229,979,143,359円
負債総額	262,621,776円
純資産総額（ - ）	229,716,521,583円
発行済口数	81,135,868,081口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8313円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2019年12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12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12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12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	834	207,475
株式投資信託	787	176,065
単位型	264	10,997
追加型	523	165,068
公社債投資信託	47	31,409
単位型	34	909
追加型	13	30,499

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

無形固定資産合計	99	107
投資その他の資産		
投資有価証券	14,103	16,755
関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	490	447
長期前払費用	0	-
繰延税金資産	1,504	1,913
投資その他の資産合計	41,868	44,886
固定資産合計	42,159	45,268
資産合計	83,959	88,038

(単位：百万円)

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

その他有価証券評価差額金	408	493
繰延ヘッジ損益	346	185
評価・換算差額等合計	754	679
純資産合計	62,511	69,571
負債純資産合計	83,959	88,038

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		26		37
受取配当金	1	1,120	1	1,865
有価証券償還益		1		1
デリバティブ収益		-	1	142
時効成立分配金・償還金		1		21
為替差益		79		58
その他		41		48
営業外収益合計		1,272		2,176
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

(3) 【株主資本等変動計算書】

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

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

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</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 border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生 of 翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

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

(貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704

(退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

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

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

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左
--------	------------------------------	----

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

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

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

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

第61期中間会計期間
(2019年9月30日)

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

(単位:百万円)

第61期中間会計期間
(2019年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		5,950
未払費用		3,948
未払法人税等		1,788
未払消費税等	3	415
賞与引当金		1,432
役員賞与引当金		27
その他		559
流動負債合計		14,122

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第61期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当中間期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
中間純利益				5,940	5,940		5,940
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,727	2,727	71	2,655
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	49,870	49,870	905	71,547

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,212
中間純利益				5,940
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	136	212	75	75
当中間期変動額合計	136	212	75	2,731
当中間期末残高	356	398	755	72,302

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<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>

2 固定資産の減価償却の方法	<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>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当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 style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第61期中間会計期間 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,977百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4 保証債務	当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務396百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	442,200	1,613,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	1,533,000	2,085,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,018,000	2,793,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,018,000	3,338,000	-
合計		15,088,300	-	5,258,600	9,829,700	-

(注) 1 2009年度ストックオプション(1)、2009年度ストックオプション(2)、2011年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、2016年度ストックオプション(1)1,251,000株及び2016年度ストックオプション(2)937,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)834,000株、2016年度ストックオプション(2)1,856,000株及び2017年度ストックオプション(1)3,338,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	898百万円
1年超	6,604百万円
合計	7,503百万円

(金融商品関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものは、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち86百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、10百万円は、流動負債のその他に含まれております。

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

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

(有価証券関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

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

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

(デリバティブ取引関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,129	-	47	47
合計		2,129	-	47	47

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,760	-	17	17
合計		1,760	-	17	17

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

2 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,261	-	10
	豪ドル		71	-	2
	シンガポールドル		913	-	11

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(ストックオプション等関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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

[関連情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益(百万円)	5,940
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,940
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,640
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、 2016年度ストックオプション(1)2,085,000株、 2016年度ストックオプション(2)2,793,000株、 2017年度ストックオプション(1)3,338,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	72,302
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	72,302
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,558

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もし

くは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2019年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
エース証券株式会社	8,831百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村證券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	9,257百万円 (2019年3月末現在)	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	

株式会社イオン銀行	51,250百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
オーストラリア・アンド・ニュージ ランド・バンキング・グループ・リミ テッド(銀行) 1	26,490百万豪ドル	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社第三銀行	37,461百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行 1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社南日本銀行	16,601百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
愛知北農業協同組合	747百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
愛知県信用農業協同組合連合会	198,402百万円	
あいち知多農業協同組合	7,183百万円	
あいち中央農業協同組合	3,468百万円	
あいち豊田農業協同組合	1,809百万円	
愛知西農業協同組合	1,617百万円	
愛知東農業協同組合	971百万円	

あいち尾東農業協同組合	1,192百万円
あいち三河農業協同組合	1,114百万円
あいら伊豆農業協同組合	915百万円
秋田しんせい農業協同組合	5,632百万円
あさか野農業協同組合	871百万円
厚木市農業協同組合	2,589百万円
ありだ農業協同組合	2,098百万円
淡路日の出農業協同組合	1,879百万円
いしのまき農業協同組合	4,497百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	2,846百万円
石川県信用農業協同組合連合会	17,468百万円
伊豆太陽農業協同組合	1,818百万円
伊豆の国農業協同組合	913百万円
いずみの農業協同組合	2,884百万円
伊勢農業協同組合	4,367百万円
茨木市農業協同組合	1,237百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,215百万円
いび川農業協同組合	2,073百万円
いるま野農業協同組合	5,963百万円
越後中央農業協同組合	5,313百万円
越後ながおか農業協同組合	5,506百万円
遠州中央農業協同組合	3,301百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,579百万円
大井川農業協同組合	3,433百万円
大阪市農業協同組合	1,919百万円
大阪泉州農業協同組合	2,009百万円
大阪中河内農業協同組合	4,263百万円
大阪府信用農業協同組合連合会	140,690百万円
大阪南農業協同組合	3,822百万円
おおぞら農業協同組合	1,217百万円
沖縄県農業協同組合	22,037百万円
越智今治農業協同組合	6,417百万円
尾張中央農業協同組合	2,118百万円
加賀農業協同組合	1,966百万円
香川県農業協同組合	26,469百万円
神奈川つくい農業協同組合	850百万円
掛川市農業協同組合	746百万円
神奈川県信用農業協同組合連合会	194,885百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,531百万円
金沢市農業協同組合	3,158百万円
金沢中央農業協同組合	1,058百万円
上伊那農業協同組合	8,124百万円
紀州農業協同組合	3,667百万円

