

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・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 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インデックス・バランス・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）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。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

（７）【申込期間】

2020年 3月11日から2020年 9月10日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（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）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		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。

属性区分表

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	対象 インデックス	特殊型

株式	年1回	グローバル	ファミ	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	リーファ	()		
大型株	年2回		ンド		TOPIX	条件付運用型
中小型株				なし		
債券	年4回	日本	ファン		その他	ロング・
一般	年6回	北米	ド・オ		()	ショート型 /
公債	(隔月)	欧州	ブ・ファ			絶対収益追求
社債			ンズ			型
その他債券	年12回					その他
クレジット属性	(毎月)	アジア				()
()	日々	オセアニア				
不動産投信	その他	中南米				
その他資産	()	アフリカ				
(投資信託証券						
(資産複合(株						
式、債券)資産配		中近東				
分固定型))		(中東)				
資産複合		エマージン				
()		グ				
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 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われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち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う。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又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う。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又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う。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (5)アジア...目論見書又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除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又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く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

< ファンドの特色 >

● 国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」といいます。)の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

<投資対象とするマザーファンド>

国内株式	日本株式マザーファンド	「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」に連動する投資成果を目標とします。
外国株式	外国株式マザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。
外国債券	外国債券マザーファンド	「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。

● 3つの資産への均等配分を基本配分比率とします。

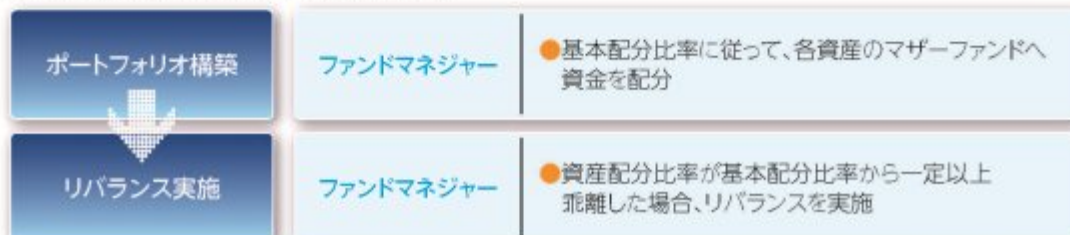
基本配分比率



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。

ポートフォリオ構築プロセス

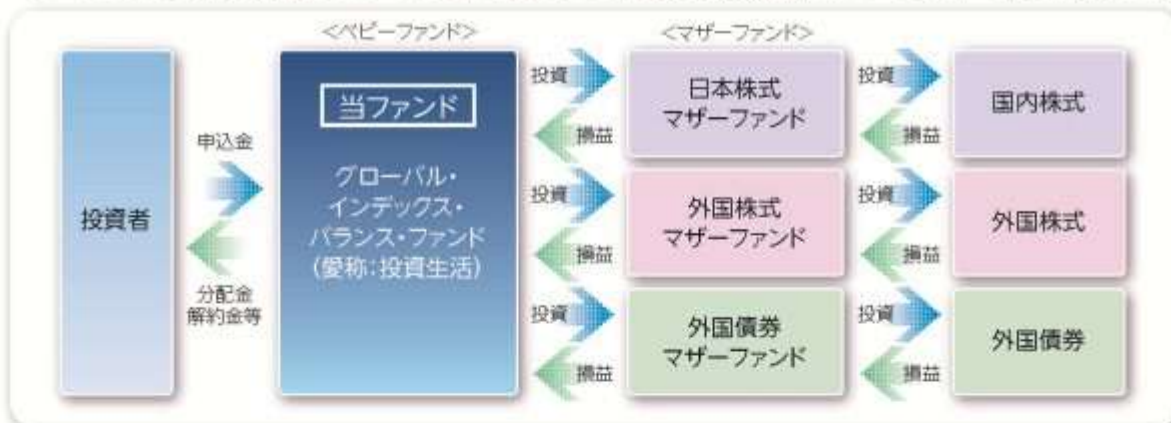
ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

● ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



● 主な投資制限

- 株式への投資割合 …………… 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。
- 外貨建資産への投資割合 …… 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

● 分配方針

年1回、毎決算時(決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。)に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド:「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

外国株式マザーファンド:「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」

「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

外国債券マザーファンド:「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2008年3月3日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

2010年9月11日 ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更

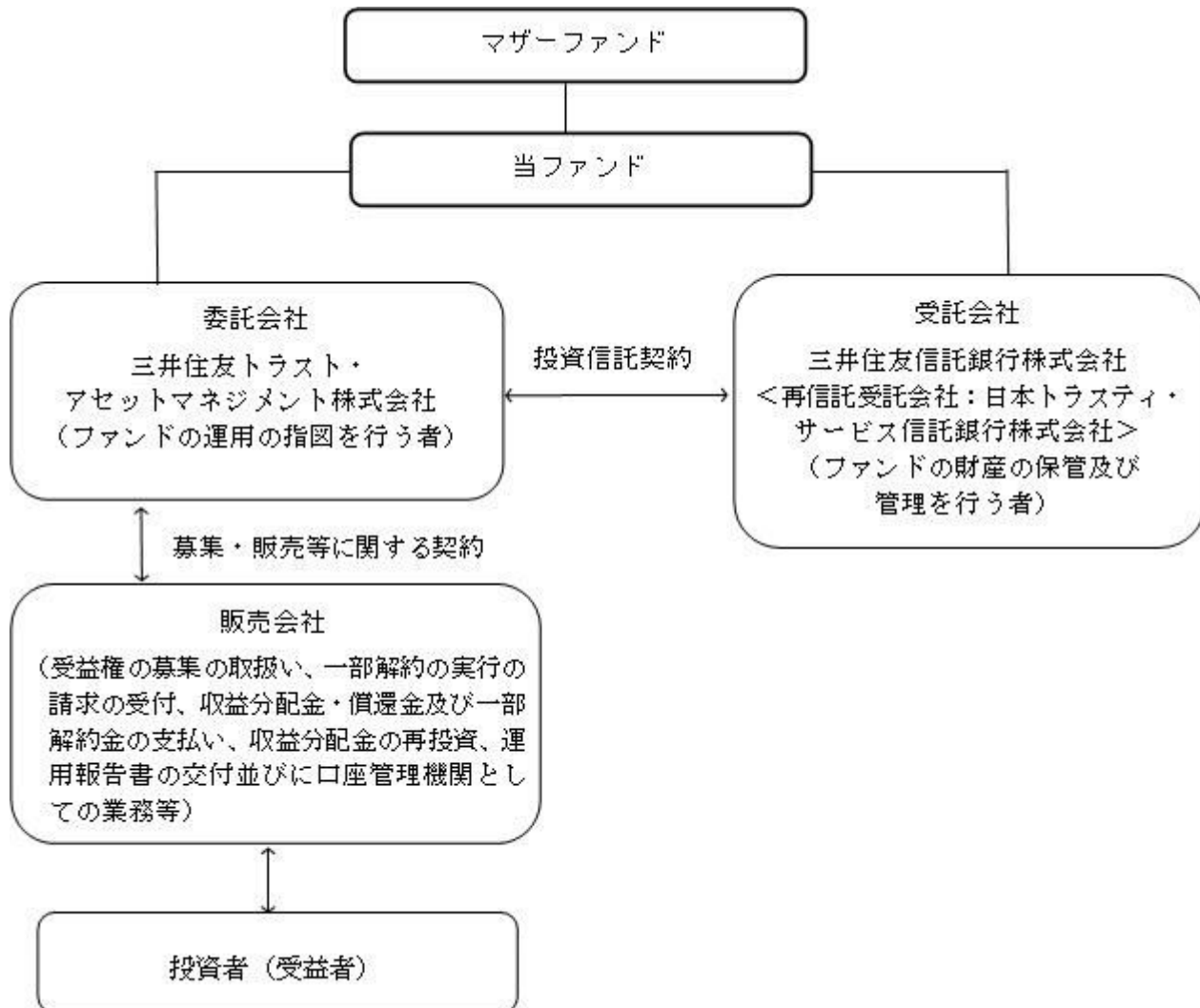
2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マ

ザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- | | |
|-------------|---|
| 1986年11月1日： | 住信キャピタルマネジメント株式会社設立 |
| 1987年2月20日： | 投資顧問業の登録 |
| 1987年9月9日： | 投資一任契約に係る業務の認可 |
| 1990年10月1日： | 住信投資顧問株式会社に商号変更 |
| 1999年2月15日： | 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 1999年3月25日： | 証券投資信託委託業の認可 |
| 2007年9月30日： | 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号） |
| 2012年4月1日： | 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2018年10月1日： | 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継 |

八．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
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	3,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式や外国の公社債等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本とします。
- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物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。
- F．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- H．国内において行われ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。）、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。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- I．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、異なった受取金利又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。）を行うことができます。
- J．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて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。

A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

- 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、後記（5）投資制限＜約款に定める投資制限＞J．、K．及びL．に定めるものに限りません。）
- 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、 「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（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。）に投資することを指図します。

- 1．株券又は新株引受権証書
- 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．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（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．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
- 9．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．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。）及び新株予約権証券
- 12．外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1．から11．までの証券又は証券の性質を有するもの
- 13．投資信託又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、振替受益権を含みます。）
- 14．投資証券又は外国投資証券（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。）
- 15．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。）
- 16．オプションを表示する証券又は証券（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。）
- 17．預託証券（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。）
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 19．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。）
- 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21．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

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1. の証券又は証書並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記1. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2. から6. までの証券並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13. の証券及び上記14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

A. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、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を指図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上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、株価指数先物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並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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場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、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又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を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式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、行いません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化を図るため、株価指数先物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並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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、

通貨に係るオプション取引を行うことができます。

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、異なった受取金利又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を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、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並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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行

われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

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、異なった受取金利又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を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において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。

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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

(4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

C．新株引受権証券等への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

D．同一銘柄の株式への投資割合

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

G．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所（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所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

I．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

J．先物取引等の運用指図

- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行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（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- K．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として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。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として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。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、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及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．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を超えないものとします。
- b．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を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係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。

- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 〇．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、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。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係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。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｐ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Ｑ．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、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。
- ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- Ｒ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｓ．再投資の指図
- 委託会社は、上記Ｒ．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- Ｔ．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は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わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、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又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、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- ウ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- ヴ．利害関係人等との取引等
- イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。））、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。
- 二．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。
- W．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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- X．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。
- < 関連法令に基づく投資制限 >
- イ．同一の法人の発行する株式への投資制限
（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数

に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本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、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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。

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及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。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、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小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

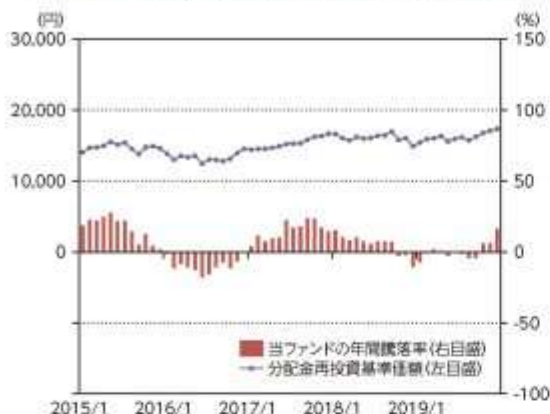
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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



*2015年1月～2019年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の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。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、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について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は運用に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動向を表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI マーケティング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI マーケティング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動向を表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募国債利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。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あり、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、損滅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等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index-EMEA マーケットグローバル・レバレッジ(円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成されていますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、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を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

支払先	純資産総額		主な役務	
	100億円以下の部分	100億円超の部分		
合計	年率0.66% (税抜0.6%) ()	年率0.55% (税抜0.5%)		
内訳 (純資産総額に対して)	委託会社	年率0.33% (税抜0.3%)	年率0.275% (税抜0.25%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
	販売会社	年率0.275% (税抜0.25%)	年率0.22% (税抜0.2%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年率0.055% (税抜0.05%)	年率0.055% (税抜0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。ご利用の場合、毎年、一定額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及び譲渡所得が一定期間非課税となります。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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を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、
- ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2019年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下は、2019年12月30日現在の状況について記載してあります。

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

（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	3,346,868,455	99.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,940,756	0.44

合計(純資産総額)	3,361,809,211	100.00
-----------	---------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(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	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	372,224,972	2.7060	1,007,240,775	3.0688	1,142,283,994	33.98
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	600,897,949	1.6561	995,147,094	1.8598	1,117,550,005	33.24
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	440,969,720	2.3923	1,054,931,862	2.4651	1,087,034,456	32.33

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.56
合計	99.56

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

【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】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期計算期間末	(2010年 6月10日)	1,596,924,893	1,596,924,893	7,467	7,467
第4期計算期間末	(2011年 6月10日)	1,894,852,177	1,894,852,177	7,723	7,723
第5期計算期間末	(2012年 6月11日)	1,957,886,772	1,957,886,772	7,323	7,323

第6期計算期間末	(2013年 6月10日)	2,447,708,994	2,452,312,536	10,634	10,654
第7期計算期間末	(2014年 6月10日)	2,498,609,731	2,502,660,953	12,335	12,355
第8期計算期間末	(2015年 6月10日)	3,184,301,741	3,188,483,833	15,228	15,248
第9期計算期間末	(2016年 6月10日)	2,877,411,328	2,877,411,328	13,131	13,131
第10期計算期間末	(2017年 6月12日)	3,275,045,188	3,275,045,188	14,905	14,905
第11期計算期間末	(2018年 6月11日)	3,448,836,583	3,448,836,583	16,204	16,204
第12期計算期間末	(2019年 6月10日)	3,163,412,591	3,163,412,591	15,823	15,823
	2018年12月末日	3,018,419,045		14,835	
	2019年 1月末日	3,108,370,770		15,351	
	2月末日	3,175,356,476		15,855	
	3月末日	3,189,698,098		15,958	
	4月末日	3,230,177,919		16,263	
	5月末日	3,083,919,108		15,515	
	6月末日	3,169,138,259		15,897	
	7月末日	3,199,391,635		16,097	
	8月末日	3,108,299,029		15,674	
	9月末日	3,202,051,331		16,161	
	10月末日	3,280,345,449		16,689	
	11月末日	3,324,682,231		16,996	
	12月末日	3,361,809,211		17,266	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2009年 6月11日～2010年 6月10日	0
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	0
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	0
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	20
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	20
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	20
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	0
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	0
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	0
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第3期計算期間	2009年 6月11日～2010年 6月10日	4.0
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	3.4
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	5.2

第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	45.5
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	16.2
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	23.6
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	13.8
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	13.5
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	8.7
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	2.4
第13期中間計算期間	2019年 6月11日～2019年12月10日	7.1

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第3期計算期間	2009年 6月11日～2010年 6月10日	816,801,713	364,200,118	2,138,716,184
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	586,983,066	272,034,617	2,453,664,633
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	487,758,083	267,858,897	2,673,563,819
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	407,062,229	778,854,935	2,301,771,113
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	366,034,410	642,194,197	2,025,611,326
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	355,749,941	290,314,770	2,091,046,497
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	331,285,768	230,971,419	2,191,360,846
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	259,687,608	253,825,441	2,197,223,013
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	217,108,019	285,901,685	2,128,429,347
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	164,740,715	293,882,676	1,999,287,386
第13期中間計算期間	2019年 6月11日～2019年12月10日	71,883,163	112,595,874	1,958,574,675

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

日本株式マザーファンド

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	247,351,092,310	99.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,313,104,763	0.93
合計(純資産総額)		249,664,197,073	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,288,930,000	0.92

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,134,700	6,845.39	7,767,471,792	7,714.00	8,753,075,800	3.51
日本	株式	ソニー	電気機器	643,700	5,474.39	3,523,871,129	7,401.00	4,764,023,700	1.91
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,913,200	576.25	3,983,742,380	593.20	4,100,910,240	1.64
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	792,800	4,002.84	3,173,452,057	4,756.00	3,770,556,800	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,335,600	2,308.18	3,082,808,938	2,757.00	3,682,249,200	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	847,200	4,456.51	3,775,558,613	4,332.00	3,670,070,400	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	92,300	27,726.50	2,559,156,824	38,490.00	3,552,627,000	1.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	720,300	3,935.19	2,834,518,718	4,038.00	2,908,571,400	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	697,000	2,957.36	2,061,285,603	4,099.00	2,857,003,000	1.14
日本	株式	任天堂	その他製品	62,400	34,777.63	2,170,124,360	43,970.00	2,743,728,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	801,700	3,218.76	2,580,485,907	3,099.00	2,484,468,300	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	744,700	2,733.92	2,035,951,896	3,253.00	2,422,509,100	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,646,200	175.74	2,398,205,330	168.30	2,296,655,460	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	489,300	3,585.48	1,754,378,014	4,626.00	2,263,501,800	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	738,100	2,654.24	1,959,096,381	3,038.00	2,242,347,800	0.90
日本	株式	花王	化学	243,800	7,717.14	1,881,440,624	9,025.00	2,200,295,000	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	359,100	5,379.62	1,931,822,251	6,119.00	2,197,332,900	0.88
日本	株式	HOYA	精密機器	203,300	6,583.72	1,338,471,377	10,450.00	2,124,485,000	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	291,400	4,065.56	1,184,706,520	7,228.00	2,106,239,200	0.84
日本	株式	信越化学工業	化学	171,200	8,826.28	1,511,059,469	12,060.00	2,064,672,000	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	703,700	3,101.40	2,182,459,894	2,900.00	2,040,730,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	299,200	4,804.08	1,437,383,019	6,746.00	2,018,403,200	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	129,700	12,059.75	1,564,149,606	15,450.00	2,003,865,000	0.80

日本	株式	ファナック	電気機器	96,800	18,407.97	1,781,891,830	20,330.00	1,967,944,000	0.79
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	84,700	23,306.81	1,974,087,574	22,000.00	1,863,400,000	0.75
日本	株式	日本電産	電気機器	122,600	12,683.06	1,554,943,197	15,005.00	1,839,613,000	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	701,400	2,021.39	1,417,807,036	2,534.50	1,777,698,300	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	179,200	10,051.96	1,801,311,548	9,858.00	1,766,553,600	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	881,400	1,792.64	1,580,039,970	1,946.00	1,715,204,400	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	895,700	1,579.82	1,415,050,406	1,870.00	1,674,959,000	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.76
		食料品	3.74
		繊維製品	0.59
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.07
		医薬品	5.96
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.59
		機械	5.06
		電気機器	14.26
		輸送用機器	7.64
		精密機器	2.35
		その他製品	2.31
		電気・ガス業	1.52
		陸運業	4.35
		海運業	0.18
		空運業	0.49
		倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.63		
卸売業	4.95		
小売業	4.59		
銀行業	5.84		
証券、商品先物取引業	0.82		

	保険業	2.29
	その他金融業	1.17
	不動産業	2.40
	サービス業	5.13
	小計	99.07
合計		99.07

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

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	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	133	円	2,297,708,000	2,288,930,000	0.92

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国株式マザーファンド

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	127,305,084,186	61.01
	イギリス	11,797,135,632	5.65
	フランス	7,472,836,114	3.58
	スイス	7,350,231,969	3.52
	カナダ	7,345,303,189	3.52
	ドイツ	6,212,301,306	2.98
	オーストラリア	4,426,386,699	2.12
	オランダ	3,771,266,466	1.81
	アイルランド	3,686,135,972	1.77
	スペイン	2,023,767,799	0.97
	スウェーデン	1,795,327,807	0.86
	香港	1,661,531,854	0.80

	イタリア	1,418,784,088	0.68
	デンマーク	1,330,986,195	0.64
	シンガポール	852,954,419	0.41
	フィンランド	803,584,461	0.39
	バミューダ	791,240,514	0.38
	ベルギー	708,864,154	0.34
	ジャージー	551,960,253	0.26
	ケイマン	472,946,053	0.23
	ノルウェー	456,913,083	0.22
	イスラエル	410,920,250	0.20
	キュラソー	272,659,781	0.13
	ニュージーランド	205,063,977	0.10
	ルクセンブルク	192,535,473	0.09
	オーストリア	167,710,441	0.08
	ポルトガル	125,125,602	0.06
	リベリア	109,747,160	0.05
	パナマ	103,009,584	0.05
	パプアニューギニア	29,948,607	0.01
	英ヴァージン諸島	27,840,908	0.01
	マン島	25,754,373	0.01
	小計	193,905,858,369	92.92
投資信託受益証券	オーストラリア	124,990,004	0.06
	香港	43,128,771	0.02
	小計	168,118,775	0.08
投資証券	アメリカ	4,246,481,281	2.03
	オーストラリア	348,870,697	0.17
	フランス	227,559,795	0.11
	イギリス	145,434,081	0.07
	香港	110,353,824	0.05
	シンガポール	102,138,192	0.05
	カナダ	53,121,835	0.03
	小計	5,233,959,705	2.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,369,471,097	4.49
合計(純資産総額)		208,677,407,946	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	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	17,309,919,052	8.30
	買建	カナダ	1,160,283,700	0.56
	買建	ドイツ	4,014,650,342	1.92
	買建	イギリス	1,676,306,970	0.80
	買建	オーストラリア	993,397,944	0.48

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		16,874,545,078	8.09

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	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	199,597	19,089.73	3,810,253,717	31,750.48	6,337,302,153	3.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	320,422	11,670.33	3,739,430,864	17,415.65	5,580,359,840	2.67
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	18,547	180,000.50	3,338,469,393	204,855.28	3,799,451,027	1.82

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・ 娯楽	106,065	18,709.56	1,984,429,608	22,799.43	2,418,222,179	1.16
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	141,125	11,367.94	1,604,301,323	15,244.17	2,151,334,677	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	13,787	122,278.82	1,685,858,097	148,113.06	2,042,034,874	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	13,229	123,126.81	1,628,844,633	148,414.35	1,963,373,547	0.94
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	116,552	14,564.90	1,697,568,970	15,968.36	1,861,145,460	0.89
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	76,057	15,555.32	1,183,091,643	20,749.56	1,578,149,924	0.76
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	130,829	9,836.12	1,286,850,267	11,959.36	1,564,631,110	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	110,504	10,793.85	1,192,763,733	13,814.42	1,526,548,712	0.73
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	389,444	3,147.65	1,225,836,834	3,872.94	1,508,295,582	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,149	22,552.92	1,311,430,094	24,775.89	1,440,693,716	0.69
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	186,821	8,226.86	1,536,950,287	7,657.14	1,430,516,121	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	322,610	3,250.64	1,048,690,648	4,299.13	1,386,943,749	0.66
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	41,839	29,470.54	1,233,018,107	32,426.47	1,356,691,212	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	39,857	23,692.35	944,305,994	32,949.07	1,313,251,258	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	195,474	5,459.37	1,067,165,830	6,582.36	1,286,681,177	0.62
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・ 娯楽	79,529	12,179.78	968,646,137	15,968.37	1,269,948,498	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信 サービス	182,585	5,900.90	1,077,416,118	6,741.22	1,230,846,895	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	48,344	20,237.92	978,382,159	24,099.91	1,165,086,204	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	113,011	8,494.18	959,936,544	10,024.73	1,132,905,892	0.54
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	83,797	13,015.72	1,090,678,959	13,180.06	1,104,450,158	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	30,914	30,170.40	932,687,993	35,658.90	1,102,359,235	0.53
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	184,760	5,392.54	996,326,282	5,907.47	1,091,465,118	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	179,295	5,406.78	969,409,696	6,064.14	1,087,271,057	0.52
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	244,114	4,619.04	1,127,574,674	4,307.89	1,051,618,505	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・ 娯楽	200,166	4,088.77	818,434,577	4,941.15	989,051,432	0.47
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	94,481	8,847.00	835,873,785	10,465.56	988,796,952	0.47

アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	188,907	5,201.90	982,676,985	5,233.68	988,679,014	0.47
------	----	---------------	--------------------	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.04
		素材	4.12
		資本財	6.70
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.08
		耐久消費財・アパレル	1.87
		消費者サービス	1.70
		メディア・娯楽	5.79
		小売	4.52
		食品・生活必需品小売り	1.44
		食品・飲料・タバコ	4.56
		家庭用品・パーソナル用品	1.97
		ヘルスケア機器・サービス	4.79
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.88
		銀行	7.45
		各種金融	4.23
		保険	3.64
		不動産	0.52
		ソフトウェア・サービス	9.25
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.55		
電気通信サービス	2.23		
公益事業	3.38		
半導体・半導体製造装置	3.23		
		小計	92.92
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.51
合計			95.51

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

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	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (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	S&P 500 EMIN	買建	976	アメリカドル	157,382,199.5	17,242,793,776	157,994,880	17,309,919,052	8.30
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	68	カナダドル	13,834,742	1,159,213,031	13,847,520	1,160,283,700	0.56
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	82	スイスフラン	8,652,814	972,576,294	8,714,140	979,469,336	0.47
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	657	ユーロ	24,680,926.5	3,024,400,733	24,768,900	3,035,181,006	1.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	77	オーストラリアドル	13,014,314	995,855,307	12,982,200	993,397,944	0.48
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	154	イギリスポンド	11,615,682.5	1,666,618,124	11,683,210	1,676,306,970	0.80

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	107,616,400.00	11,773,848,375	11,782,429,888	5.65
	カナダドル	買建	6,926,000.00	580,191,020	579,983,240	0.28
	ユーロ	買建	16,285,000.00	1,993,138,655	1,995,389,050	0.96
	イギリスポンド	買建	7,364,500.00	1,055,755,385	1,056,256,660	0.51
	スイスフラン	買建	4,766,000.00	535,746,060	535,746,060	0.26
	スウェーデンクローナ	買建	12,775,000.00	150,080,700	149,978,500	0.07
	ノルウェークローネ	買建	2,733,000.00	33,986,221	33,971,190	0.02
	デンマーククローネ	買建	6,035,000.00	98,980,035	98,974,000	0.05
	オーストラリアドル	買建	5,051,000.00	386,244,919	386,300,480	0.19
	ニュージーランドドル	買建	227,000.00	16,672,469	16,677,690	0.01
	香港ドル	買建	12,236,000.00	172,001,452	171,915,800	0.08
	シンガポールドル	買建	826,000.00	66,922,520	66,922,520	0.03

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

外国債券マザーファンド

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	60,497,979,977	47.21
	フランス	12,453,751,699	9.72
	イタリア	11,261,430,566	8.79
	イギリス	8,164,247,522	6.37
	ドイツ	7,998,440,908	6.24
	スペイン	7,099,425,062	5.54
	ベルギー	2,991,512,839	2.33
	オーストラリア	2,486,269,685	1.94
	カナダ	2,418,682,362	1.89
	オランダ	2,348,887,671	1.83
	オーストリア	1,761,120,374	1.37
	メキシコ	1,113,036,185	0.87
	アイルランド	889,146,644	0.69
	南アフリカ	776,184,291	0.61
	ポーランド	748,027,790	0.58
	フィンランド	708,875,943	0.55
	デンマーク	627,954,323	0.49
	マレーシア	587,839,100	0.46
	シンガポール	535,459,226	0.42
	スウェーデン	439,331,296	0.34
ノルウェー	307,701,718	0.24	
	小計	126,215,305,181	98.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,943,225,789	1.52
合計(純資産総額)		128,158,530,970	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	4,266,656,707	3.33
	買建	ドイツ	4,897,247,379	3.82

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		12,555,805,500	9.80

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	8,900,000	11,099.90	987,891,823	11,431.47	1,017,401,124	2.750	2024/2/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	8,500,000	10,672.14	907,132,115	10,908.92	927,258,496	1.250	2021/3/31	0.72
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	8,100,000	10,822.46	876,619,290	11,209.78	907,992,620	2.250	2024/1/31	0.71
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	10,122.19	840,141,888	10,761.70	893,221,285	1.500	2026/8/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2% 04/30/24	8,000,000	10,982.73	878,618,611	11,109.21	888,737,029	2.000	2024/4/30	0.69
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	6,910,000	11,190.50	773,263,568	12,522.36	865,295,464	3.000	2048/8/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,060,000	11,607.11	819,462,507	12,087.54	853,380,985	3.125	2028/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	10,671.01	773,648,504	11,188.81	811,189,088	2.125	2025/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,050,000	11,193.64	789,152,192	11,200.37	789,626,097	3.625	2021/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	6,850,000	9,882.31	676,938,372	11,341.17	776,870,273	2.500	2046/2/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	7,100,000	10,415.65	739,511,450	10,850.29	770,370,709	1.375	2023/9/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	10,865.03	727,957,070	11,295.80	756,819,085	2.375	2024/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	6,180,000	10,659.09	658,731,911	12,137.19	750,078,574	2.875	2045/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.75% 09/30/22	6,750,000	11,030.64	744,568,404	10,998.36	742,389,903	1.750	2022/9/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	10,725.04	697,128,039	11,264.56	732,196,754	2.250	2025/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	6,680,000	9,350.94	624,643,193	10,802.78	721,626,187	2.250	2046/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,746.82	698,543,830	11,085.24	720,541,030	2.000	2023/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	6,330,000	10,616.61	672,031,528	11,294.95	714,970,414	2.250	2027/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	6,250,000	11,102.74	693,921,405	11,180.89	698,806,096	3.125	2021/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3% 10/31/25	5,950,000	11,234.64	668,461,660	11,719.92	697,335,489	3.000	2025/10/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,611.86	642,018,046	11,120.76	672,806,460	2.000	2025/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 05/15/21	6,000,000	10,982.29	658,937,664	11,106.64	666,398,700	2.625	2021/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 01/31/21	6,000,000	10,874.15	652,449,521	11,013.77	660,826,549	2.125	2021/1/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	10,570.34	613,080,231	10,956.42	635,472,820	1.625	2023/4/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	11,391.59	614,007,239	11,652.73	628,082,315	2.625	2029/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	10,272.58	590,673,737	10,869.55	624,999,146	1.625	2026/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	10,758.88	591,738,699	11,078.39	609,311,951	2.000	2022/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/45	5,350,000	9,917.54	530,588,649	11,330.90	606,203,183	2.500	2045/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 05/31/21	5,500,000	10,829.78	595,638,279	11,015.91	605,875,359	2.000	2021/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	10,597.73	557,441,061	11,297.51	594,249,505	2.250	2027/11/15	0.46

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.48
合計	98.48

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

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	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	143	アメリカドル	16,971,720.47	1,859,421,695	16,967,843.75	1,858,996,961	1.45
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	83	アメリカドル	10,684,973.03	1,170,645,645	10,678,468.75	1,169,933,036	0.91
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	72	アメリカドル	11,308,288	1,238,936,033	11,297,250	1,237,726,710	0.97
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	63	ユーロ	7,054,167	864,417,624	7,053,480	864,333,439	0.67
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	74	ユーロ	9,917,816	1,215,329,172	9,915,260	1,215,015,960	0.95
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	134	ユーロ	23,009,406	2,819,572,612	22,995,740	2,817,897,980	2.20

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	57,640,000.00	6,304,521,954	6,307,545,200	4.92
	カナダドル	買建	5,970,000.00	499,336,120	499,689,000	0.39
	ユーロ	買建	40,190,000.00	4,922,191,288	4,924,078,800	3.84
	イギリスポンド	買建	5,750,000.00	824,401,950	824,492,500	0.64

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2008年3月3日
作成基準日：2019年12月30日

基準価額・純資産の推移



基準価額 17,266円

純資産総額 33.62億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年6月	20円
2016年6月	0円
2017年6月	0円
2018年6月	0円
2019年6月	0円
設定来 分配金合計額	60円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 マザーファンド	34.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア機器	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.9%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.6%
		FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	メディア/娯楽	-	-	0.4%
日本株式 マザーファンド	33.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%
外国債券 マザーファンド	32.3%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.3%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.2%
		T 2.25% 01/31/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/01/31	0.2%
		T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録

を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎるの受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日

に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記〈解約価額〉の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）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。ただし、便宜上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。

<基準価額の算出頻度>

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。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式、国内上場投信の評価方法

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みません。）の評価方法

原則として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（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

公社債等の評価方法

計算日（ ）における次のa. からc. までに掲げるいずれかの価額で評価します。

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

外貨建資産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電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（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。（2008年 3月 3日設定）

ただし、下記「(5)その他 < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2008年3月3日から2008年6月10日までとします。なお、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、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資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あって、上記からまでの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及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。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写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)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2018年6月12日から2019年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (2018年 6月11日現在)	第12期 (2019年 6月10日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	166,252	-
コール・ローン	10,277,131	14,165,514
親投資信託受益証券	3,438,358,570	3,149,458,046
未収入金	12,154,045	10,796,797
流動資産合計	3,460,955,998	3,174,420,357
資産合計		
	3,460,955,998	3,174,420,357
負債の部		
流動負債		
未払解約金	960,096	799,999
未払受託者報酬	922,254	843,628
未払委託者報酬	10,144,744	9,279,807
未払利息	27	29
その他未払費用	92,294	84,303
流動負債合計	12,119,415	11,007,766
負債合計		
	12,119,415	11,007,766
純資産の部		
元本等		
元本	2,128,429,347	1,999,287,386
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,320,407,236	1,164,125,205
(分配準備積立金)	1,092,511,120	1,001,178,408
元本等合計	3,448,836,583	3,163,412,591
純資産合計		
	3,448,836,583	3,163,412,591
負債純資産合計		
	3,460,955,998	3,174,420,357

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自 2017年 6月13日	至 2018年 6月11日	自 2018年 6月12日	至 2019年 6月10日
営業収益				
受取利息		6		6
有価証券売買等損益		306,156,059		59,695,827
営業収益合計		306,156,065		59,695,821
営業費用				
支払利息		7,009		12,995
受託者報酬		1,842,410		1,768,544
委託者報酬		20,266,455		19,453,812
その他費用		184,343		177,519
営業費用合計		22,300,217		21,412,870
営業利益又は営業損失（ ）		283,855,848		81,108,691
経常利益又は経常損失（ ）		283,855,848		81,108,691
当期純利益又は当期純損失（ ）		283,855,848		81,108,691
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（ ）		28,915,089		8,893,779
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,077,822,175		1,320,407,236
剰余金増加額又は欠損金減少額		128,285,626		97,270,168
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		128,285,626		97,270,168
剰余金減少額又は欠損金増加額		140,641,324		181,337,287
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		140,641,324		181,337,287
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,320,407,236		1,164,125,205

(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、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は2018年6月12日から2019年6月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 (2018年6月11日現在)	第12期 (2019年6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,128,429,347口	1,999,287,386口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6204円 (16,204円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5823円 (15,823円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2017年6月13日 至 2018年6月11日			第12期 自 2018年6月12日 至 2019年6月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	68,592,421円	費用控除後の配当等収益額	A	52,982,467円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	87,408,434円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円
収益調整金額	C	739,309,472円	収益調整金額	C	773,670,570円
分配準備積立金額	D	936,510,265円	分配準備積立金額	D	948,195,941円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,831,820,592円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,774,848,978円
当ファンドの期末残存口数	F	2,128,429,347口	当ファンドの期末残存口数	F	1,999,287,386口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,606円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,877円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2019年 6月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.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)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.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。

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 2017年 6月13日 至 2018年 6月11日	自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,197,223,013円	2,128,429,347円
期中追加設定元本額	217,108,019円	164,740,715円
期中一部解約元本額	285,901,685円	293,882,676円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2018年 6月11日現在)	第12期 (2019年 6月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	275,243,457	59,702,150
合計	275,243,457	59,702,150

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（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

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	626,461,411	1,037,294,804	
	外国株式マザーファンド	390,804,450	1,057,243,278	
	外国債券マザーファンド	441,259,867	1,054,919,964	
合計		1,458,525,728	3,149,458,046	

(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。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,790,990,437
株式	214,938,460,270
派生商品評価勘定	62,118,590
未収入金	3,776,648
未収配当金	1,841,083,772
差入委託証拠金	186,068,990
流動資産合計	220,822,498,707
資産合計	220,822,498,707
負債の部	
流動負債	
前受金	62,119,670
未払金	1,536,044,154
未払解約金	81,322,145
未払利息	7,877
流動負債合計	1,679,493,846
負債合計	1,679,493,846
純資産の部	
元本等	

	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
元本	132,345,809,414
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,797,195,447
元本等合計	219,143,004,861
純資産合計	219,143,004,861
負債純資産合計	220,822,498,707

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,345,809,414口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.6558円 (1万口当たり純資産額) (16,558円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 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)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2019年 6月10日現在
3. 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>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	129,367,405,550円
期中追加設定元本額	14,640,879,020円
期中一部解約元本額	11,662,475,156円
期末元本額	132,345,809,414円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	766,845,043円
D C日本株式インデックスファンド	337,939,625円
D C日本株式インデックスファンドL	54,033,556,114円
D C日本株式インデックスファンドA	1,159,641,024円
D Cバランスファンド3 0	2,256,907,136円
D Cバランスファンド5 0	3,320,276,534円
D Cバランスファンド7 0	1,722,156,510円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	626,461,411円
日本株式インデックスe	1,843,536,889円
インデックスコレクション（国内株式）	11,314,665,537円

区分	2019年 6月10日現在
インデックスコレクション(バランス株式30)	7,007,941,702円
インデックスコレクション(バランス株式50)	2,018,413,712円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,522,098,537円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,419,721,367円
日本株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	2,321,311,623円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,633,193,238円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	133,002,469円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,298,533,728円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	136,026,483円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	762,400,875円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	4,591,192円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	872,495,546円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,405,093,695円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	656,020,951円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	11,170,191,368円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	893,271,764円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	164,080,278円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,816,946,872円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	49,246,562円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	224,185,127円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,789,637,661円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	86,740,581円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	86,289,562円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	15,142,406円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,307,642,385円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	973,149,943円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	28,628,062円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	471,607,880円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	7,295,140,373円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	130,051,529円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	65,481,974円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	11,933,163円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	189,394,040円
私募日本株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	4,216,943円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	512,407,592
合計	512,407,592

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,110,070,330	-	4,172,190,000	62,119,670
合計		4,110,070,330	-	4,172,190,000	62,119,670

(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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,300	2,667.00	11,468,100	
日本水産	130,900	654.00	85,608,600	
マルハニチロ	18,900	3,255.00	61,519,500	
カネコ種苗	4,000	1,284.00	5,136,000	
サカタのタネ	15,900	3,385.00	53,821,500	
ホクト	11,000	1,815.00	19,965,000	
ホクリヨウ	1,800	610.00	1,098,000	
住石ホールディングス	28,300	118.00	3,339,400	
日鉄鉱業	3,000	4,260.00	12,780,000	
三井松島ホールディングス	5,500	1,261.00	6,935,500	
国際石油開発帝石	525,200	898.70	471,997,240	
石油資源開発	18,800	2,340.00	43,992,000	
K&Oエナジーグループ	6,400	1,682.00	10,764,800	
ヒノキヤグループ	3,700	2,165.00	8,010,500	
ショーボンドホールディングス	9,300	7,830.00	72,819,000	
ミライト・ホールディングス	36,800	1,698.00	62,486,400	
タマホーム	6,300	1,001.00	6,306,300	

サンヨーホームズ	1,900	663.00	1,259,700	
日本アクア	4,200	467.00	1,961,400	
ファーストコーポレーション	4,000	777.00	3,108,000	
ベステラ	2,500	1,377.00	3,442,500	
TATERU	15,900	235.00	3,736,500	
スペースバリューホールディングス	16,000	511.00	8,176,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,500	620.00	1,550,000	
第一カッター興業	1,600	1,805.00	2,888,000	
安藤・間	84,600	762.00	64,465,200	
東急建設	39,000	774.00	30,186,000	
コムシスホールディングス	46,400	2,700.00	125,280,000	
ミサワホーム	10,800	1,020.00	11,016,000	
ピーアールホールディングス	14,300	336.00	4,804,800	
高松コンストラクショングループ	8,300	2,324.00	19,289,200	
東建コーポレーション	4,100	6,730.00	27,593,000	
ソネック	1,400	774.00	1,083,600	
ヤマウラ	5,600	851.00	4,765,600	
大成建設	107,600	4,145.00	446,002,000	
大林組	324,400	1,073.00	348,081,200	
清水建設	330,900	928.00	307,075,200	
飛鳥建設	9,600	1,325.00	12,720,000	
長谷工コーポレーション	135,500	1,127.00	152,708,500	
松井建設	12,700	651.00	8,267,700	
銭高組	1,300	4,590.00	5,967,000	
鹿島建設	253,500	1,545.00	391,657,500	
不動テトラ	7,800	1,365.00	10,647,000	
大末建設	4,400	958.00	4,215,200	
鉄建建設	6,700	3,000.00	20,100,000	
西松建設	23,500	2,146.00	50,431,000	
三井住友建設	77,900	621.00	48,375,900	
大豊建設	7,500	2,814.00	21,105,000	
前田建設工業	77,500	915.00	70,912,500	
佐田建設	8,300	373.00	3,095,900	
ナカノフドー建設	9,400	453.00	4,258,200	
奥村組	17,900	3,450.00	61,755,000	
東鉄工業	13,000	3,085.00	40,105,000	
イチケン	2,200	1,691.00	3,720,200	
富士ピー・エス	4,500	456.00	2,052,000	
浅沼組	4,000	3,560.00	14,240,000	
戸田建設	126,300	622.00	78,558,600	
熊谷組	15,600	3,050.00	47,580,000	
青木あすなろ建設	5,900	834.00	4,920,600	