北越後農業協同組合	3,088百万円
北大阪農業協同組合	1,887百万円
北河内農業協同組合	2,635百万円
きたそらち農業協同組合	3,396百万円
北つくば農業協同組合	3,382百万円
紀南農業協同組合	4,717百万円
紀の里農業協同組合	3,586百万円
ぎふ農業協同組合	7,218百万円
岐阜県信用農業協同組合連合会	70,118百万円
紀北川上農業協同組合	4,269百万円
くまがや農業協同組合	2,768百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,507百万円
グリーン長野農業協同組合	3,699百万円
甲賀農業協同組合	2,478百万円
高知県農業協同組合	1,565百万円
高知県信用農業協同組合連合会	19,870百万円
高知市農業協同組合	4,109百万円
越谷市農業協同組合	1,568百万円
御殿場農業協同組合	1,234百万円
小松市農業協同組合	1,744百万円
さいかつ農業協同組合	1,864百万円
さいたま農業協同組合	8,181百万円
埼玉県信用農業協同組合連合会	139,440百万円
埼玉中央農業協同組合	2,335百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,437百万円
堺市農業協同組合	1,187百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,757百万円
さがみ農業協同組合	5,363百万円
相模原市農業協同組合	881百万円
佐久浅間農業協同組合	6,627百万円
佐渡農業協同組合	2,505百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,545百万円
塩尻市農業協同組合	1,568百万円
滋賀県信用農業協同組合連合会	34,697百万円
静岡県信用農業協同組合連合会	111,302百万円
静岡市農業協同組合	1,902百万円
島根県農業協同組合	22,681百万円
清水農業協同組合	2,981百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,381百万円
湘南農業協同組合	1,998百万円
信州うえだ農業協同組合	4,273百万円
信州諏訪農業協同組合	6,454百万円
新みやぎ農業協同組合	2,941百万円

鈴鹿農業協同組合	1,628百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,516百万円
仙台農業協同組合	3,434百万円
大北農業協同組合	3,263百万円
高崎市農業協同組合	2,001百万円
たじま農業協同組合	4,526百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,286百万円
津安芸農業協同組合	2,189百万円
鶴岡市農業協同組合	1,488百万円
東京都信用農業協同組合連合会	78,204百万円
陶都信用農業協同組合	1,607百万円
十日町農業協同組合	2,815百万円
徳島県信用農業協同組合連合会	32,546百万円
徳島市農業協同組合	3,026百万円
鳥取いなば農業協同組合	6,061百万円
鳥取西部農業協同組合	5,133百万円
鳥取中央農業協同組合	3,875百万円
とびあ浜松農業協同組合	3,715百万円
豊橋農業協同組合	2,515百万円
ながの農業協同組合	12,921百万円
長野県信用農業協同組合連合会	54,858百万円
中野市農業協同組合	2,504百万円
ながみね農業協同組合	2,006百万円
なごや農業協同組合	2,454百万円
那須南農業協同組合	1,157百万円
奈良県農業協同組合	9,389百万円
南彩農業協同組合	2,847百万円
南駿農業協同組合	3,158百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,498百万円
新潟県信用農業協同組合連合会	56,296百万円
にいがた南蒲農業協同組合	4,950百万円
新潟みらい農業協同組合	4,830百万円
西春日井農業協同組合	157百万円
西三河農業協同組合	1,301百万円
西美濃農業協同組合	4,658百万円
能登わかば農業協同組合	2,667百万円
延岡農業協同組合	1,469百万円
能美農業協同組合	1,249百万円
ハイナン農業協同組合	857百万円
はが野農業協同組合	3,648百万円
はくい農業協同組合	1,340百万円
秦野市農業協同組合	1,775百万円
東美濃農業協同組合	2,624百万円

ひすい農業協同組合	1,264百万円
飛騨農業協同組合	6,368百万円
兵庫県信用農業協同組合連合会	170,546百万円
兵庫西農業協同組合	12,416百万円
兵庫南農業協同組合	3,763百万円
広島市農業協同組合	6,724百万円
広島中央農業協同組合	3,067百万円
ふかや農業協同組合	1,613百万円
福岡県信用農業協同組合連合会	32,382百万円
福岡八女農業協同組合	3,556百万円
ふくしま未来農業協同組合	15,932百万円
富士市農業協同組合	1,492百万円
富士宮農業協同組合	945百万円
ほくさい農業協同組合	3,181百万円
松本ハイランド農業協同組合	6,213百万円
三重県信用農業協同組合連合会	39,124百万円
みくまの農業協同組合	1,002百万円
三島函南農業協同組合	1,049百万円
三ヶ日町農業協同組合	297百万円
みなみ信州農業協同組合	4,519百万円
みのり農業協同組合	4,439百万円
みやぎ仙南農業協同組合	4,041百万円
みやぎ登米農業協同組合	6,459百万円
みやぎ亘理農業協同組合	1,554百万円
宮崎中央農業協同組合	5,828百万円
めぐみの農業協同組合	4,704百万円
山形農業協同組合	4,080百万円
山形おきたま農業協同組合	4,965百万円
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円
山口県農業協同組合	2,362百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,454百万円
横浜農業協同組合	12,402百万円
わかやま農業協同組合	4,466百万円
和歌山県信用農業協同組合連合会	51,799百万円

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 6月28日	臨時報告書
2019年 9月17日	有価証券届出書
2019年 9月17日	有価証券報告書
2019年 9月30日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月22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」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2019年6月18日から2019年12月16日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2019年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

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。