北野建設	2,400	2,716.00	6,518,400
植木組	1,600	2,158.00	3,452,800
矢作建設工業	14,700	737.00	10,833,900
ピーエス三菱	12,200	616.00	7,515,200
日本ハウスホールディングス	20,600	421.00	8,672,600
大東建託	38,500	14,350.00	552,475,000
新日本建設	13,400	956.00	12,810,400
N I P P O	28,600	2,210.00	63,206,000
東亜道路工業	2,000	3,045.00	6,090,000
前田道路	33,800	2,290.00	77,402,000
日本道路	2,900	6,390.00	18,531,000
東亜建設工業	9,400	1,506.00	14,156,400
日本国土開発	17,600	538.00	9,468,800
若築建設	5,400	1,390.00	7,506,000
東洋建設	39,500	422.00	16,669,000
五洋建設	128,400	518.00	66,511,200
世紀東急工業	15,700	614.00	9,639,800
福田組	3,600	4,380.00	15,768,000
住友林業	76,900	1,278.00	98,278,200
日本基礎技術	11,100	370.00	4,107,000
巴コーポレーション	14,800	363.00	5,372,400
大和ハウス工業	299,200	3,388.00	1,013,689,600
ライト工業	20,800	1,414.00	29,411,200
積水ハウス	331,000	1,783.00	590,173,000
日特建設	9,200	594.00	5,464,800
北陸電気工事	5,300	862.00	4,568,600
ユアテック	17,300	773.00	13,372,900
四電工	1,600	2,725.00	4,360,000
中電工	13,900	2,285.00	31,761,500
関電工	49,200	906.00	44,575,200
きんでん	71,800	1,736.00	124,644,800
東京エネシス	11,200	941.00	10,539,200
トーエネック	3,000	3,040.00	9,120,000
住友電設	7,500	1,800.00	13,500,000
日本電設工業	18,400	2,379.00	43,773,600
協和エクシオ	42,300	2,628.00	111,164,400
新日本空調	9,300	1,769.00	16,451,700
九電工	21,300	3,210.00	68,373,000
三機工業	24,800	1,256.00	31,148,800
日揮	93,400	1,440.00	134,496,000
中外炉工業	3,300	1,693.00	5,586,900
ヤマト	10,600	573.00	6,073,800

太平電業	7,300	2,155.00	15,731,500
高砂熱学工業	26,500	1,743.00	46,189,500
三晃金属工業	1,500	2,530.00	3,795,000
朝日工業社	2,400	2,507.00	6,016,800
明星工業	19,600	662.00	12,975,200
大気社	14,800	3,365.00	49,802,000
ダイダン	7,400	2,276.00	16,842,400
日比谷総合設備	9,700	1,861.00	18,051,700
東芝プラントシステム	23,600	2,120.00	50,032,000
OSJBホールディングス	47,700	276.00	13,165,200
東洋エンジニアリング	12,700	481.00	6,108,700
新興プランテック	19,400	1,330.00	25,802,000
日本製粉	30,700	1,809.00	55,536,300
日清製粉グループ本社	109,300	2,523.00	275,763,900
日東富士製粉	700	5,490.00	3,843,000
昭和産業	8,900	3,080.00	27,412,000
鳥越製粉	8,600	786.00	6,759,600
中部飼料	11,800	1,197.00	14,124,600
フィード・ワン	65,000	174.00	11,310,000
東洋精糖	1,500	994.00	1,491,000
日本甜菜製糖	5,500	1,930.00	10,615,000
三井製糖	7,600	2,422.00	18,407,200
塩水港精糖	10,500	209.00	2,194,500
日新製糖	4,600	1,850.00	8,510,000
森永製菓	24,300	5,000.00	121,500,000
中村屋	2,500	4,325.00	10,812,500
江崎グリコ	29,100	5,030.00	146,373,000
名糖産業	4,700	1,446.00	6,796,200
井村屋グループ	4,100	2,136.00	8,757,600
不二家	5,400	1,978.00	10,681,200
山崎製パン	79,100	1,638.00	129,565,800
第一屋製パン	1,700	1,010.00	1,717,000
モロゾフ	1,600	5,030.00	8,048,000
亀田製菓	6,000	4,970.00	29,820,000
寿スピリッツ	10,200	5,320.00	54,264,000
カルビー	44,100	3,090.00	136,269,000
森永乳業	19,400	3,925.00	76,145,000
六甲バター	7,100	2,012.00	14,285,200
ヤクルト本社	71,700	6,450.00	462,465,000
明治ホールディングス	68,500	7,620.00	521,970,000
雪印メグミルク	23,300	2,272.00	52,937,600
プリマハム	13,600	2,062.00	28,043,200

日本ハム	40,100	4,620.00	185,262,000
林兼産業	3,200	615.00	1,968,000
丸大食品	10,300	1,955.00	20,136,500
S Foods	8,700	3,690.00	32,103,000
伊藤ハム米久ホールディングス	62,300	650.00	40,495,000
サッポロホールディングス	35,400	2,308.00	81,703,200
アサヒグループホールディングス	202,600	4,927.00	998,210,200
キリンホールディングス	437,700	2,313.50	1,012,618,950
宝ホールディングス	72,400	1,154.00	83,549,600
オエノンホールディングス	27,500	366.00	10,065,000
養命酒製造	3,000	2,046.00	6,138,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74,100	2,725.00	201,922,500
サントリー食品インターナショナル	64,700	4,550.00	294,385,000
ダイドーグループホールディングス	5,500	4,595.00	25,272,500
伊藤園	29,400	5,330.00	156,702,000
キーコーヒー	9,500	2,127.00	20,206,500
ユニカフェ	2,700	990.00	2,673,000
ジャパンフーズ	1,400	1,197.00	1,675,800
日清オイリオグループ	12,500	3,250.00	40,625,000
不二製油グループ本社	23,600	3,210.00	75,756,000
かどや製油	1,100	4,140.00	4,554,000
J - オイルミルズ	5,000	4,170.00	20,850,000
キッコーマン	63,800	4,650.00	296,670,000
味の素	213,700	1,891.50	404,213,550
キューピー	53,900	2,465.00	132,863,500
ハウス食品グループ本社	36,400	4,395.00	159,978,000
カゴメ	38,800	2,525.00	97,970,000
焼津水産化学工業	4,700	1,116.00	5,245,200
アリアケジャパン	8,800	7,100.00	62,480,000
ピエトロ	1,300	1,618.00	2,103,400
エバラ食品工業	2,300	2,194.00	5,046,200
ニチレイ	50,300	2,700.00	135,810,000
東洋水産	49,800	4,380.00	218,124,000
イトアンド	3,300	1,655.00	5,461,500
大冷	1,100	1,817.00	1,998,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,600	885.00	2,301,000
日清食品ホールディングス	41,100	6,670.00	274,137,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,245.00	11,674,000
一正蒲鉾	3,800	1,130.00	4,294,000
フジッコ	10,500	2,144.00	22,512,000
ロック・フィールド	10,400	1,517.00	15,776,800
日本たばこ産業	558,600	2,514.00	1,404,320,400

ケンコーマヨネーズ	5,400	2,328.00	12,571,200
わらべや日洋ホールディングス	6,300	1,677.00	10,565,100
なとり	5,400	1,590.00	8,586,000
イフジ産業	1,700	664.00	1,128,800
ピクルスコーポレーション	2,300	1,906.00	4,383,800
北の達人コーポレーション	38,000	608.00	23,104,000
ユーグレナ	41,300	889.00	36,715,700
ミヨシ油脂	3,700	1,120.00	4,144,000
理研ビタミン	4,600	3,495.00	16,077,000
片倉工業	11,700	1,299.00	15,198,300
ゲンゼ	6,400	4,865.00	31,136,000
東洋紡	40,000	1,243.00	49,720,000
ユニチカ	27,900	375.00	10,462,500
富士紡ホールディングス	4,900	2,330.00	11,417,000
倉敷紡績	9,100	1,959.00	17,826,900
シキボウ	4,900	926.00	4,537,400
日本毛織	31,200	871.00	27,175,200
トーア紡コーポレーション	4,000	455.00	1,820,000
帝国繊維	10,600	2,290.00	24,274,000
帝人	77,100	1,824.00	140,630,400
東レ	732,500	810.80	593,911,000
サカイオーベックス	2,400	1,690.00	4,056,000
住江織物	2,800	2,995.00	8,386,000
日本フェルト	5,600	472.00	2,643,200
イチカワ	1,400	1,428.00	1,999,200
日東製網	1,100	1,383.00	1,521,300
アツギ	7,900	922.00	7,283,800
ダイニック	3,800	765.00	2,907,000
セーレン	23,300	1,492.00	34,763,600
ソトー	3,800	977.00	3,712,600
東海染工	1,400	1,122.00	1,570,800
小松マテーレ	15,600	805.00	12,558,000
ワコールホールディングス	27,500	2,840.00	78,100,000
ホギメディカル	11,800	3,465.00	40,887,000
レナウン	27,400	101.00	2,767,400
クラウディアホールディングス	2,500	504.00	1,260,000
T S Iホールディングス	35,000	662.00	23,170,000
マツオカコーポレーション	3,000	2,698.00	8,094,000
ワールド	12,400	2,196.00	27,230,400
三陽商会	5,700	1,645.00	9,376,500
ナイガイ	3,600	494.00	1,778,400
オンワードホールディングス	56,900	602.00	34,253,800

ルックホールディングス	3,500	1,349.00	4,721,500	
ゴールドウイン	8,600	13,910.00	119,626,000	
デサント	23,100	1,907.00	44,051,700	
キング	5,200	644.00	3,348,800	
ヤマトインターナショナル	6,400	418.00	2,675,200	
特種東海製紙	6,000	3,775.00	22,650,000	
王子ホールディングス	425,000	583.00	247,775,000	
日本製紙	45,200	1,872.00	84,614,400	
三菱製紙	15,400	583.00	8,978,200	
北越コーポレーション	62,600	560.00	35,056,000	
中越パルプ工業	4,000	1,483.00	5,932,000	
巴川製紙所	3,100	952.00	2,951,200	
大王製紙	46,000	1,260.00	57,960,000	
阿波製紙	2,400	443.00	1,063,200	
レンゴー	97,300	857.00	83,386,100	
トモク	5,800	1,752.00	10,161,600	
ザ・パック	7,100	3,070.00	21,797,000	
クラレ	159,300	1,308.00	208,364,400	
旭化成	671,600	1,160.50	779,391,800	
共和レザー	6,000	806.00	4,836,000	
昭和電工	62,700	3,170.00	198,759,000	
住友化学	743,100	486.00	361,146,600	
住友精化	4,600	3,385.00	15,571,000	
日産化学	58,000	4,710.00	273,180,000	
ラサ工業	3,300	1,348.00	4,448,400	
クレハ	8,700	7,450.00	64,815,000	
多木化学	2,800	4,445.00	12,446,000	
テイカ	7,700	2,414.00	18,587,800	
石原産業	18,100	1,181.00	21,376,100	
片倉コープアグリ	2,700	1,111.00	2,999,700	
日東エフシー	6,600	1,198.00	7,906,800	
日本曹達	14,900	2,712.00	40,408,800	
東ソー	145,900	1,417.00	206,740,300	
トクヤマ	27,200	2,532.00	68,870,400	
セントラル硝子	20,600	2,414.00	49,728,400	
東亜合成	59,300	1,231.00	72,998,300	
大阪ソーダ	10,200	2,738.00	27,927,600	
関東電化工業	22,400	749.00	16,777,600	
デンカ	37,100	3,170.00	117,607,000	
信越化学工業	166,400	9,316.00	1,550,182,400	
日本カーバイド工業	3,200	1,323.00	4,233,600	
堺化学工業	6,300	2,628.00	16,556,400	

第一稀元素化学工業	10,300	847.00	8,724,100
エア・ウォーター	77,300	1,730.00	133,729,000
大陽日酸	77,800	2,162.00	168,203,600
日本化学工業	3,200	1,839.00	5,884,800
東邦アセチレン	1,500	1,338.00	2,007,000
日本パーカラライジング	51,600	1,288.00	66,460,800
高压ガス工業	15,000	836.00	12,540,000
チタン工業	1,200	2,870.00	3,444,000
四国化成工業	15,900	1,083.00	17,219,700
戸田工業	2,000	2,209.00	4,418,000
ステラ ケミファ	5,500	3,070.00	16,885,000
保土谷化学工業	3,300	2,682.00	8,850,600
日本触媒	15,900	6,880.00	109,392,000
大日精化工業	7,800	3,050.00	23,790,000
カネカ	24,800	3,940.00	97,712,000
三菱瓦斯化学	97,100	1,411.00	137,008,100
三井化学	85,700	2,575.00	220,677,500
J S R	94,700	1,630.00	154,361,000
東京応化工業	16,200	3,360.00	54,432,000
大阪有機化学工業	8,800	993.00	8,738,400
三菱ケミカルホールディングス	631,200	742.60	468,729,120
K Hネオケム	14,400	2,840.00	40,896,000
ダイセル	139,100	985.00	137,013,500
住友ベークライト	16,300	3,870.00	63,081,000
積水化学工業	206,400	1,622.00	334,780,800
日本ゼオン	85,100	1,139.00	96,928,900
アイカ工業	28,300	3,730.00	105,559,000
宇部興産	47,700	2,173.00	103,652,100
積水樹脂	15,600	2,120.00	33,072,000
タキロンシーアイ	20,400	656.00	13,382,400
旭有機材	6,500	1,388.00	9,022,000
日立化成	43,700	3,090.00	135,033,000
ニチバン	5,000	2,425.00	12,125,000
リケンテクノス	25,700	496.00	12,747,200
大倉工業	4,800	1,733.00	8,318,400
積水化成品工業	14,100	740.00	10,434,000
群栄化学工業	2,400	2,526.00	6,062,400
タイガースポリマー	5,100	589.00	3,003,900
ミライアル	2,800	1,175.00	3,290,000
ダイキアクシス	3,400	858.00	2,917,200
ダイキョーニシカワ	20,000	850.00	17,000,000
竹本容器	3,400	1,159.00	3,940,600

森六ホールディングス	5,100	2,492.00	12,709,200
日本化薬	60,100	1,290.00	77,529,000
カーリットホールディングス	10,200	666.00	6,793,200
日本精化	7,600	1,301.00	9,887,600
扶桑化学工業	9,600	2,089.00	20,054,400
トリケミカル研究所	2,100	4,615.00	9,691,500
A D E K A	46,500	1,615.00	75,097,500
日油	35,900	4,000.00	143,600,000
新日本理化	17,100	201.00	3,437,100
ハリマ化成グループ	7,900	1,012.00	7,994,800
花王	234,000	8,641.00	2,021,994,000
第一工業製薬	3,500	3,385.00	11,847,500
石原ケミカル	2,400	1,567.00	3,760,800
日華化学	3,200	861.00	2,755,200
ニイタカ	1,500	1,433.00	2,149,500
三洋化成工業	6,300	5,840.00	36,792,000
有機合成薬品工業	7,500	225.00	1,687,500
大日本塗料	10,700	1,030.00	11,021,000
日本ペイントホールディングス	77,900	4,355.00	339,254,500
関西ペイント	106,100	2,159.00	229,069,900
神東塗料	7,700	170.00	1,309,000
中国塗料	31,000	972.00	30,132,000
日本特殊塗料	7,100	1,245.00	8,839,500
藤倉化成	12,700	590.00	7,493,000
太陽ホールディングス	7,800	3,320.00	25,896,000
D I C	42,700	2,785.00	118,919,500
サカタインクス	20,600	981.00	20,208,600
東洋インキＳＣホールディングス	20,000	2,375.00	47,500,000
T & K T O K A	7,400	972.00	7,192,800
富士フイルムホールディングス	200,200	5,381.00	1,077,276,200
資生堂	191,500	8,358.00	1,600,557,000
ライオン	134,300	2,139.00	287,267,700
高砂香料工業	6,600	3,025.00	19,965,000
マンダム	21,700	2,671.00	57,960,700
ミルボン	11,900	5,460.00	64,974,000
ファンケル	42,900	2,981.00	127,884,900
コーセー	16,300	17,910.00	291,933,000
コタ	5,100	1,197.00	6,104,700
シーボン	1,200	2,405.00	2,886,000
ポーラ・オルビスホールディングス	41,200	3,135.00	129,162,000
ノエビアホールディングス	9,200	6,100.00	56,120,000
アジュバンコスメジャパン	2,200	929.00	2,043,800

エステー	6,900	1,728.00	11,923,200
アグロ カネショウ	3,900	2,101.00	8,193,900
コニシ	17,100	1,607.00	27,479,700
長谷川香料	12,800	1,850.00	23,680,000
星光P M C	6,500	736.00	4,784,000
小林製薬	27,000	8,160.00	220,320,000
荒川化学工業	8,700	1,268.00	11,031,600
メック	6,700	1,073.00	7,189,100
日本高純度化学	2,700	2,358.00	6,366,600
タカラバイオ	25,200	2,012.00	50,702,400
J C U	12,500	2,050.00	25,625,000
新田ゼラチン	6,100	706.00	4,306,600
O A T アグリオ	1,400	1,357.00	1,899,800
デクセリアルズ	24,900	712.00	17,728,800
アース製薬	7,300	5,000.00	36,500,000
北興化学工業	9,900	495.00	4,900,500
大成ラミック	3,200	2,793.00	8,937,600
クミアイ化学工業	39,900	712.00	28,408,800
日本農薬	22,900	410.00	9,389,000
アキレス	7,000	1,981.00	13,867,000
有沢製作所	15,200	843.00	12,813,600
日東電工	66,500	5,076.00	337,554,000
レック	10,300	1,230.00	12,669,000
三光合成	11,200	318.00	3,561,600
きもと	16,700	159.00	2,655,300
藤森工業	8,700	2,963.00	25,778,100
前澤化成工業	6,600	1,110.00	7,326,000
未来工業	5,200	2,154.00	11,200,800
ウェーブロックホールディングス	2,700	659.00	1,779,300
J S P	5,700	2,115.00	12,055,500
エフピコ	10,600	6,700.00	71,020,000
天馬	6,700	1,770.00	11,859,000
信越ポリマー	17,300	806.00	13,943,800
東リ	24,300	252.00	6,123,600
ニフコ	38,600	2,867.00	110,666,200
バルカー	7,800	2,200.00	17,160,000
ユニ・チャーム	204,400	3,335.00	681,674,000
ショーエイコーポレーション	800	748.00	598,400
協和発酵キリン	113,100	2,020.00	228,462,000
武田薬品工業	841,600	3,775.00	3,177,040,000
アステラス製薬	888,800	1,513.00	1,344,754,400
大日本住友製薬	71,400	2,090.00	149,226,000

塩野義製薬	123,200	6,073.00	748,193,600
田辺三菱製薬	100,800	1,290.00	130,032,000
わかもと製薬	11,500	268.00	3,082,000
あすか製薬	11,900	1,203.00	14,315,700
日本新薬	25,200	8,110.00	204,372,000
バイオフェルミン製薬	1,600	2,290.00	3,664,000
中外製薬	100,500	7,170.00	720,585,000
科研製薬	17,400	5,360.00	93,264,000
エーザイ	115,400	6,316.00	728,866,400
ロート製薬	49,400	3,000.00	148,200,000
小野薬品工業	227,700	1,968.50	448,227,450
久光製薬	28,500	4,580.00	130,530,000
持田製薬	14,600	4,980.00	72,708,000
参天製薬	179,500	1,604.00	287,918,000
扶桑薬品工業	3,400	2,064.00	7,017,600
日本ケミファ	1,300	2,943.00	3,825,900
ツムラ	29,900	3,125.00	93,437,500
日医工	25,400	1,215.00	30,861,000
キッセイ薬品工業	17,100	2,676.00	45,759,600
生化学工業	18,700	1,249.00	23,356,300
栄研化学	16,900	1,837.00	31,045,300
日水製薬	4,000	1,202.00	4,808,000
鳥居薬品	5,200	2,294.00	11,928,800
JCRファーマ	6,800	6,590.00	44,812,000
東和薬品	13,900	2,766.00	38,447,400
富士製薬工業	6,500	1,430.00	9,295,000
沢井製薬	19,800	5,940.00	117,612,000
ゼリア新薬工業	19,100	2,135.00	40,778,500
第一三共	275,800	6,150.00	1,696,170,000
キョーリン製薬ホールディングス	21,300	1,968.00	41,918,400
大幸薬品	4,300	2,117.00	9,103,100
ダイト	5,600	3,455.00	19,348,000
大塚ホールディングス	183,600	3,695.00	678,402,000
大正製薬ホールディングス	21,600	9,020.00	194,832,000
ペプチドリーム	48,300	5,880.00	284,004,000
日本コークス工業	81,400	92.00	7,488,800
ニチレキ	12,300	1,048.00	12,890,400
ユシロ化学工業	5,000	1,363.00	6,815,000
ビーピー・カストロール	3,400	1,459.00	4,960,600
富士石油	23,500	268.00	6,298,000
MORESCO	3,500	1,441.00	5,043,500
出光興産	111,300	3,105.00	345,586,500

J X T Gホールディングス	1,621,300	528.10	856,208,530	
コスモエネルギーホールディングス	27,900	2,244.00	62,607,600	
横浜ゴム	55,800	1,947.00	108,642,600	
TOYO TIRE	49,500	1,475.00	73,012,500	
ブリヂストン	296,300	4,244.00	1,257,497,200	
住友ゴム工業	86,600	1,254.00	108,596,400	
藤倉コンポジット	8,500	394.00	3,349,000	
オカモト	6,700	4,925.00	32,997,500	
フコク	4,200	755.00	3,171,000	
ニッタ	10,900	3,115.00	33,953,500	
住友理工	18,700	840.00	15,708,000	
三ツ星ベルト	12,700	2,065.00	26,225,500	
バンドー化学	18,400	973.00	17,903,200	
日東紡績	14,400	2,146.00	30,902,400	
A G C	95,300	3,705.00	353,086,500	
日本板硝子	46,100	716.00	33,007,600	
石塚硝子	1,600	2,339.00	3,742,400	
日本山村硝子	4,000	1,484.00	5,936,000	
日本電気硝子	41,700	2,702.00	112,673,400	
オハラ	3,800	1,302.00	4,947,600	
住友大阪セメント	19,500	4,470.00	87,165,000	
太平洋セメント	60,900	3,265.00	198,838,500	
日本ヒューム	9,700	727.00	7,051,900	
日本コンクリート工業	21,000	293.00	6,153,000	
三谷セキサン	4,500	2,903.00	13,063,500	
アジアパイルホールディングス	13,700	617.00	8,452,900	
東海カーボン	87,500	1,148.00	100,450,000	
日本カーボン	4,600	4,240.00	19,504,000	
東洋炭素	5,700	2,157.00	12,294,900	
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	4,640.00	26,912,000	
T O T O	74,200	4,165.00	309,043,000	
日本碍子	117,700	1,501.00	176,667,700	
日本特殊陶業	81,300	1,958.00	159,185,400	
M A R U W A	3,300	5,290.00	17,457,000	
品川リフラクトリーズ	2,500	3,020.00	7,550,000	
黒崎播磨	1,900	6,110.00	11,609,000	
ヨータイ	8,500	557.00	4,734,500	
イソライト工業	5,000	458.00	2,290,000	
東京窯業	12,400	307.00	3,806,800	
ニッカトー	4,400	673.00	2,961,200	
フジミインコーポレーテッド	8,600	2,199.00	18,911,400	
クニミネ工業	4,400	791.00	3,480,400	

エーアンドエーマテリアル	1,900	1,019.00	1,936,100
ニチアス	26,400	1,943.00	51,295,200
ニチハ	13,400	2,903.00	38,900,200
日本製鉄	442,900	1,824.00	807,849,600
神戸製鋼所	174,500	693.00	120,928,500
中山製鋼所	13,300	471.00	6,264,300
合同製鐵	4,600	2,060.00	9,476,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	257,500	1,516.50	390,498,750
東京製鐵	51,100	868.00	44,354,800
共英製鋼	10,800	1,847.00	19,947,600
大和工業	20,300	3,155.00	64,046,500
東京鐵鋼	3,900	1,173.00	4,574,700
大阪製鐵	6,300	1,751.00	11,031,300
淀川製鋼所	12,900	2,036.00	26,264,400
丸一鋼管	33,800	2,870.00	97,006,000
モリ工業	2,900	1,901.00	5,512,900
大同特殊鋼	15,600	4,010.00	62,556,000
日本高周波鋼業	3,600	451.00	1,623,600
日本冶金工業	78,900	211.00	16,647,900
山陽特殊製鋼	12,000	1,470.00	17,640,000
愛知製鋼	5,400	3,185.00	17,199,000
日立金属	102,700	1,192.00	122,418,400
日本金属	2,200	882.00	1,940,400
大平洋金属	6,500	2,202.00	14,313,000
新日本電工	57,200	196.00	11,211,200
栗本鐵工所	4,800	1,356.00	6,508,800
虹技	1,400	1,303.00	1,824,200
三菱製鋼	7,100	1,232.00	8,747,200
日亜鋼業	14,000	329.00	4,606,000
日本精線	1,400	2,606.00	3,648,400
エンビプロ・ホールディングス	3,600	606.00	2,181,600
シンニッタン	14,900	335.00	4,991,500
新家工業	2,200	1,466.00	3,225,200
大紀アルミニウム工業所	15,800	708.00	11,186,400
日本軽金属ホールディングス	260,300	238.00	61,951,400
三井金属鉱業	25,800	2,442.00	63,003,600
東邦亜鉛	5,300	2,417.00	12,810,100
三菱マテリアル	63,000	2,910.00	183,330,000
住友金属鉱山	130,600	2,910.00	380,046,000
D O W Aホールディングス	22,300	3,460.00	77,158,000
古河機械金属	15,800	1,415.00	22,357,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	1,735.00	19,258,500

東邦チタニウム	17,200	1,166.00	20,055,200
U A C J	14,500	1,784.00	25,868,000
C Kサンエツ	1,800	2,827.00	5,088,600
古河電気工業	27,500	2,975.00	81,812,500
住友電気工業	356,500	1,351.50	481,809,750
フジクラ	115,400	372.00	42,928,800
昭和電線ホールディングス	11,100	769.00	8,535,900
東京特殊電線	1,300	1,649.00	2,143,700
タツタ電線	19,200	465.00	8,928,000
カナレ電気	1,600	1,897.00	3,035,200
平河ヒューテック	4,100	1,210.00	4,961,000
リョービ	11,800	2,083.00	24,579,400
アーレスティ	11,900	534.00	6,354,600
アサヒホールディングス	17,900	2,175.00	38,932,500
稲葉製作所	5,400	1,421.00	7,673,400
宮地エンジニアリンググループ	2,900	1,756.00	5,092,400
トーカロ	24,600	755.00	18,573,000
アルファC o	3,400	1,237.00	4,205,800
S U M C O	105,300	1,232.00	129,729,600
川田テクノロジーズ	2,100	8,370.00	17,577,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,900	2,675.00	5,082,500
信和	5,000	960.00	4,800,000
東洋製罐グループホールディングス	60,700	2,177.00	132,143,900
ホッカンホールディングス	4,800	1,768.00	8,486,400
コロナ	5,300	994.00	5,268,200
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,659.00	29,364,300
駒井ハルテック	1,800	1,649.00	2,968,200
高田機工	900	2,535.00	2,281,500
三和ホールディングス	98,500	1,099.00	108,251,500
文化シャッター	28,100	806.00	22,648,600
三協立山	13,200	1,191.00	15,721,200
アルインコ	7,600	997.00	7,577,200
東洋シャッター	2,300	635.00	1,460,500
L I X I L グループ	140,700	1,543.00	217,100,100
日本フィルコン	7,400	507.00	3,751,800
ノーリツ	21,300	1,370.00	29,181,000
長府製作所	9,700	2,226.00	21,592,200
リンナイ	17,000	7,130.00	121,210,000
ダイニチ工業	5,200	604.00	3,140,800
日東精工	13,200	596.00	7,867,200
三洋工業	1,300	1,781.00	2,315,300
岡部	19,300	989.00	19,087,700

ジーテクト	10,500	1,540.00	16,170,000
東プレ	17,800	1,818.00	32,360,400
高周波熱錬	18,400	892.00	16,412,800
東京製綱	5,800	1,028.00	5,962,400
サンコール	5,400	526.00	2,840,400
モリテック スチール	7,500	393.00	2,947,500
パイオラックス	15,300	1,917.00	29,330,100
エイチワン	9,400	783.00	7,360,200
日本発條	95,000	840.00	79,800,000
中央発條	1,200	2,894.00	3,472,800
アドバネクス	1,300	1,718.00	2,233,400
立川ブラインド工業	4,200	1,266.00	5,317,200
三益半導体工業	8,500	1,543.00	13,115,500
日本ドライケミカル	2,600	1,104.00	2,870,400
日本製鋼所	29,000	1,795.00	52,055,000
三浦工業	41,300	3,330.00	137,529,000
タクマ	34,900	1,433.00	50,011,700
ツガミ	21,600	894.00	19,310,400
オークマ	12,200	5,380.00	65,636,000
東芝機械	10,800	2,427.00	26,211,600
アマダホールディングス	143,300	1,197.00	171,530,100
アイダエンジニアリング	26,300	750.00	19,725,000
滝澤鉄工所	3,000	1,438.00	4,314,000
F U J I	38,100	1,262.00	48,082,200
牧野フライス製作所	11,200	4,030.00	45,136,000
オーエスジー	47,000	2,140.00	100,580,000
ダイジェット工業	1,200	1,199.00	1,438,800
旭ダイヤモンド工業	25,200	646.00	16,279,200
D M G 森精機	60,400	1,461.00	88,244,400
ソディック	20,900	939.00	19,625,100
ディスコ	12,900	16,140.00	208,206,000
日東工器	5,300	2,231.00	11,824,300
日進工具	2,800	2,115.00	5,922,000
パンチ工業	6,800	494.00	3,359,200
富士ダイス	4,300	573.00	2,463,900
豊和工業	5,500	846.00	4,653,000
O K K	4,100	741.00	3,038,100
東洋機械金属	6,900	592.00	4,084,800
津田駒工業	2,100	1,535.00	3,223,500
島精機製作所	13,200	3,135.00	41,382,000
オプトラン	9,300	2,436.00	22,654,800
N C ホールディングス	3,200	486.00	1,555,200

イワキポンプ	4,100	1,063.00	4,358,300
フリー	7,700	1,050.00	8,085,000
ヤマシンフィルタ	16,700	619.00	10,337,300
日阪製作所	11,800	931.00	10,985,800
やまびこ	18,600	928.00	17,260,800
平田機工	4,500	5,360.00	24,120,000
ペガサスミシン製造	9,100	546.00	4,968,600
マルマエ	4,000	736.00	2,944,000
タツモ	4,100	822.00	3,370,200
ナプテスコ	52,500	2,899.00	152,197,500
三井海洋開発	10,200	2,840.00	28,968,000
レオン自動機	9,400	1,667.00	15,669,800
S M C	28,200	37,750.00	1,064,550,000
新川	7,200	370.00	2,664,000
ホソカワミクロン	3,400	4,735.00	16,099,000
ユニオンツール	4,200	2,751.00	11,554,200
オイレス工業	13,400	1,568.00	21,011,200
日精エー・エス・ビー機械	3,200	3,015.00	9,648,000
サトーホールディングス	11,500	2,773.00	31,889,500
技研製作所	8,400	3,360.00	28,224,000
日本エアーテック	3,100	575.00	1,782,500
カワタ	2,700	1,074.00	2,899,800
日精樹脂工業	8,200	910.00	7,462,000
オカダアイヨン	3,300	1,279.00	4,220,700
ワイエイシイホールディングス	3,800	835.00	3,173,000
小松製作所	436,500	2,433.00	1,062,004,500
住友重機械工業	55,200	3,465.00	191,268,000
日立建機	38,700	2,719.00	105,225,300
日工	2,700	2,673.00	7,217,100
巴工業	4,100	2,396.00	9,823,600
井関農機	9,700	1,509.00	14,637,300
T O W A	8,300	788.00	6,540,400
丸山製作所	2,200	1,130.00	2,486,000
北川鉄工所	4,400	2,134.00	9,389,600
ローツェ	4,300	2,236.00	9,614,800
タカキタ	3,500	564.00	1,974,000
クボタ	516,500	1,742.00	899,743,000
荏原実業	2,900	1,986.00	5,759,400
三菱化工機	3,400	1,589.00	5,402,600
月島機械	19,200	1,397.00	26,822,400
帝国電機製作所	6,800	1,265.00	8,602,000
新東工業	23,000	959.00	22,057,000

澁谷工業	8,500	2,913.00	24,760,500
アイチ コーポレーション	16,900	691.00	11,677,900
小森コーポレーション	26,000	1,175.00	30,550,000
鶴見製作所	7,600	1,993.00	15,146,800
住友精密工業	1,600	2,805.00	4,488,000
酒井重工業	1,900	2,653.00	5,040,700
荏原製作所	42,800	2,930.00	125,404,000
石井鐵工所	1,500	1,978.00	2,967,000
西島製作所	10,000	1,048.00	10,480,000
北越工業	10,000	1,243.00	12,430,000
ダイキン工業	131,600	13,730.00	1,806,868,000
オルガノ	3,500	3,555.00	12,442,500
トーヨーカネツ	3,700	2,112.00	7,814,400
栗田工業	52,200	2,612.00	136,346,400
椿本チエイン	12,600	3,510.00	44,226,000
大同工業	4,800	858.00	4,118,400
木村化工機	8,600	352.00	3,027,200
アネスト岩田	15,100	998.00	15,069,800
ダイフク	53,100	5,810.00	308,511,000
サムコ	2,700	809.00	2,184,300
加藤製作所	5,000	2,021.00	10,105,000
油研工業	1,700	1,681.00	2,857,700
タダノ	46,600	1,083.00	50,467,800
フジテック	35,100	1,490.00	52,299,000
C K D	26,900	1,083.00	29,132,700
キトー	7,300	1,617.00	11,804,100
平和	26,900	2,198.00	59,126,200
理想科学工業	8,600	1,716.00	14,757,600
S A N K Y O	24,200	4,245.00	102,729,000
日本金銭機械	10,700	1,118.00	11,962,600
マースグループホールディングス	6,200	2,067.00	12,815,400
福島工業	6,000	3,640.00	21,840,000
オーイズミ	4,200	388.00	1,629,600
ダイコク電機	4,500	1,336.00	6,012,000
竹内製作所	16,200	1,854.00	30,034,800
アマノ	27,600	2,942.00	81,199,200
J U K I	13,400	950.00	12,730,000
蛇の目マシン工業	8,900	438.00	3,898,200
マックス	14,800	1,532.00	22,673,600
グローリー	26,700	2,826.00	75,454,200
新晃工業	9,000	1,655.00	14,895,000
大和冷機工業	14,000	1,195.00	16,730,000

セガサミーホールディングス	95,700	1,310.00	125,367,000
日本ピストンリング	3,600	1,394.00	5,018,400
リケン	4,500	4,420.00	19,890,000
T P R	13,000	1,892.00	24,596,000
ツバキ・ナカシマ	14,700	1,718.00	25,254,600
ホシザキ	28,200	7,910.00	223,062,000
大豊工業	7,900	811.00	6,406,900
日本精工	198,100	916.00	181,459,600
N T N	207,400	307.00	63,671,800
ジェイテクト	92,500	1,233.00	114,052,500
不二越	9,000	4,360.00	39,240,000
日本トムソン	28,800	451.00	12,988,800
T H K	60,100	2,382.00	143,158,200
ユーシン精機	7,500	1,054.00	7,905,000
前澤給装工業	3,800	1,964.00	7,463,200
イーグル工業	12,000	1,043.00	12,516,000
前澤工業	6,600	351.00	2,316,600
日本ピラー工業	9,800	1,100.00	10,780,000
キッツ	39,200	762.00	29,870,400
マキタ	117,300	3,770.00	442,221,000
日立造船	76,800	362.00	27,801,600
三菱重工業	161,600	4,713.00	761,620,800
I H I	74,100	2,499.00	185,175,900
スター精密	16,500	1,412.00	23,298,000
日清紡ホールディングス	53,700	790.00	42,423,000
イビデン	59,200	1,820.00	107,744,000
コニカミノルタ	210,900	1,015.00	214,063,500
ブラザー工業	125,700	1,920.00	241,344,000
ミネベアミツミ	179,100	1,691.00	302,858,100
日立製作所	434,000	3,996.00	1,734,264,000
三菱電機	964,000	1,407.00	1,356,348,000
富士電機	62,600	3,780.00	236,628,000
東洋電機製造	3,900	1,285.00	5,011,500
安川電機	111,800	3,365.00	376,207,000
シンフォニアテクノロジー	13,500	1,229.00	16,591,500
明電舎	19,200	1,545.00	29,664,000
オリジン	2,700	1,453.00	3,923,100
山洋電気	4,700	4,060.00	19,082,000
デンヨー	9,000	1,389.00	12,501,000
東芝テック	12,100	2,800.00	33,880,000
芝浦メカトロニクス	1,800	2,598.00	4,676,400
マブチモーター	26,700	3,740.00	99,858,000

日本電産	116,000	14,255.00	1,653,580,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,400	1,283.00	6,928,200
トレックス・セミコンダクター	4,500	1,178.00	5,301,000
東光高岳	5,100	1,185.00	6,043,500
ダブル・スコープ	14,200	1,478.00	20,987,600
ダイヘン	10,600	3,105.00	32,913,000
ヤーマン	14,200	955.00	13,561,000
JVCケンウッド	74,700	229.00	17,106,300
ミマキエンジニアリング	9,100	599.00	5,450,900
第一精工	4,200	1,437.00	6,035,400
日新電機	22,700	1,127.00	25,582,900
大崎電気工業	19,300	693.00	13,374,900
オムロン	102,500	5,440.00	557,600,000
日東工業	15,500	1,950.00	30,225,000
I D E C	13,000	2,029.00	26,377,000
正興電機製作所	2,000	772.00	1,544,000
不二電機工業	1,300	1,232.00	1,601,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34,800	2,080.00	72,384,000
サクサホールディングス	2,500	1,849.00	4,622,500
メルコホールディングス	4,100	3,150.00	12,915,000
テクノメディカ	2,300	2,184.00	5,023,200
日本電気	124,800	4,165.00	519,792,000
富士通	92,900	7,604.00	706,411,600
沖電気工業	41,900	1,309.00	54,847,100
岩崎通信機	4,500	785.00	3,532,500
電気興業	5,100	3,045.00	15,529,500
サンケン電気	11,300	2,245.00	25,368,500
ナカヨ	1,900	1,548.00	2,941,200
アイホン	5,500	1,672.00	9,196,000
ルネサスエレクトロニクス	101,700	500.00	50,850,000
セイコーエプソン	119,700	1,650.00	197,505,000
ワコム	70,500	344.00	24,252,000
アルバック	19,200	3,175.00	60,960,000
アクセル	4,600	559.00	2,571,400
E I Z O	8,900	3,980.00	35,422,000
日本信号	24,700	1,154.00	28,503,800
京三製作所	21,000	361.00	7,581,000
能美防災	12,900	2,155.00	27,799,500
ホーチキ	6,300	1,157.00	7,289,100
星和電機	5,700	509.00	2,901,300
エレコム	9,200	3,610.00	33,212,000
パナソニック	1,101,300	875.00	963,637,500

シャープ	95,700	1,034.00	98,953,800
アンリツ	62,100	1,776.00	110,289,600
富士通ゼネラル	29,500	1,585.00	46,757,500
ソニー	646,800	5,360.00	3,466,848,000
T D K	50,500	7,680.00	387,840,000
帝国通信工業	4,500	1,182.00	5,319,000
タムラ製作所	37,400	567.00	21,205,800
アルプスアルパイン	100,500	1,802.00	181,101,000
池上通信機	3,100	1,120.00	3,472,000
鈴木	5,600	630.00	3,528,000
日本トリム	1,900	5,230.00	9,937,000
ローランド ディー . ジー .	5,000	2,483.00	12,415,000
フォスター電機	11,000	1,519.00	16,709,000
S M K	2,700	2,661.00	7,184,700
ヨコオ	7,000	2,136.00	14,952,000
ホシデン	28,600	1,137.00	32,518,200
ヒロセ電機	13,800	12,010.00	165,738,000
日本航空電子工業	22,200	1,595.00	35,409,000
T O A	10,400	1,290.00	13,416,000
マクセルホールディングス	20,900	1,842.00	38,497,800
古野電気	12,700	946.00	12,014,200
ユニデンホールディングス	2,900	1,839.00	5,333,100
スミダコーポレーション	8,400	1,182.00	9,928,800
アイコム	5,400	2,341.00	12,641,400
リオン	4,500	2,130.00	9,585,000
本多通信工業	8,800	509.00	4,479,200
横河電機	96,500	2,142.00	206,703,000
新電元工業	3,400	3,605.00	12,257,000
アズビル	62,300	2,657.00	165,531,100
東亜ディーケーケー	5,100	868.00	4,426,800
日本光電工業	42,600	3,160.00	134,616,000
チノー	3,400	1,207.00	4,103,800
共和電業	10,400	414.00	4,305,600
日本電子材料	4,000	513.00	2,052,000
堀場製作所	19,100	5,260.00	100,466,000
アドバンテスト	65,700	2,846.00	186,982,200
小野測器	4,900	577.00	2,827,300
エスペック	8,700	2,286.00	19,888,200
キーエンス	47,300	64,000.00	3,027,200,000
日置電機	5,100	3,695.00	18,844,500
シスメックス	75,200	7,710.00	579,792,000
日本マイクロニクス	17,000	945.00	16,065,000

メガチップス	7,800	1,290.00	10,062,000
O B A R A G R O U P	5,600	3,770.00	21,112,000
澤藤電機	1,300	1,661.00	2,159,300
原田工業	4,300	784.00	3,371,200
コーセル	12,500	1,071.00	13,387,500
イリソ電子工業	8,900	5,380.00	47,882,000
オブテックスグループ	17,100	1,342.00	22,948,200
千代田インテグレ	4,200	2,062.00	8,660,400
アイ・オー・データ機器	3,800	1,070.00	4,066,000
レーザーテック	19,800	3,955.00	78,309,000
スタンレー電気	68,300	2,552.00	174,301,600
岩崎電気	3,900	1,358.00	5,296,200
ウシオ電機	56,200	1,377.00	77,387,400
岡谷電機産業	7,600	390.00	2,964,000
ハリオス テクノ ホールディング	9,300	601.00	5,589,300
エノモト	3,000	764.00	2,292,000
日本セラミック	9,900	2,947.00	29,175,300
遠藤照明	5,300	743.00	3,937,900
古河電池	7,300	643.00	4,693,900
双信電機	5,200	565.00	2,938,000
山一電機	7,300	929.00	6,781,700
図研	6,400	1,596.00	10,214,400
日本電子	19,100	2,330.00	44,503,000
カシオ計算機	85,400	1,283.00	109,568,200
ファナック	91,600	19,260.00	1,764,216,000
日本シイエムケイ	24,900	684.00	17,031,600
エンプラス	4,400	3,150.00	13,860,000
大真空	3,800	1,086.00	4,126,800
ローム	46,100	7,040.00	324,544,000
浜松ホトニクス	69,200	3,910.00	270,572,000
三井ハイテック	10,900	1,101.00	12,000,900
新光電気工業	32,700	926.00	30,280,200
京セラ	147,000	6,853.00	1,007,391,000
太陽誘電	43,000	1,922.00	82,646,000
村田製作所	303,400	4,547.00	1,379,559,800
双葉電子工業	15,900	1,421.00	22,593,900
北陸電気工業	3,900	968.00	3,775,200
ニチコン	30,700	811.00	24,897,700
日本ケミコン	6,800	1,590.00	10,812,000
K O A	14,700	1,309.00	19,242,300
市光工業	14,900	586.00	8,731,400
小糸製作所	57,800	5,420.00	313,276,000

ミツバ	18,200	602.00	10,956,400
S C R E E Nホールディングス	16,800	3,995.00	67,116,000
キヤノン電子	9,000	1,796.00	16,164,000
キヤノン	518,900	3,110.00	1,613,779,000
リコー	289,900	1,073.00	311,062,700
象印マホービン	24,100	1,180.00	28,438,000
M U T O Hホールディングス	1,500	1,672.00	2,508,000
東京エレクトロン	64,300	15,595.00	1,002,758,500
トヨタ紡織	33,700	1,419.00	47,820,300
芦森工業	2,000	1,677.00	3,354,000
ユニプレス	18,700	1,781.00	33,304,700
豊田自動織機	78,000	5,900.00	460,200,000
モリタホールディングス	16,900	1,922.00	32,481,800
三櫻工業	12,400	406.00	5,034,400
デンソー	212,200	4,429.00	939,833,800
東海理化電機製作所	25,400	1,728.00	43,891,200
三井E & Sホールディングス	34,800	948.00	32,990,400
川崎重工業	75,000	2,459.00	184,425,000
名村造船所	29,000	316.00	9,164,000
日本車輛製造	3,500	2,560.00	8,960,000
三菱ロジスネクスト	11,500	1,176.00	13,524,000
近畿車輛	1,400	1,793.00	2,510,200
日産自動車	1,136,800	767.40	872,380,320
いすゞ自動車	304,700	1,259.50	383,769,650
トヨタ自動車	1,074,200	6,706.00	7,203,585,200
日野自動車	120,400	879.00	105,831,600
三菱自動車工業	356,800	514.00	183,395,200
エフテック	6,800	758.00	5,154,400
レシップホールディングス	3,500	756.00	2,646,000
G M B	2,000	821.00	1,642,000
ファルテック	1,800	767.00	1,380,600
武蔵精密工業	23,400	1,419.00	33,204,600
日産車体	18,800	1,047.00	19,683,600
新明和工業	40,400	1,352.00	54,620,800
極東開発工業	19,200	1,375.00	26,400,000
日信工業	17,700	1,435.00	25,399,500
トピー工業	8,000	2,419.00	19,352,000
ティラド	3,500	1,877.00	6,569,500
曙ブレーキ工業	52,900	121.00	6,400,900
タチエス	16,200	1,352.00	21,902,400
N O K	51,900	1,460.00	75,774,000
フタバ産業	26,900	561.00	15,090,900

K Y B	10,000	2,882.00	28,820,000
大同メタル工業	15,700	640.00	10,048,000
プレス工業	47,900	487.00	23,327,300
ミクニ	12,400	381.00	4,724,400
太平洋工業	20,200	1,504.00	30,380,800
ケーヒン	22,200	1,482.00	32,900,400
河西工業	11,900	779.00	9,270,100
アイシン精機	79,400	3,725.00	295,765,000
マツダ	302,500	1,128.50	341,371,250
今仙電機製作所	9,000	915.00	8,235,000
本田技研工業	813,200	2,780.00	2,260,696,000
スズキ	176,400	5,302.00	935,272,800
S U B A R U	299,300	2,622.50	784,914,250
安永	4,700	1,501.00	7,054,700
ヤマハ発動機	136,100	1,926.00	262,128,600
ショーワ	22,800	1,440.00	32,832,000
T B K	11,700	388.00	4,539,600
エクセディ	13,100	2,219.00	29,068,900
豊田合成	31,200	2,017.00	62,930,400
愛三工業	15,200	702.00	10,670,400
盟和産業	1,500	1,050.00	1,575,000
日本プラスト	7,700	707.00	5,443,900
ヨロズ	9,000	1,336.00	12,024,000
エフ・シー・シー	17,400	2,312.00	40,228,800
シマノ	38,900	17,000.00	661,300,000
テイ・エス テック	22,400	2,834.00	63,481,600
ジャムコ	4,900	2,233.00	10,941,700
テルモ	272,800	3,200.00	872,960,000
クリエートメディック	3,200	939.00	3,004,800
日機装	31,100	1,494.00	46,463,400
島津製作所	124,100	2,843.00	352,816,300
J M S	9,000	676.00	6,084,000
長野計器	7,600	708.00	5,380,800
ブイ・テクノロジー	4,500	4,680.00	21,060,000
東京計器	6,200	943.00	5,846,600
愛知時計電機	1,300	4,100.00	5,330,000
インターアクション	5,200	1,427.00	7,420,400
オーバル	9,600	237.00	2,275,200
東京精密	17,500	2,612.00	45,710,000
マニー	12,800	6,970.00	89,216,000
ニコン	168,000	1,519.00	255,192,000
トプコン	51,800	1,350.00	69,930,000

オリンパス	574,400	1,299.00	746,145,600
理研計器	8,500	1,961.00	16,668,500
タムロン	8,600	2,188.00	18,816,800
H O Y A	194,100	7,939.00	1,540,959,900
シード	4,100	1,129.00	4,628,900
ノーリツ銅機	7,600	1,872.00	14,227,200
エー・アンド・デイ	8,800	781.00	6,872,800
朝日インテック	40,900	5,610.00	229,449,000
シチズン時計	105,500	524.00	55,282,000
リズム時計工業	3,300	1,273.00	4,200,900
大研医器	7,700	618.00	4,758,600
メニコン	13,200	3,695.00	48,774,000
シンシア	1,500	580.00	870,000
松風	4,700	1,319.00	6,199,300
セイコーホールディングス	14,900	2,134.00	31,796,600
ニプロ	66,700	1,209.00	80,640,300
中本パックス	2,700	1,485.00	4,009,500
スノーピーク	3,700	1,440.00	5,328,000
パラマウントベッドホールディングス	11,100	4,440.00	49,284,000
トランザクション	6,100	866.00	5,282,600
S H O - B I	2,800	367.00	1,027,600
ニホンフラッシュ	4,100	2,829.00	11,598,900
前田工織	10,600	1,933.00	20,489,800
永大産業	12,700	339.00	4,305,300
アートネイチャー	10,300	632.00	6,509,600
バンダイナムコホールディングス	99,700	5,420.00	540,374,000
アイフィスジャパン	2,200	619.00	1,361,800
共立印刷	16,100	179.00	2,881,900
S H O E I	4,600	4,745.00	21,827,000
フランスベッドホールディングス	13,600	993.00	13,504,800
パイロットコーポレーション	16,800	4,195.00	70,476,000
萩原工業	5,400	1,372.00	7,408,800
トッパン・フォームズ	20,600	917.00	18,890,200
フジシールインターナショナル	21,600	3,625.00	78,300,000
タカラトミー	40,300	1,329.00	53,558,700
廣濟堂	9,000	642.00	5,778,000
エステールホールディングス	2,600	604.00	1,570,400
アーケ	37,000	102.00	3,774,000
タカノ	3,800	788.00	2,994,400
プロネクサス	8,300	1,199.00	9,951,700
ホクシン	6,000	128.00	768,000
ウッドワン	3,200	1,010.00	3,232,000

大建工業	7,300	2,192.00	16,001,600	
凸版印刷	136,100	1,648.00	224,292,800	
大日本印刷	135,900	2,400.00	326,160,000	
図書印刷	9,000	1,310.00	11,790,000	
共同印刷	3,000	2,796.00	8,388,000	
N I S S H A	19,800	1,115.00	22,077,000	
光村印刷	800	2,055.00	1,644,000	
宝印刷	4,600	1,596.00	7,341,600	
アシックス	90,900	1,255.00	114,079,500	
ツツミ	3,000	2,050.00	6,150,000	
小松ウオール工業	2,900	1,802.00	5,225,800	
ヤマハ	57,300	5,150.00	295,095,000	
河合楽器製作所	3,000	2,953.00	8,859,000	
クリナップ	9,000	526.00	4,734,000	
ピジョン	58,300	4,175.00	243,402,500	
兼松サステック	600	1,610.00	966,000	
キングジム	8,000	884.00	7,072,000	
リンテック	22,900	2,189.00	50,128,100	
イトーキ	17,700	429.00	7,593,300	
任天堂	55,200	39,700.00	2,191,440,000	
三菱鉛筆	15,900	1,897.00	30,162,300	
タカラスタンダード	19,900	1,671.00	33,252,900	
コクヨ	46,200	1,524.00	70,408,800	
ナカバヤシ	9,500	516.00	4,902,000	
グローブライド	4,700	3,425.00	16,097,500	
オカムラ	33,600	1,075.00	36,120,000	
美津濃	9,500	2,562.00	24,339,000	
東京電力ホールディングス	769,500	584.00	449,388,000	
中部電力	294,900	1,570.00	462,993,000	
関西電力	393,300	1,300.50	511,486,650	
中国電力	133,300	1,397.00	186,220,100	
北陸電力	94,400	815.00	76,936,000	
東北電力	225,700	1,142.00	257,749,400	
四国電力	86,800	1,022.00	88,709,600	
九州電力	198,700	1,095.00	217,576,500	
北海道電力	90,200	644.00	58,088,800	
沖縄電力	17,800	1,741.00	30,989,800	
電源開発	76,700	2,469.00	189,372,300	
エフオン	4,600	782.00	3,597,200	
イーレックス	16,700	1,326.00	22,144,200	
レノバ	15,800	924.00	14,599,200	
東京瓦斯	189,100	2,726.00	515,486,600	

大阪瓦斯	187,100	1,979.00	370,270,900
東邦瓦斯	47,700	4,330.00	206,541,000
北海道瓦斯	5,200	1,515.00	7,878,000
広島ガス	19,900	339.00	6,746,100
西部瓦斯	10,900	2,283.00	24,884,700
静岡ガス	29,600	857.00	25,367,200
メタウォーター	4,700	3,290.00	15,463,000
SBSホールディングス	9,500	1,600.00	15,200,000
東武鉄道	101,700	3,210.00	326,457,000
相鉄ホールディングス	33,000	3,100.00	102,300,000
東京急行電鉄	261,800	1,960.00	513,128,000
京浜急行電鉄	132,000	1,921.00	253,572,000
小田急電鉄	154,400	2,739.00	422,901,600
京王電鉄	53,900	7,250.00	390,775,000
京成電鉄	72,200	4,115.00	297,103,000
富士急行	13,100	4,095.00	53,644,500
新京成電鉄	2,500	2,059.00	5,147,500
東日本旅客鉄道	171,400	10,560.00	1,809,984,000
西日本旅客鉄道	86,400	8,870.00	766,368,000
東海旅客鉄道	86,300	23,130.00	1,996,119,000
西武ホールディングス	119,400	1,895.00	226,263,000
鴻池運輸	15,300	1,743.00	26,667,900
西日本鉄道	26,700	2,441.00	65,174,700
ハマキョウレックス	7,400	3,795.00	28,083,000
サカイ引越センター	5,100	6,640.00	33,864,000
近鉄グループホールディングス	91,300	5,370.00	490,281,000
阪急阪神ホールディングス	121,800	4,040.00	492,072,000
南海電気鉄道	40,700	2,836.00	115,425,200
京阪ホールディングス	40,600	4,930.00	200,158,000
神戸電鉄	2,400	3,985.00	9,564,000
名古屋鉄道	75,000	3,075.00	230,625,000
山陽電気鉄道	7,000	2,241.00	15,687,000
日本通運	35,400	5,740.00	203,196,000
ヤマトホールディングス	160,000	2,250.00	360,000,000
山九	25,400	5,570.00	141,478,000
丸運	5,200	283.00	1,471,600
丸全昭和運輸	7,400	3,425.00	25,345,000
センコーグループホールディングス	50,300	893.00	44,917,900
トナミホールディングス	2,200	5,710.00	12,562,000
ニッコンホールディングス	34,700	2,598.00	90,150,600
日本石油輸送	1,100	2,787.00	3,065,700
福山通運	11,700	3,955.00	46,273,500

セイノーホールディングス	68,400	1,433.00	98,017,200
エスライン	2,700	975.00	2,632,500
神奈川中央交通	2,300	3,900.00	8,970,000
日立物流	20,100	3,375.00	67,837,500
丸和運輸機関	4,800	4,605.00	22,104,000
C & F ロジホールディングス	9,200	1,347.00	12,392,400
九州旅客鉄道	76,600	3,420.00	261,972,000
S Gホールディングス	86,200	3,050.00	262,910,000
日本郵船	76,700	1,636.00	125,481,200
商船三井	54,400	2,396.00	130,342,400
川崎汽船	28,100	1,205.00	33,860,500
N S ユナイテッド海運	5,300	2,302.00	12,200,600
飯野海運	44,900	358.00	16,074,200
共栄タンカー	1,200	1,456.00	1,747,200
乾汽船	8,200	841.00	6,896,200
日本航空	167,100	3,495.00	584,014,500
A N Aホールディングス	166,900	3,705.00	618,364,500
パスコ	1,800	852.00	1,533,600
トランコム	2,500	6,330.00	15,825,000
日新	7,900	1,772.00	13,998,800
三菱倉庫	31,600	3,080.00	97,328,000
三井倉庫ホールディングス	11,200	1,623.00	18,177,600
住友倉庫	33,900	1,412.00	47,866,800
澁澤倉庫	5,000	1,794.00	8,970,000
東陽倉庫	16,600	321.00	5,328,600
日本トランスシティ	20,100	465.00	9,346,500
ケイヒン	1,800	1,224.00	2,203,200
中央倉庫	5,600	1,046.00	5,857,600
川西倉庫	1,900	1,057.00	2,008,300
安田倉庫	7,500	890.00	6,675,000
ファイズ	1,600	697.00	1,115,200
東洋埠頭	2,800	1,400.00	3,920,000
宇徳	7,800	508.00	3,962,400
上組	56,300	2,590.00	145,817,000
サンリツ	2,200	637.00	1,401,400
キムラユニティー	2,400	1,100.00	2,640,000
キューソー流通システム	2,300	2,036.00	4,682,800
近鉄エクスプレス	17,200	1,476.00	25,387,200
東海運	5,200	244.00	1,268,800
エーアイティー	5,900	958.00	5,652,200
内外トランスライン	2,900	1,218.00	3,532,200
日本コンセプト	3,300	1,169.00	3,857,700

NEC ネットズエスアイ	10,500	2,787.00	29,263,500
クロスキャット	2,600	983.00	2,555,800
システナ	33,800	1,710.00	57,798,000
デジタルアーツ	5,100	9,150.00	46,665,000
日鉄ソリューションズ	14,200	3,470.00	49,274,000
キューブシステム	5,300	857.00	4,542,100
エイジア	2,000	1,232.00	2,464,000
コア	4,100	1,520.00	6,232,000
ソリトンシステムズ	5,500	1,177.00	6,473,500
ソフトクリエイティブホールディングス	4,200	1,588.00	6,669,600
T I S	31,600	5,550.00	175,380,000
ネオス	3,800	755.00	2,869,000
電算システム	3,600	3,850.00	13,860,000
グリー	65,600	529.00	34,702,400
コーエーテクモホールディングス	19,400	2,038.00	39,537,200
三菱総合研究所	4,100	3,265.00	13,386,500
電算	1,100	2,000.00	2,200,000
A G S	5,600	705.00	3,948,000
ファインデックス	8,200	918.00	7,527,600
ブレインパッド	1,800	7,310.00	13,158,000
K L a b	16,900	792.00	13,384,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,700	1,227.00	15,582,900
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,045.00	3,272,000
ネクソン	241,400	1,673.00	403,862,200
アイスタイル	24,400	708.00	17,275,200
エムアップ	3,300	2,042.00	6,738,600
エイチーム	6,600	1,546.00	10,203,600
エニグモ	3,400	2,774.00	9,431,600
テクノスジャパン	8,200	570.00	4,674,000
コロプラ	31,200	801.00	24,991,200
ブロードリーフ	47,200	553.00	26,101,600
クロス・マーケティンググループ	4,000	350.00	1,400,000
デジタルハーツホールディングス	4,500	1,063.00	4,783,500
システム情報	5,000	823.00	4,115,000
メディアドゥホールディングス	3,000	3,395.00	10,185,000
じげん	13,600	784.00	10,662,400
エンカレッジ・テクノロジー	1,400	915.00	1,281,000
サイバーリンクス	1,600	1,113.00	1,780,800
フィックスターズ	10,100	1,873.00	18,917,300
C A R T A H O L D I N G S	5,100	1,440.00	7,344,000
オブティム	4,200	3,450.00	14,490,000
セレス	3,200	1,792.00	5,734,400

ティーガイア	9,600	1,966.00	18,873,600
セック	1,600	3,340.00	5,344,000
日本アジアグループ	10,000	357.00	3,570,000
豆蔵ホールディングス	6,600	1,352.00	8,923,200
テクマトリックス	6,700	2,008.00	13,453,600
プロシップ	2,900	1,176.00	3,410,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	228,400	295.00	67,378,000
GMOペイメントゲートウェイ	15,600	7,160.00	111,696,000
ザッパラス	5,400	392.00	2,116,800
システムリサーチ	1,300	2,993.00	3,890,900
インターネットイニシアティブ	15,500	2,126.00	32,953,000
さくらインターネット	11,600	532.00	6,171,200
ヴィンクス	3,300	1,295.00	4,273,500
GMOクラウド	2,200	3,155.00	6,941,000
SRAホールディングス	5,100	2,428.00	12,382,800
Minorityソリューションズ	1,900	1,819.00	3,456,100
システムインテグレータ	2,900	708.00	2,053,200
朝日ネット	8,000	608.00	4,864,000
eBASE	5,800	1,102.00	6,391,600
アバント	3,500	2,299.00	8,046,500
アドソル日進	3,400	1,587.00	5,395,800
フリービット	5,800	1,076.00	6,240,800
コムチュア	5,300	4,115.00	21,809,500
サイバーコム	1,800	1,994.00	3,589,200
アステリア	6,400	1,000.00	6,400,000
マークラインズ	4,400	1,976.00	8,694,400
メディカル・データ・ビジョン	8,500	1,172.00	9,962,000
ショーケース	2,300	540.00	1,242,000
モバイルファクトリー	2,700	1,382.00	3,731,400
テラスカイ	1,600	1,513.00	2,420,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,896.00	8,152,800
PCIホールディングス	2,000	2,080.00	4,160,000
パイプドHD	1,600	1,159.00	1,854,400
アイビーシー	1,800	1,305.00	2,349,000
ネオジャパン	2,000	996.00	1,992,000
PR TIMES	900	2,769.00	2,492,100
ランドコンピュータ	1,600	1,158.00	1,852,800
ダブルスタンダード	800	4,310.00	3,448,000
オープンドア	4,700	3,070.00	14,429,000
マイネット	3,300	716.00	2,362,800
アカツキ	3,400	5,950.00	20,230,000
ベネフィットジャパン	900	867.00	780,300

U b i c o mホールディングス	1,800	1,725.00	3,105,000
L I N E	28,900	3,045.00	88,000,500
カナミックネットワーク	2,000	2,277.00	4,554,000
ノムラシステムコーポレーション	1,300	726.00	943,800
チェンジ	1,900	2,752.00	5,228,800
シンクロ・フード	4,300	570.00	2,451,000
オークネット	5,100	1,363.00	6,951,300
エイトレッド	1,100	1,907.00	2,097,700
A O I T Y O H o l d i n g s	10,500	743.00	7,801,500
マクロミル	16,900	1,169.00	19,756,100
ビーグリー	2,600	805.00	2,093,000
オロ	2,600	2,849.00	7,407,400
テモナ	1,600	441.00	705,600
ソルクシーズ	4,300	846.00	3,637,800
フェイス	3,900	903.00	3,521,700
プロトコーポレーション	4,300	1,879.00	8,079,700
ハイマックス	1,200	1,860.00	2,232,000
野村総合研究所	60,200	5,280.00	317,856,000
サイバネットシステム	8,100	674.00	5,459,400
C Eホールディングス	2,900	997.00	2,891,300
日本システム技術	1,600	1,588.00	2,540,800
インテージホールディングス	12,300	999.00	12,287,700
東邦システムサイエンス	3,000	914.00	2,742,000
ソースネクスト	37,100	431.00	15,990,100
インフォコム	10,400	2,420.00	25,168,000
F I G	8,900	323.00	2,874,700
アルテリア・ネットワークス	10,600	1,142.00	12,105,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,200	1,713.00	3,768,600
フォーカスシステムズ	6,500	861.00	5,596,500
クレスコ	2,900	3,295.00	9,555,500
フジ・メディア・ホールディングス	98,200	1,538.00	151,031,600
オービック	32,800	13,100.00	429,680,000
ジャストシステム	13,500	3,635.00	49,072,500
T D Cソフト	8,500	800.00	6,800,000
ヤフー	617,200	307.00	189,480,400
トレンドマイクロ	50,500	4,935.00	249,217,500
I Dホールディングス	3,800	1,097.00	4,168,600
日本オラクル	19,200	7,810.00	149,952,000
アルファシステムズ	3,000	2,800.00	8,400,000
フューチャー	12,900	1,952.00	25,180,800
C A C H o l d i n g s	6,900	1,590.00	10,971,000
ソフトバンク・テクノロジー	4,100	2,408.00	9,872,800

トーセ	2,800	845.00	2,366,000
オービックビジネスコンサルタント	9,700	5,240.00	50,828,000
伊藤忠テクノソリューションズ	43,200	2,734.00	118,108,800
アイティフォー	11,700	833.00	9,746,100
東計電算	1,500	3,060.00	4,590,000
エクスネット	1,900	924.00	1,755,600
大塚商会	51,200	4,350.00	222,720,000
サイボウズ	11,200	1,273.00	14,257,600
ソフトブレーン	7,800	491.00	3,829,800
電通国際情報サービス	5,900	3,520.00	20,768,000
デジタルガレージ	18,500	3,330.00	61,605,000
E Mシステムズ	7,800	1,527.00	11,910,600
ウェザーニューズ	3,200	3,285.00	10,512,000
C I J	7,600	990.00	7,524,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,107.00	2,107,000
日本エンタープライズ	10,700	172.00	1,840,400
WOWOW	4,600	2,622.00	12,061,200
スカラ	6,800	964.00	6,555,200
インテリジェント ウェイブ	3,800	834.00	3,169,200
I M A G I C A G R O U P	8,300	539.00	4,473,700
ネットワンシステムズ	33,500	2,990.00	100,165,000
システムソフト	24,100	93.00	2,241,300
アルゴグラフィックス	8,100	2,313.00	18,735,300
マーベラス	14,600	849.00	12,395,400
エイベックス	16,300	1,441.00	23,488,300
日本ユニシス	29,600	3,615.00	107,004,000
兼松エレクトロニクス	5,200	3,115.00	16,198,000
東京放送ホールディングス	62,800	1,892.00	118,817,600
日本テレビホールディングス	87,000	1,617.00	140,679,000
朝日放送グループホールディングス	9,600	732.00	7,027,200
テレビ朝日ホールディングス	26,100	1,780.00	46,458,000
スカパーJ S A Tホールディングス	72,600	424.00	30,782,400
テレビ東京ホールディングス	7,800	2,496.00	19,468,800
日本BS放送	3,400	1,067.00	3,627,800
ビジョン	3,000	5,430.00	16,290,000
スマートバリュー	3,000	726.00	2,178,000
ワイヤレスゲート	4,500	414.00	1,863,000
コネクシオ	6,800	1,370.00	9,316,000
クロップス	2,000	624.00	1,248,000
日本電信電話	647,000	4,942.00	3,197,474,000
K D D I	833,600	2,726.00	2,272,393,600
ソフトバンク	1,003,000	1,406.00	1,410,218,000

光通信	11,200	22,020.00	246,624,000
N T T ドコモ	599,000	2,494.00	1,493,906,000
エムティーアイ	11,100	686.00	7,614,600
G M O インターネット	34,500	1,753.00	60,478,500
アйдママーケティングコミュニケーション	2,400	613.00	1,471,200
カドカワ	27,700	1,463.00	40,525,100
学研ホールディングス	3,200	4,675.00	14,960,000
ゼンリン	18,900	2,094.00	39,576,600
昭文社	4,800	359.00	1,723,200
インプレスホールディングス	7,900	135.00	1,066,500
アイネット	5,500	1,263.00	6,946,500
松竹	6,300	13,150.00	82,845,000
東宝	62,300	4,795.00	298,728,500
東映	4,000	15,060.00	60,240,000
エヌ・ティ・ティ・データ	252,000	1,330.00	335,160,000
ピー・シー・エー	1,300	3,490.00	4,537,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,052.00	3,488,400
D T S	10,600	4,530.00	48,018,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,000	3,875.00	170,500,000
シーイーシー	10,200	2,027.00	20,675,400
カブコン	40,600	2,265.00	91,959,000
アイ・エス・ピー	1,900	1,693.00	3,216,700
ジャステック	5,600	970.00	5,432,000
S C S K	25,000	5,430.00	135,750,000
日本システムウエア	3,200	2,798.00	8,953,600
アイネス	12,100	1,127.00	13,636,700
T K C	8,000	4,525.00	36,200,000
富士ソフト	14,200	4,785.00	67,947,000
N S D	15,600	3,120.00	48,672,000
コナミホールディングス	38,700	5,140.00	198,918,000
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,574.00	8,236,800
J B C C ホールディングス	7,600	1,322.00	10,047,200
ミロク情報サービス	9,400	3,400.00	31,960,000
ソフトバンクグループ	395,300	10,150.00	4,012,295,000
ハウスイ	800	844.00	675,200
高千穂交易	3,700	997.00	3,688,900
伊藤忠食品	2,300	4,460.00	10,258,000
エレマテック	8,900	1,024.00	9,113,600
J A L U X	2,700	2,920.00	7,884,000
あらた	7,000	3,850.00	26,950,000
トーメンデバイス	1,400	2,269.00	3,176,600
東京エレクトロン デバイス	3,400	1,898.00	6,453,200

フィールズ	8,300	526.00	4,365,800
双日	524,400	352.00	184,588,800
アルフレッサ ホールディングス	105,500	2,829.00	298,459,500
横浜冷凍	26,600	936.00	24,897,600
神栄	1,300	784.00	1,019,200
ラサ商事	5,100	800.00	4,080,000
ラクーンホールディングス	4,600	657.00	3,022,200
アルコニックス	10,100	1,340.00	13,534,000
神戸物産	14,300	5,130.00	73,359,000
あい ホールディングス	13,600	1,716.00	23,337,600
ディーブイエックス	3,700	799.00	2,956,300
ダイワボウホールディングス	8,700	4,805.00	41,803,500
マクニカ・富士エレホールディングス	26,300	1,384.00	36,399,200
ラクト・ジャパン	4,100	4,130.00	16,933,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,900	1,053.00	18,848,700
八洲電機	7,400	825.00	6,105,000
メディアスホールディングス	5,400	728.00	3,931,200
レスターホールディングス	10,400	1,507.00	15,672,800
ジューテックホールディングス	2,200	929.00	2,043,800
大光	4,100	641.00	2,628,100
O C H Iホールディングス	2,800	1,216.00	3,404,800
T O K A Iホールディングス	50,200	899.00	45,129,800
黒谷	2,200	447.00	983,400
C o m i n i x	1,700	843.00	1,433,100
三洋貿易	4,800	2,365.00	11,352,000
ビューティガレージ	1,500	1,242.00	1,863,000
ウイン・パートナーズ	6,200	1,098.00	6,807,600
ミタチ産業	2,900	691.00	2,003,900
シップヘルスケアホールディングス	19,800	4,650.00	92,070,000
明治電機工業	3,000	1,376.00	4,128,000
デリカフーズホールディングス	1,700	1,485.00	2,524,500
スターティアホールディングス	1,900	546.00	1,037,400
コメダホールディングス	22,000	2,128.00	46,816,000
富士興産	3,700	742.00	2,745,400
協栄産業	1,200	1,468.00	1,761,600
小野建	8,500	1,379.00	11,721,500
南陽	1,900	1,600.00	3,040,000
佐島電機	7,000	881.00	6,167,000
エコトレーディング	2,200	534.00	1,174,800
伯東	6,500	1,176.00	7,644,000
コンドーテック	7,400	961.00	7,111,400
中山福	5,500	559.00	3,074,500

ナガイレーベン	13,700	2,592.00	35,510,400
三菱食品	10,400	2,909.00	30,253,600
松田産業	6,900	1,529.00	10,550,100
第一興商	14,100	5,140.00	72,474,000
メディカルホールディングス	102,500	2,432.00	249,280,000
S P K	2,000	2,385.00	4,770,000
萩原電気ホールディングス	3,500	2,697.00	9,439,500
アズワン	6,800	9,510.00	64,668,000
スズデン	3,300	1,355.00	4,471,500
尾家産業	3,100	1,294.00	4,011,400
シモジマ	5,800	1,135.00	6,583,000
ドウシシャ	9,000	1,806.00	16,254,000
小津産業	2,100	1,712.00	3,595,200
高速	5,700	1,170.00	6,669,000
たけびし	3,300	1,342.00	4,428,600
リックス	2,100	1,456.00	3,057,600
丸文	8,500	565.00	4,802,500
ハピネット	7,900	1,301.00	10,277,900
橋本総業ホールディングス	1,900	1,498.00	2,846,200
日本ライフライン	29,800	1,769.00	52,716,200
タカショー	4,700	470.00	2,209,000
エクセル	3,500	1,687.00	5,904,500
マルカ	3,100	1,914.00	5,933,400
I D O M	32,000	286.00	9,152,000
日本エム・ディ・エム	5,600	1,480.00	8,288,000
進和	5,600	2,245.00	12,572,000
エスケイジャパン	2,300	521.00	1,198,300
ダイトロン	4,400	1,236.00	5,438,400
シークス	12,100	1,244.00	15,052,400
田中商事	3,200	593.00	1,897,600
オーハシテクニカ	5,400	1,477.00	7,975,800
白銅	3,100	1,352.00	4,191,200
伊藤忠商事	664,000	1,936.50	1,285,836,000
丸紅	936,200	705.50	660,489,100
高島	1,500	1,710.00	2,565,000
長瀬産業	53,400	1,664.00	88,857,600
蝶理	6,100	1,626.00	9,918,600
豊田通商	106,000	3,190.00	338,140,000
三共生興	16,200	523.00	8,472,600
兼松	37,900	1,228.00	46,541,200
ツカモトコーポレーション	1,700	1,007.00	1,711,900
三井物産	782,200	1,757.00	1,374,325,400

日本紙パルプ商事	5,400	3,830.00	20,682,000
日立ハイテクノロジーズ	28,900	5,720.00	165,308,000
カメイ	12,400	1,182.00	14,656,800
東都水産	1,300	2,549.00	3,313,700
OUGホールディングス	1,500	2,587.00	3,880,500
スターゼン	3,500	4,085.00	14,297,500
山善	37,100	1,000.00	37,100,000
椿本興業	2,100	3,045.00	6,394,500
住友商事	561,500	1,615.00	906,822,500
内田洋行	4,300	3,495.00	15,028,500
三菱商事	666,200	2,907.00	1,936,643,400
第一実業	4,300	3,110.00	13,373,000
キャノンマーケティングジャパン	27,100	2,413.00	65,392,300
西華産業	5,400	1,300.00	7,020,000
佐藤商事	8,500	970.00	8,245,000
菱洋エレクトロ	9,600	1,719.00	16,502,400
東京産業	9,500	468.00	4,446,000
ユアサ商事	9,700	3,025.00	29,342,500
神鋼商事	2,100	2,319.00	4,869,900
小林産業	5,700	338.00	1,926,600
阪和興業	16,500	2,857.00	47,140,500
正栄食品工業	6,700	3,280.00	21,976,000
カナデン	9,000	1,298.00	11,682,000
菱電商事	7,500	1,619.00	12,142,500
フルサト工業	5,200	1,516.00	7,883,200
岩谷産業	21,100	3,620.00	76,382,000
すてきナイスグループ	4,100	576.00	2,361,600
昭光通商	3,400	624.00	2,121,600
ニチモウ	1,500	1,738.00	2,607,000
極東貿易	2,900	1,472.00	4,268,800
イワキ	11,500	491.00	5,646,500
三愛石油	25,500	988.00	25,194,000
稲畑産業	22,800	1,399.00	31,897,200
G S Iクレオス	2,500	1,152.00	2,880,000
明和産業	8,800	363.00	3,194,400
クワザワ	3,400	486.00	1,652,400
ワキタ	20,300	1,057.00	21,457,100
東邦ホールディングス	28,100	2,524.00	70,924,400
サンゲツ	28,200	2,174.00	61,306,800
ミツウロコグループホールディングス	13,700	796.00	10,905,200
シナネンホールディングス	3,900	1,808.00	7,051,200
伊藤忠エネクス	21,000	859.00	18,039,000

サンリオ	29,300	2,657.00	77,850,100
サンワテクノス	5,800	832.00	4,825,600
リョーサン	10,500	2,673.00	28,066,500
新光商事	8,900	1,880.00	16,732,000
トーホー	4,300	2,174.00	9,348,200
三信電気	6,500	1,888.00	12,272,000
東陽テクニカ	10,900	915.00	9,973,500
モスフードサービス	12,500	2,411.00	30,137,500
加賀電子	9,500	1,631.00	15,494,500
ソーダニッカ	9,800	540.00	5,292,000
立花エレテック	7,000	1,650.00	11,550,000
フォーバル	4,200	975.00	4,095,000
PALTA C	17,100	5,850.00	100,035,000
三谷産業	11,200	282.00	3,158,400
西本Wismettacホールディングス	2,200	3,815.00	8,393,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,216.00	972,800
国際紙パルプ商事	22,200	269.00	5,971,800
ヤマタネ	4,800	1,369.00	6,571,200
丸紅建材リース	900	1,709.00	1,538,100
日鉄物産	6,800	4,320.00	29,376,000
泉州電業	3,200	2,657.00	8,502,400
トラスコ中山	19,800	2,429.00	48,094,200
オートバックスセブン	37,700	1,728.00	65,145,600
モリト	6,900	827.00	5,706,300
加藤産業	14,800	3,510.00	51,948,000
北恵	1,800	804.00	1,447,200
イノテック	5,700	850.00	4,845,000
イエローハット	17,900	1,452.00	25,990,800
J Kホールディングス	8,600	582.00	5,005,200
日伝	7,900	1,701.00	13,437,900
北沢産業	7,200	286.00	2,059,200
杉本商事	5,100	2,073.00	10,572,300
因幡電機産業	13,500	4,425.00	59,737,500
東テク	3,100	2,153.00	6,674,300
ミスミグループ本社	118,900	2,691.00	319,959,900
アルテック	7,000	212.00	1,484,000
タキヒヨー	2,900	1,876.00	5,440,400
蔵王産業	1,600	1,327.00	2,123,200
スズケン	43,300	6,940.00	300,502,000
ジェコス	6,600	976.00	6,441,600
ルネサスイーストン	8,800	455.00	4,004,000
ローソン	24,000	5,100.00	122,400,000

サンエー	7,200	4,370.00	31,464,000
カワチ薬品	7,400	1,945.00	14,393,000
エービーシー・マート	14,800	6,900.00	102,120,000
ハードオフコーポレーション	3,900	700.00	2,730,000
アスクル	10,000	2,731.00	27,310,000
ゲオホールディングス	14,500	1,378.00	19,981,000
アダストリア	13,200	2,411.00	31,825,200
ジーフット	5,900	655.00	3,864,500
くら寿司	5,600	4,245.00	23,772,000
キャンドウ	4,600	1,630.00	7,498,000
パルグループホールディングス	4,900	3,330.00	16,317,000
エディオン	40,300	972.00	39,171,600
サーラコーポレーション	19,400	583.00	11,310,200
ワッツ	4,300	688.00	2,958,400
ハローズ	3,600	2,218.00	7,984,800
フジオフードシステム	4,000	2,896.00	11,584,000
あみやき亭	2,100	3,395.00	7,129,500
ひらまつ	19,200	346.00	6,643,200
大黒天物産	2,300	3,450.00	7,935,000
ハニーズホールディングス	8,500	1,021.00	8,678,500
ファーマライズホールディングス	2,400	532.00	1,276,800
アルペン	7,300	1,642.00	11,986,600
ハブ	3,100	1,282.00	3,974,200
クオールホールディングス	14,000	1,529.00	21,406,000
ジinz	5,000	6,430.00	32,150,000
ビックカメラ	56,400	1,132.00	63,844,800
D C Mホールディングス	51,300	1,096.00	56,224,800
ペッパーフードサービス	7,600	1,993.00	15,146,800
Monotaro	60,000	2,394.00	143,640,000
東京一番フーズ	2,600	603.00	1,567,800
DDホールディングス	2,100	2,054.00	4,313,400
きちりホールディングス	2,700	734.00	1,981,800
アーランドサービスホールディングス	7,000	1,902.00	13,314,000
J.フロント リテイリング	121,500	1,145.00	139,117,500
ドトール・日レスホールディングス	16,700	2,114.00	35,303,800
マツモトキヨシホールディングス	39,300	3,295.00	129,493,500
broncoビリー	5,000	2,264.00	11,320,000
Zozo	102,700	1,827.00	187,632,900
トレジャー・ファクトリー	2,900	817.00	2,369,300
物語コーポレーション	2,400	8,760.00	21,024,000
ココカラファイン	10,700	5,600.00	59,920,000
三越伊勢丹ホールディングス	177,700	897.00	159,396,900

H a m e e	3,000	652.00	1,956,000	
ウエルシアホールディングス	25,100	4,165.00	104,541,500	
クリエイトSDホールディングス	14,000	2,438.00	34,132,000	
丸善CHIホールディングス	11,100	374.00	4,151,400	
ティーライフ	1,400	833.00	1,166,200	
エー・ピーカンパニー	2,000	464.00	928,000	
チムニー	2,900	2,456.00	7,122,400	
シュッピン	6,600	765.00	5,049,000	
ネクステージ	15,300	1,223.00	18,711,900	
ジョイフル本田	27,900	1,252.00	34,930,800	
鳥貴族	3,200	2,099.00	6,716,800	
キリン堂ホールディングス	3,800	1,708.00	6,490,400	
ホットランド	5,000	1,584.00	7,920,000	
すかいらーくホールディングス	88,500	2,005.00	177,442,500	
SFPホールディングス	4,100	1,851.00	7,589,100	
綿半ホールディングス	3,600	2,405.00	8,658,000	
ヨシックス	1,600	2,333.00	3,732,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,700	956.00	26,481,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,000	677.00	2,708,000	
B E E N O S	3,400	1,827.00	6,211,800	
あさひ	7,900	1,315.00	10,388,500	
日本調剤	3,400	3,620.00	12,308,000	
コスモス薬品	4,200	17,910.00	75,222,000	
トーエル	4,700	733.00	3,445,100	
オンリー	1,700	808.00	1,373,600	
セブン&アイ・ホールディングス	398,000	3,688.00	1,467,824,000	
薬王堂	4,200	2,393.00	10,050,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,600	1,452.00	37,171,200	
ツルハホールディングス	20,600	8,870.00	182,722,000	
サンマルクホールディングス	7,500	2,380.00	17,850,000	
フェリシモ	2,200	971.00	2,136,200	
トリドールホールディングス	11,800	2,039.00	24,060,200	
T O K Y O B A S E	8,600	862.00	7,413,200	
ウイルプラスホールディングス	1,600	800.00	1,280,000	
ジャパンミート	4,800	1,731.00	8,308,800	
サツドラホールディングス	1,500	1,917.00	2,875,500	
デファクトスタンダード	1,100	347.00	381,700	
アレンザホールディングス	5,200	855.00	4,446,000	
パロックジャパンリミテッド	7,800	903.00	7,043,400	
クスリのアオキホールディングス	9,400	7,190.00	67,586,000	
力の源ホールディングス	3,700	725.00	2,682,500	

スシログローバルホールディングス	10,400	7,540.00	78,416,000
LIXILビバ	8,100	1,190.00	9,639,000
メディカルシステムネットワーク	10,300	509.00	5,242,700
はるやまホールディングス	4,600	833.00	3,831,800
ノジマ	16,900	1,808.00	30,555,200
カップ・クリエイト	13,300	1,409.00	18,739,700
ライトオン	8,100	727.00	5,888,700
良品計画	13,500	19,000.00	256,500,000
三城ホールディングス	12,000	332.00	3,984,000
アドヴァン	14,600	1,082.00	15,797,200
アルビス	3,600	2,512.00	9,043,200
コナカ	12,300	418.00	5,141,400
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,642.00	1,970,400
G-7ホールディングス	2,800	3,175.00	8,890,000
イオン北海道	9,700	721.00	6,993,700
コジマ	16,500	478.00	7,887,000
ヒマラヤ	3,400	862.00	2,930,800
コーナン商事	12,500	2,299.00	28,737,500
エコス	3,600	1,401.00	5,043,600
ワタミ	12,500	1,484.00	18,550,000
マルシェ	2,600	780.00	2,028,000
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	56,900	6,760.00	384,644,000
西松屋チェーン	20,900	875.00	18,287,500
ゼンショーホールディングス	44,800	2,247.00	100,665,600
幸楽苑ホールディングス	6,100	2,845.00	17,354,500
ハークスレイ	2,100	1,044.00	2,192,400
サイゼリヤ	15,700	2,468.00	38,747,600
V Tホールディングス	43,100	461.00	19,869,100
魚力	2,700	1,481.00	3,998,700
フジ・コーポレーション	2,600	2,158.00	5,610,800
ユナイテッドアローズ	10,900	3,520.00	38,368,000
ハイデイ日高	13,700	2,006.00	27,482,200
京都きもの友禅	6,300	368.00	2,318,400
コロワイド	31,600	2,135.00	67,466,000
ピーシーデポコーポレーション	12,900	403.00	5,198,700
壱番屋	6,700	4,570.00	30,619,000
P L A N T	2,500	793.00	1,982,500
スギホールディングス	20,900	4,995.00	104,395,500
スクロール	14,900	345.00	5,140,500
ヨンドシーホールディングス	10,600	2,529.00	26,807,400
ユニー・ファミリーマートホールディングス	106,200	2,530.00	268,686,000
木曽路	11,700	2,574.00	30,115,800

S R S ホールディングス	11,300	1,011.00	11,424,300
タカキュー	7,900	174.00	1,374,600
ケーヨー	17,800	495.00	8,811,000
上新電機	11,200	2,239.00	25,076,800
日本瓦斯	15,500	2,667.00	41,338,500
ロイヤルホールディングス	16,600	2,774.00	46,048,400
いなげや	10,700	1,404.00	15,022,800
島忠	21,300	2,504.00	53,335,200
チヨダ	10,000	1,675.00	16,750,000
ライフコーポレーション	7,300	2,250.00	16,425,000
リンガーハット	11,700	2,313.00	27,062,100
MrMaxHD	13,300	445.00	5,918,500
テンアライド	8,800	416.00	3,660,800
AOKIホールディングス	19,100	1,043.00	19,921,300
オークワ	13,700	1,110.00	15,207,000
コメリ	14,700	2,219.00	32,619,300
青山商事	16,600	2,122.00	35,225,200
しまむら	11,100	8,180.00	90,798,000
はせがわ	5,300	397.00	2,104,100
高島屋	74,600	1,136.00	84,745,600
松屋	19,300	882.00	17,022,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,800	1,225.00	59,780,000
近鉄百貨店	3,700	3,275.00	12,117,500
パルコ	9,200	1,075.00	9,890,000
丸井グループ	80,400	2,284.00	183,633,600
アクシアル リテイリング	7,900	3,785.00	29,901,500
イオン	365,400	1,895.50	692,615,700
イズミ	19,300	4,540.00	87,622,000
平和堂	19,300	1,947.00	37,577,100
フジ	11,500	1,791.00	20,596,500
ヤオコー	10,800	4,895.00	52,866,000
ゼビオホールディングス	11,600	1,249.00	14,488,400
ケーズホールディングス	98,700	1,026.00	101,266,200
Olympicグループ	5,700	709.00	4,041,300
日産東京販売ホールディングス	14,300	280.00	4,004,000
Genky DrugStores	4,700	2,549.00	11,980,300
総合メディカルホールディングス	8,300	1,735.00	14,400,500
ブックオフグループホールディングス	4,900	968.00	4,743,200
アインホールディングス	12,700	6,800.00	86,360,000
元気寿司	2,700	3,865.00	10,435,500
ヤマダ電機	289,400	511.00	147,883,400
アーランドサカモト	16,200	1,394.00	22,582,800

ニトリホールディングス	41,100	13,090.00	537,999,000
グルメ杵屋	6,900	1,157.00	7,983,300
愛眼	7,600	240.00	1,824,000
ケーユーホールディングス	5,100	887.00	4,523,700
吉野家ホールディングス	33,200	1,871.00	62,117,200
松屋フーズホールディングス	4,600	3,355.00	15,433,000
サガミホールディングス	12,800	1,342.00	17,177,600
関西スーパーマーケット	7,300	1,090.00	7,957,000
王将フードサービス	7,000	6,860.00	48,020,000
プレナス	10,700	1,873.00	20,041,100
ミニストップ	7,100	1,625.00	11,537,500
アークス	17,800	2,210.00	39,338,000
パローホールディングス	20,500	2,239.00	45,899,500
ベルク	4,700	5,140.00	24,158,000
大庄	5,100	1,580.00	8,058,000
ファーストリテイリング	12,700	64,420.00	818,134,000
サンドラッグ	35,700	2,786.00	99,460,200
サクスパー ホールディングス	8,100	954.00	7,727,400
ヤマザワ	2,000	1,635.00	3,270,000
やまや	1,700	2,060.00	3,502,000
ペルーナ	23,400	746.00	17,456,400
島根銀行	3,000	710.00	2,130,000
じもとホールディングス	64,200	95.00	6,099,000
めぶきフィナンシャルグループ	496,400	276.00	137,006,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,200	1,666.00	21,991,200
九州フィナンシャルグループ	157,500	441.00	69,457,500
ゆうちょ銀行	269,900	1,091.00	294,460,900
富山第一銀行	24,800	311.00	7,712,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	599,800	406.00	243,518,800
西日本フィナンシャルホールディングス	61,000	825.00	50,325,000
関西みらいフィナンシャルグループ	45,600	733.00	33,424,800
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,528.00	13,293,600
第四北越フィナンシャルグループ	16,700	2,925.00	48,847,500
新生銀行	69,800	1,690.00	117,962,000
あおぞら銀行	53,100	2,620.00	139,122,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,544,700	508.70	3,329,288,890
りそなホールディングス	1,043,300	452.90	472,510,570
三井住友トラスト・ホールディングス	186,900	4,010.00	749,469,000
三井住友フィナンシャルグループ	670,100	3,783.00	2,534,988,300
千葉銀行	328,200	526.00	172,633,200
群馬銀行	191,900	393.00	75,416,700
武蔵野銀行	14,500	2,101.00	30,464,500

千葉興業銀行	28,800	273.00	7,862,400
筑波銀行	39,500	174.00	6,873,000
七十七銀行	30,200	1,682.00	50,796,400
青森銀行	7,600	2,887.00	21,941,200
秋田銀行	6,400	2,166.00	13,862,400
山形銀行	11,100	1,682.00	18,670,200
岩手銀行	6,900	3,060.00	21,114,000
東邦銀行	85,000	254.00	21,590,000
東北銀行	4,800	1,106.00	5,308,800
みちのく銀行	6,100	1,698.00	10,357,800
ふくおかフィナンシャルグループ	84,100	1,936.00	162,817,600
静岡銀行	240,100	826.00	198,322,600
十六銀行	13,000	2,301.00	29,913,000
八十二銀行	230,800	468.00	108,014,400
山梨中央銀行	12,000	1,280.00	15,360,000
大垣共立銀行	20,300	2,522.00	51,196,600
福井銀行	8,500	1,570.00	13,345,000
北國銀行	10,200	3,120.00	31,824,000
清水銀行	4,300	1,799.00	7,735,700
富山銀行	2,100	2,612.00	5,485,200
滋賀銀行	19,300	2,654.00	51,222,200
南都銀行	15,100	2,379.00	35,922,900
百五銀行	87,500	342.00	29,925,000
京都銀行	34,200	4,325.00	147,915,000
紀陽銀行	34,100	1,545.00	52,684,500
ほくほくフィナンシャルグループ	63,800	1,194.00	76,177,200
広島銀行	141,500	559.00	79,098,500
山陰合同銀行	57,300	727.00	41,657,100
中国銀行	82,400	1,073.00	88,415,200
鳥取銀行	3,700	1,411.00	5,220,700
伊予銀行	127,100	573.00	72,828,300
百十四銀行	10,400	2,343.00	24,367,200
四国銀行	14,200	967.00	13,731,400
阿波銀行	15,300	2,743.00	41,967,900
大分銀行	6,000	3,255.00	19,530,000
宮崎銀行	6,600	2,566.00	16,935,600
佐賀銀行	6,200	1,625.00	10,075,000
沖縄銀行	8,900	3,565.00	31,728,500
琉球銀行	22,500	1,160.00	26,100,000
セブン銀行	323,500	284.00	91,874,000
みずほフィナンシャルグループ	12,918,800	152.80	1,973,992,640
高知銀行	3,500	755.00	2,642,500

山口フィナンシャルグループ	119,500	792.00	94,644,000
長野銀行	3,500	1,711.00	5,988,500
名古屋銀行	7,900	3,590.00	28,361,000
北洋銀行	145,900	262.00	38,225,800
愛知銀行	3,600	3,790.00	13,644,000
中京銀行	4,200	2,211.00	9,286,200
大光銀行	3,700	1,646.00	6,090,200
愛媛銀行	13,900	1,125.00	15,637,500
トマト銀行	4,300	1,040.00	4,472,000
京葉銀行	43,000	658.00	28,294,000
栃木銀行	52,800	184.00	9,715,200
北日本銀行	3,400	1,743.00	5,926,200
東和銀行	16,700	728.00	12,157,600
福島銀行	8,300	263.00	2,182,900
大東銀行	4,600	581.00	2,672,600
トモニホールディングス	75,300	366.00	27,559,800
フィデアホールディングス	92,300	119.00	10,983,700
池田泉州ホールディングス	103,900	218.00	22,650,200
F P G	30,000	873.00	26,190,000
マーキュリアインベストメント	3,800	686.00	2,606,800
S B Iホールディングス	113,300	2,502.00	283,476,600
ジャフコ	15,600	3,895.00	60,762,000
大和証券グループ本社	763,100	480.00	366,288,000
野村ホールディングス	1,673,100	352.60	589,935,060
岡三証券グループ	81,200	407.00	33,048,400
丸三証券	28,400	583.00	16,557,200
東洋証券	34,800	120.00	4,176,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	113,600	355.00	40,328,000
光世証券	2,400	674.00	1,617,600
水戸証券	28,100	205.00	5,760,500
いちよし証券	20,100	769.00	15,456,900
松井証券	46,600	1,036.00	48,277,600
だいこう証券ビジネス	4,100	410.00	1,681,000
マネックスグループ	88,000	326.00	28,688,000
カブドットコム証券	72,600	557.00	40,438,200
極東証券	12,900	921.00	11,880,900
岩井コスモホールディングス	9,800	1,123.00	11,005,400
藍澤證券	17,200	676.00	11,627,200
マネーパートナーズグループ	11,600	286.00	3,317,600
スパークス・グループ	38,100	225.00	8,572,500
かんぽ生命保険	35,900	2,057.00	73,846,300
S O M P Oホールディングス	167,600	4,346.00	728,389,600

アニコム ホールディングス	7,800	3,740.00	29,172,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	248,600	3,555.00	883,773,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	78,100	2,553.00	199,389,300
第一生命ホールディングス	537,900	1,627.00	875,163,300
東京海上ホールディングス	340,000	5,534.00	1,881,560,000
T & D ホールディングス	294,000	1,115.50	327,957,000
アドバンスクリエイト	2,200	1,740.00	3,828,000
全国保証	26,800	4,210.00	112,828,000
ジェイリース	2,600	322.00	837,200
イントラスト	2,700	459.00	1,239,300
日本モーゲージサービス	1,700	1,132.00	1,924,400
C a s a	4,300	1,054.00	4,532,200
アルビ	8,600	1,917.00	16,486,200
プレミアグループ	5,400	2,040.00	11,016,000
クレディセゾン	66,600	1,216.00	80,985,600
芙蓉総合リース	10,900	5,500.00	59,950,000
興銀リース	17,900	2,666.00	47,721,400
東京センチュリー	19,100	4,705.00	89,865,500
日本証券金融	41,900	555.00	23,254,500
アイフル	145,000	214.00	31,030,000
リコーリース	7,500	3,420.00	25,650,000
イオンフィナンシャルサービス	60,700	1,751.00	106,285,700
アコム	191,100	384.00	73,382,400
ジャックス	10,500	1,936.00	20,328,000
オリエントコーポレーション	257,100	113.00	29,052,300
日立キャピタル	22,400	2,416.00	54,118,400
アプラスフィナンシャル	45,800	71.00	3,251,800
オリックス	634,300	1,563.00	991,410,900
三菱UFJリース	214,500	551.00	118,189,500
九州リースサービス	4,700	628.00	2,951,600
日本取引所グループ	256,800	1,728.00	443,750,400
イー・ギャランティ	8,900	1,419.00	12,629,100
アサックス	4,000	552.00	2,208,000
N E C キャピタルソリューション	3,900	1,753.00	6,836,700
いちご	123,400	330.00	40,722,000
日本駐車場開発	116,700	173.00	20,189,100
スター・マイカ・ホールディングス	4,900	1,719.00	8,423,100
ヒューリック	199,400	861.00	171,683,400
三栄建築設計	4,400	1,512.00	6,652,800
野村不動産ホールディングス	63,700	2,341.00	149,121,700
三重交通グループホールディングス	20,600	602.00	12,401,200
サムティ	13,800	1,492.00	20,589,600

ディア・ライフ	14,100	429.00	6,048,900
コーセーアールイー	3,900	763.00	2,975,700
エー・ディー・ワークス	146,500	38.00	5,567,000
日本商業開発	6,500	1,481.00	9,626,500
プレサンスコーポレーション	15,600	1,607.00	25,069,200
ユニゾホールディングス	14,800	1,895.00	28,046,000
日本管理センター	7,000	1,113.00	7,791,000
サンセイランディック	3,700	738.00	2,730,600
エストラスト	1,300	720.00	936,000
フージャースホールディングス	20,700	626.00	12,958,200
オープンハウス	14,000	4,760.00	66,640,000
東急不動産ホールディングス	257,000	619.00	159,083,000
飯田グループホールディングス	79,800	1,773.00	141,485,400
イーランド	2,600	661.00	1,718,600
ムゲンエステート	8,000	584.00	4,672,000
ファーストブラザーズ	3,400	1,026.00	3,488,400
ハウズドゥ	5,200	1,400.00	7,280,000
シーアールイー	3,800	1,002.00	3,807,600
ケイアイスター不動産	3,100	1,571.00	4,870,100
グッドコムアセット	2,800	1,430.00	4,004,000
ジェイ・エス・ビー	700	3,540.00	2,478,000
テンポイノベーション	1,600	1,554.00	2,486,400
パーク24	56,000	2,311.00	129,416,000
パラカ	2,900	1,979.00	5,739,100
三井不動産	504,700	2,745.50	1,385,653,850
三菱地所	666,500	2,056.00	1,370,324,000
平和不動産	18,400	2,293.00	42,191,200
東京建物	104,600	1,169.00	122,277,400
ダイビル	28,800	990.00	28,512,000
京阪神ビルディング	17,700	1,038.00	18,372,600
住友不動産	213,900	4,151.00	887,898,900
テーオーシー	23,100	639.00	14,760,900
東京楽天地	1,500	5,150.00	7,725,000
スターツコーポレーション	13,200	2,600.00	34,320,000
フジ住宅	13,200	770.00	10,164,000
空港施設	12,700	523.00	6,642,100
明和地所	6,800	535.00	3,638,000
ゴールドクレスト	7,900	1,867.00	14,749,300
日本エスリード	4,200	1,596.00	6,703,200
日神不動産	15,900	453.00	7,202,700
日本エスコン	18,400	694.00	12,769,600
タカラレーベン	45,700	374.00	17,091,800

サンヨーハウジング名古屋	6,300	892.00	5,619,600
イオンモール	48,200	1,638.00	78,951,600
毎日コムネット	3,100	741.00	2,297,100
ファースト住建	4,300	1,136.00	4,884,800
カチタス	10,800	4,235.00	45,738,000
トーセイ	14,000	922.00	12,908,000
穴吹興産	1,300	2,975.00	3,867,500
サンフロンティア不動産	13,900	1,024.00	14,233,600
エフ・ジェー・ネクスト	9,100	1,008.00	9,172,800
インテリックス	3,900	675.00	2,632,500
ランドビジネス	4,800	784.00	3,763,200
グランディハウス	10,100	461.00	4,656,100
日本空港ビルデング	30,500	4,350.00	132,675,000
日本工営	6,200	2,454.00	15,214,800
L I F U L L	35,400	589.00	20,850,600
ジェイエシーリクルートメント	7,500	2,524.00	18,930,000
日本M&Aセンター	68,700	2,660.00	182,742,000
メンバーズ	3,100	1,922.00	5,958,200
中広	1,200	570.00	684,000
アイティメディア	2,000	486.00	972,000
タケエイ	9,700	946.00	9,176,200
E・Jホールディングス	1,200	1,064.00	1,276,800
トラスト・テック	5,100	3,210.00	16,371,000
コシダカホールディングス	24,400	1,428.00	34,843,200
アルトナー	2,400	761.00	1,826,400
パソナグループ	11,300	1,775.00	20,057,500
C D S	2,400	1,312.00	3,148,800
リンクアンドモチベーション	17,100	607.00	10,379,700
G C A	9,500	725.00	6,887,500
エス・エム・エス	33,900	2,584.00	87,597,600
サニーサイドアップ	1,100	2,088.00	2,296,800
パーソルホールディングス	92,100	2,413.00	222,237,300
リニカル	5,300	1,116.00	5,914,800
クックパッド	29,400	342.00	10,054,800
エスクリ	2,700	779.00	2,103,300
アイ・ケイ・ケイ	4,700	679.00	3,191,300
学情	3,800	1,150.00	4,370,000
スタジオアリス	4,700	2,057.00	9,667,900
シミックホールディングス	5,100	2,023.00	10,317,300
N J S	2,100	1,718.00	3,607,800
総合警備保障	36,700	5,190.00	190,473,000
カカコム	69,000	2,151.00	148,419,000

アイロムグループ	3,500	1,548.00	5,418,000
セントケア・ホールディング	6,900	468.00	3,229,200
サイネックス	1,700	639.00	1,086,300
ルネサンス	5,200	1,828.00	9,505,600
ディップ	14,900	1,735.00	25,851,500
オプトホールディング	5,700	1,528.00	8,709,600
ツクイ	21,900	561.00	12,285,900
キャリアデザインセンター	2,400	1,557.00	3,736,800
ベネフィット・ワン	25,600	2,036.00	52,121,600
エムスリー	194,000	2,104.00	408,176,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	607.00	3,702,700
プラス	1,200	624.00	748,800
アウトソーシング	48,600	1,174.00	57,056,400
ウェルネット	8,800	1,009.00	8,879,200
ワールドホールディングス	2,600	1,626.00	4,227,600
ディー・エヌ・エー	49,700	2,165.00	107,600,500
博報堂D Yホールディングス	128,100	1,783.00	228,402,300
ぐるなび	13,300	609.00	8,099,700
タカミヤ	9,700	778.00	7,546,600
ジャパンベストレスキューシステム	7,200	1,382.00	9,950,400
ファンコミュニケーションズ	25,500	557.00	14,203,500
ライク	3,700	1,289.00	4,769,300
ビジネス・ブレークスルー	4,200	351.00	1,474,200
WDBホールディングス	4,200	2,542.00	10,676,400
ティア	5,500	650.00	3,575,000
C D G	900	1,306.00	1,175,400
バリューコマース	6,200	2,359.00	14,625,800
インフォマート	50,500	1,638.00	82,719,000
J Pホールディングス	26,800	287.00	7,691,600
エコナックホールディングス	17,700	127.00	2,247,900
E P Sホールディングス	13,900	1,817.00	25,256,300
レッグス	2,400	1,434.00	3,441,600
プレステージ・インターナショナル	17,300	1,625.00	28,112,500
アミューズ	5,600	2,506.00	14,033,600
ドリームインキュベータ	2,900	1,653.00	4,793,700
クイック	5,800	1,619.00	9,390,200
T A C	5,500	196.00	1,078,000
ケネディクス	81,100	546.00	44,280,600
電通	112,200	3,700.00	415,140,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,079.00	3,884,400
ぴあ	2,700	4,935.00	13,324,500
イオンファンタジー	3,000	2,245.00	6,735,000

シーティーエス	10,600	656.00	6,953,600
ネクシィーズグループ	3,300	2,277.00	7,514,100
みらかホールディングス	25,800	2,670.00	68,886,000
アルプス技研	8,100	1,832.00	14,839,200
ダイオーズ	2,200	1,394.00	3,066,800
日本空調サービス	10,600	683.00	7,239,800
オリエンタルランド	108,900	13,625.00	1,483,762,500
ダスキン	24,500	2,982.00	73,059,000
明光ネットワークジャパン	11,600	946.00	10,973,600
ファルコホールディングス	5,100	1,756.00	8,955,600
ラウンドワン	28,600	1,591.00	45,502,600
リゾートトラスト	39,000	1,727.00	67,353,000
ビー・エム・エル	11,900	3,205.00	38,139,500
ワタベウェディング	1,700	609.00	1,035,300
りらいあコミュニケーションズ	16,700	1,260.00	21,042,000
リソー教育	47,000	463.00	21,761,000
早稲田アカデミー	2,800	760.00	2,128,000
ユー・エス・エス	112,500	2,128.00	239,400,000
東京個別指導学院	3,400	942.00	3,202,800
サイバーエージェント	53,000	3,950.00	209,350,000
楽天	429,400	1,195.00	513,133,000
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,218.00	6,699,000
テー・オー・ダブリュー	8,200	776.00	6,363,200
山田コンサルティンググループ	4,500	2,017.00	9,076,500
セントラルスポーツ	3,500	3,215.00	11,252,500
フルキャストホールディングス	9,300	2,080.00	19,344,000
エン・ジャパン	13,400	3,980.00	53,332,000
リソルホールディングス	1,000	3,925.00	3,925,000
テクノプロ・ホールディングス	18,500	5,780.00	106,930,000
アトラ	2,200	285.00	627,000
インターワークス	1,900	627.00	1,191,300
アイ・アールジャパンホールディングス	3,800	2,822.00	10,723,600
Keeper 技研	3,500	1,443.00	5,050,500
ファーストロジック	2,300	559.00	1,285,700
三機サービス	2,000	1,147.00	2,294,000
Gunosy	6,500	1,982.00	12,883,000
デザインワン・ジャパン	2,200	286.00	629,200
イー・ガーディアン	4,700	1,848.00	8,685,600
リブセンス	5,500	263.00	1,446,500
ジャパンマテリアル	25,300	1,412.00	35,723,600
ベクトル	11,300	1,075.00	12,147,500
ウチヤマホールディングス	4,800	542.00	2,601,600

チャーム・ケア・コーポレーション	3,000	1,645.00	4,935,000
ライクキッズネクスト	2,300	975.00	2,242,500
キャリアリンク	3,700	441.00	1,631,700
I B J	6,300	894.00	5,632,200
アサンテ	3,700	2,173.00	8,040,100
N・フィールド	6,100	717.00	4,373,700
バリューHR	2,000	3,500.00	7,000,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,300	5,780.00	19,074,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,204.00	4,695,600
E R Iホールディングス	2,700	952.00	2,570,400
アビスト	1,500	2,715.00	4,072,500
シグマクシス	4,500	1,258.00	5,661,000
ウィルグループ	6,100	883.00	5,386,300
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	13,200	270.00	3,564,000
日本ビューホテル	3,000	1,317.00	3,951,000
リクルートホールディングス	659,900	3,479.00	2,295,792,100
エラン	6,400	2,034.00	13,017,600
土木管理総合試験所	4,200	473.00	1,986,600
ネットマーケティング	3,500	467.00	1,634,500
日本郵政	755,000	1,207.00	911,285,000
ベルシステム24ホールディングス	15,500	1,563.00	24,226,500
鎌倉新書	6,800	1,598.00	10,866,400
ソネット・メディア・ネットワークス	1,300	812.00	1,055,600
一蔵	1,200	662.00	794,400
L I T A L I C O	2,200	1,670.00	3,674,000
グローバルキッズCOMPANY	1,500	921.00	1,381,500
エボラブルアジア	4,000	2,350.00	9,400,000
アトラエ	2,400	3,160.00	7,584,000
ストライク	3,500	2,047.00	7,164,500
ソラスト	22,700	943.00	21,406,100
セラク	3,100	614.00	1,903,400
インソース	3,600	2,520.00	9,072,000
ベikalレント・コンサルティング	6,500	3,705.00	24,082,500
Orchestra Holdings	1,600	1,370.00	2,192,000
アイモバイル	3,000	858.00	2,574,000
キャリアインデックス	3,300	770.00	2,541,000
MS - J a p a n	3,800	1,597.00	6,068,600
船場	1,600	954.00	1,526,400
グレイステクノロジー	3,400	2,659.00	9,040,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,300	2,344.00	17,111,200
フルテック	1,400	1,172.00	1,640,800
グリーンズ	3,500	1,540.00	5,390,000

ツナググループ・ホールディングス	1,300	512.00	665,600	
ソウルドアウト	1,000	2,619.00	2,619,000	
MS&Consulting	1,600	1,101.00	1,761,600	
日総工産	6,200	1,469.00	9,107,800	
キュービーネットホールディングス	5,600	2,323.00	13,008,800	
RPAホールディングス	1,900	5,090.00	9,671,000	
スプリックス	3,100	1,860.00	5,766,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,800	720.00	2,736,000	
リログループ	50,400	2,961.00	149,234,400	
東祥	5,800	2,793.00	16,199,400	
エイチ・アイ・エス	16,400	2,844.00	46,641,600	
ラックランド	1,900	2,424.00	4,605,600	
共立メンテナンス	14,100	5,180.00	73,038,000	
イチネンホールディングス	9,700	1,115.00	10,815,500	
建設技術研究所	6,400	1,503.00	9,619,200	
スペース	6,100	1,210.00	7,381,000	
長大	3,800	730.00	2,774,000	
燦ホールディングス	2,000	2,390.00	4,780,000	
スバル興業	700	5,890.00	4,123,000	
東京テアトル	3,700	1,338.00	4,950,600	
タナベ経営	1,900	1,203.00	2,285,700	
ナガワ	2,600	5,780.00	15,028,000	
よみうりランド	2,000	5,230.00	10,460,000	
東京都競馬	6,100	3,415.00	20,831,500	
カナモト	13,800	2,748.00	37,922,400	
東京ドーム	34,500	1,088.00	37,536,000	
西尾レントオール	9,400	2,977.00	27,983,800	
トランス・コスモス	10,300	2,395.00	24,668,500	
乃村工藝社	43,100	1,398.00	60,253,800	
藤田観光	3,700	2,741.00	10,141,700	
KNT-CTホールディングス	4,900	1,385.00	6,786,500	
日本管財	9,900	1,877.00	18,582,300	
トーカイ	8,900	2,339.00	20,817,100	
白洋舎	1,100	2,846.00	3,130,600	
セコム	97,800	9,235.00	903,183,000	
セントラル警備保障	4,500	5,480.00	24,660,000	
丹青社	17,500	1,143.00	20,002,500	
メイテック	11,600	5,490.00	63,684,000	
応用地質	10,000	1,085.00	10,850,000	
船井総研ホールディングス	19,100	2,677.00	51,130,700	
進学会ホールディングス	4,400	607.00	2,670,800	
オオバ	7,500	660.00	4,950,000	

いであ	2,000	1,126.00	2,252,000	
学究社	3,100	1,299.00	4,026,900	
ベネッセホールディングス	33,800	2,580.00	87,204,000	
イオンディライト	11,400	3,210.00	36,594,000	
ナック	5,900	938.00	5,534,200	
ニチイ学館	13,200	1,525.00	20,130,000	
ダイセキ	15,500	2,773.00	42,981,500	
ステップ	3,400	1,490.00	5,066,000	
合 計	112,175,700		214,938,460,270	

(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(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,146,084,576
コール・ローン	1,088,891,104
株式	172,590,076,917
投資信託受益証券	142,344,733
投資証券	4,796,281,186
派生商品評価勘定	197,244,334
未収入金	10,074,881
未収配当金	368,098,267
差入委託証拠金	2,293,766,452
流動資産合計	186,632,862,450
資産合計	186,632,862,450
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,643,737
前受金	189,082,131
未払解約金	125,455,406
未払利息	2,262
流動負債合計	333,183,536

	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
負債合計	333,183,536
純資産の部	
元本等	
元本	68,863,760,422
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	117,435,918,492
元本等合計	186,299,678,914
純資産合計	186,299,678,914
負債純資産合計	186,632,862,450

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

2019年 6月10日現在	
	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
	当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	68,863,760,422口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.7053円 (1万口当たり純資産額) (27,053円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2019年 6月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(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)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 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>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2019年 6月10日現在

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	90,650,594,351円
期中追加設定元本額	8,265,744,379円
期中一部解約元本額	30,052,578,308円
期末元本額	68,863,760,422円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,793,479,145円
D C 外国株式インデックスファンド	4,412,567,476円
D C 外国株式インデックスファンド L	20,392,499,811円
D C バランスファンド 3 0	714,872,108円
D C バランスファンド 5 0	1,409,387,107円
D C バランスファンド 7 0	806,967,839円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	390,804,450円
外国株式インデックス e	5,761,105,205円
インデックスコレクション（外国株式）	5,340,260,217円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,251,146,545円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	846,167,442円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	705,813,950円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,688,735,692円
外国株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	1,336,132,143円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	906,676,366円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	80,283,311円

区分	2019年 6月10日現在
バランスVA50（適格機関投資家専用）	785,240,969円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	83,659,594円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	468,864,174円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,454,244円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,682,811,395円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	587,718,409円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	355,353,044円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,873,988,675円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	635,056,379円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	302,739,001円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,117,449,732円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	30,290,186円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	138,056,158円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	160,040,764円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	477,635,533円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	10,207,160円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	804,238,254円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	17,767,693円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	131,849,346円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	349,459,710円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	12,981,195円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,461,852,654
投資信託受益証券	11,835,601
投資証券	348,457,558
合計	7,822,145,813

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	8,839,879,392	-	9,028,961,523	189,082,131
	合計	8,839,879,392	-	9,028,961,523	189,082,131

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,279,126,522	-	1,268,726,926	10,399,596
	アメリカドル	989,669,509	-	982,729,896	6,939,613
	ユーロ	176,430,760	-	175,892,560	538,200
	イギリスポンド	90,580,781	-	87,661,750	2,919,031
	オーストラリアドル	22,445,472	-	22,442,720	2,752
	売建	29,186,782	-	29,268,720	81,938
	イギリスポンド	29,186,782	-	29,268,720	81,938
合計		1,308,313,304	-	1,297,995,646	10,481,534

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	22,664	70.05	1,587,613.20	
	APACHE CORP	17,138	28.95	496,145.10	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,189	23.32	540,767.48	
	CABOT OIL & GAS CORP	18,624	25.44	473,794.56	

CHENIERE ENERGY INC	9,583	67.60	647,810.80
CHEVRON CORP	83,878	121.48	10,189,499.44
CIMAREX ENERGY CO	4,237	55.48	235,068.76
CONCHO RESOURCES INC	9,073	100.22	909,296.06
CONOCOPHILLIPS	50,046	58.96	2,950,712.16
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,103	38.92	159,688.76
DEVON ENERGY CORPORATION	20,829	25.69	535,097.01
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,107	97.02	689,521.14
EOG RESOURCES INC	26,047	84.60	2,203,576.20
EXXON MOBIL	187,081	74.58	13,952,500.98
HALLIBURTON CO	37,650	21.63	814,369.50
HELMERICH & PAYNE	4,776	51.89	247,826.64
HESS CORP	11,835	56.55	669,269.25
HOLLYFRONTIER CORP	7,524	40.09	301,637.16
KINDER MORGAN INC	89,708	21.13	1,895,530.04
MARATHON OIL CORP	38,194	13.31	508,362.14
MARATHON PETROLEUM CORP	29,676	46.99	1,394,475.24
NATIONAL OILWELL VARCO INC	17,063	20.85	355,763.55
NOBLE ENERGY INC	20,854	20.69	431,469.26
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,027	47.84	1,580,011.68
ONEOK INC	17,621	65.99	1,162,809.79
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	10,081	17.54	176,820.74
PHILLIPS 66	19,621	85.52	1,677,987.92
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,721	144.98	1,119,390.58
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	6,331	23.36	147,892.16
SCHLUMBERGER	62,217	35.60	2,214,925.20
TARGA RESOURCES CORP	8,989	38.54	346,436.06
TECHNIPFMC PLC	19,859	22.58	448,416.22
VALERO ENERGY CORP	18,564	74.73	1,387,287.72
WILLIAMS COS	51,953	27.76	1,442,215.28
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	9,771	223.06	2,179,519.26
ALBEMARLE CORP	4,921	69.08	339,942.68
AVERY DENNISON CORP	3,332	112.15	373,683.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	25.41	275,546.04
BALL CORP	13,962	65.90	920,095.80
CELANESE CORP-SERIES A	6,085	101.12	615,315.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	42.03	436,229.37
CHEMOURS CO/THE	8,553	22.58	193,126.74
CORTEVA INC	33,149	26.31	872,150.19
CROWN HOLDINGS INC	5,436	59.62	324,094.32
DOW INC	34,393	51.30	1,764,360.90
DUPONT DE NEMOURS INC	33,149	73.64	2,441,092.36

EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,407	71.33	457,011.31
ECOLAB INC	11,460	198.75	2,277,675.00
FMC CORP	5,380	80.72	434,273.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	61,991	10.35	641,606.85
INT'L PAPER CO	17,669	44.97	794,574.93
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,164	151.32	630,096.48
LINDE PLC	24,333	200.05	4,867,816.65
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,063	79.22	1,034,850.86
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,699	230.63	622,470.37
MOSAIC CO/THE	14,763	22.15	327,000.45
NEWMONT GOLDCORP CORP	37,580	35.67	1,340,478.60
NUCOR CORP	14,326	50.84	728,333.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,206	95.70	402,514.20
PPG INDUSTRIES INC	10,386	113.99	1,183,900.14
SEALED AIR CORP	7,368	44.80	330,086.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,620	473.98	1,715,807.60
STEEL DYNAMICS INC	9,144	25.93	237,103.92
VULCAN MATERIALS CO	5,948	134.38	799,292.24
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,000	63.47	126,940.00
WESTROCK CO	11,037	36.42	401,967.54
3 M COMPANY	25,452	166.61	4,240,557.72
ACUITY BRANDS INC	1,559	130.68	203,730.12
AERCAP HOLDINGS NV	5,656	47.20	266,963.20
ALLEGION PLC	3,778	104.14	393,440.92
AMETEK INC	10,392	85.77	891,321.84
ARCONIC INC	18,227	23.54	429,063.58
BOEING CO	23,693	353.70	8,380,214.10
CATERPILLAR	25,385	124.46	3,159,417.10
CUMMINS INC	6,641	161.95	1,075,509.95
DEERE&CO	13,918	148.71	2,069,745.78
DOVER CORP	6,899	96.05	662,648.95
EATON CORP	18,804	79.08	1,487,020.32
EMERSON ELECTRIC CO	27,236	63.68	1,734,388.48
FASTENAL CO	25,828	32.26	833,211.28
FLOWSERVE CORP	5,872	49.29	289,430.88
FLUOR CORP	6,155	29.39	180,895.45
FORTIVE CORP	12,820	78.97	1,012,395.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,720	51.99	349,372.80
GENERAL DYNAMICS CORP	10,796	173.97	1,878,180.12
GENERAL ELECTRIC CO	393,285	9.98	3,924,984.30
GRAINGER (WW) INC	2,090	271.12	566,640.80
HARRIS CORP	5,338	198.21	1,058,044.98

HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,789	42.11	327,994.79
HEICO CORP	1,482	127.95	189,621.90
HEICO CORP-CLASS A	2,850	102.27	291,469.50
HONEYWELL INTL INC	32,175	172.26	5,542,465.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	218.20	434,872.60
IDEX CORP	3,126	161.58	505,099.08
ILLINOIS TOOL WORKS	14,198	151.14	2,145,885.72
INGERSOLL-RAND PLC	10,620	125.35	1,331,217.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,604	79.40	444,957.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,500	65.77	624,815.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	38.05	357,670.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,771	39.11	1,555,443.81
L3 TECHNOLOGIES INC	3,315	256.37	849,866.55
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,551	278.31	431,658.81
LOCKHEED MARTIN CORP	11,243	355.23	3,993,850.89
MASCO CORP	13,089	37.96	496,858.44
MIDDLEBY CORP	2,145	133.71	286,807.95
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,109	318.29	2,262,723.61
OWENS CORNING	4,925	52.60	259,055.00
PACCAR INC	15,406	70.22	1,081,809.32
PARKER HANNIFIN CORP	5,754	165.54	952,517.16
PENTAIR PLC	7,018	36.44	255,735.92
RAYTHEON COMPANY	12,494	185.91	2,322,759.54
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,373	157.13	844,259.49
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,427	365.37	1,617,492.99
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	45.79	348,095.58
SMITH (A.O.) CORP	6,846	43.83	300,060.18
SNAP-ON INC	2,319	162.44	376,698.36
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5,095	84.29	429,457.55
STANLEY BLACK&DECKER	6,944	137.69	956,119.36
TEXTRON	10,911	49.11	535,839.21
TRANSDIGM GROUP INC	2,064	468.88	967,768.32
UNITED RENTALS INC	3,773	122.23	461,173.79
UNITED TECHNOLOGIES CORP	36,493	132.15	4,822,549.95
WABCO HOLDINGS INC	2,071	131.06	271,425.26
WABTEC CORP	6,306	67.37	424,835.22
XYLEM INC	8,037	79.56	639,423.72
CINTAS CORP	3,912	232.62	910,009.44
COPART INC	9,323	74.65	695,961.95
COSTAR GROUP INC	1,619	539.88	874,065.72
EQUIFAX INC	5,386	130.17	701,095.62
IHS MARKIT LTD	16,714	59.60	996,154.40

MANPOWER GROUP	2,894	88.78	256,929.32
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,880	22.75	361,270.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,405	86.79	903,049.95
ROBERT HALF INTL INC	4,993	53.84	268,823.12
ROLLINS INC	7,140	38.49	274,818.60
TRANSUNION	8,217	69.58	571,738.86
VERISK ANALYTICS INC	7,047	146.47	1,032,174.09
WASTE CONNECTIONS INC	11,869	93.88	1,114,261.72
WASTE MANAGEMENT INC	18,594	114.36	2,126,409.84
AMERCO	376	392.69	147,651.44
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,122	30.92	127,452.24
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,245	79.69	497,664.05
CSX CORP	34,167	78.07	2,667,417.69
DELTA AIR LINES INC	7,841	55.07	431,803.87
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,487	72.56	543,256.72
FEDEX CORP	11,407	158.02	1,802,534.14
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,908	87.39	341,520.12
KANSAS CITY SOUTHERN	4,597	117.50	540,147.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	30.17	211,190.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,838	203.04	2,403,587.52
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,480	136.16	337,676.80
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,089	50.37	306,702.93
UBER TECHNOLOGIES INC	7,121	44.16	314,463.36
UNION PACIFIC CORP	31,901	171.97	5,486,014.97
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,649	83.27	220,582.23
UNITED PARCEL SERVICE B	31,006	98.23	3,045,719.38
XPO LOGISTICS INC	5,355	53.78	287,991.90
APTIV PLC	11,109	73.40	815,400.60
AUTOLIV INC	3,858	66.39	256,132.62
BORGWARNER INC	9,348	39.77	371,769.96
FORD MOTOR COMPANY	166,310	9.76	1,623,185.60
GENERAL MOTORS CO	57,189	35.49	2,029,637.61
HARLEY-DAVIDSON	7,429	34.65	257,414.85
LEAR CORP	2,989	133.30	398,433.70
TESLA INC	5,765	204.50	1,178,942.50
CAPRI HOLDINGS LTD	6,771	34.21	231,635.91
DR HORTON INC	16,002	45.60	729,691.20
GARMIN LTD	4,973	78.95	392,618.35
HANESBRANDS INC	15,911	16.25	258,553.75
HASBRO INC	5,071	105.92	537,120.32
LEGGETT & PLATT INC	5,338	37.92	202,416.96
LENNAR CORP-CL A	12,416	53.36	662,517.76

LULULEMON ATHLETICA INC	4,723	172.49	814,670.27
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	146.95	415,868.50
NEWELL BRANDS INC	20,391	14.57	297,096.87
NIKE B	55,034	83.41	4,590,385.94
NVR INC	171	3,391.00	579,861.00
POLARIS INDUSTRIES INC	2,942	87.68	257,954.56
PULTE GROUP INC	12,739	32.75	417,202.25
PVH CORP	3,435	88.37	303,550.95
RALPH LAUREN CORPORATION	2,566	110.88	284,518.08
TAPESTRY INC	12,753	30.25	385,778.25
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,197	25.90	186,402.30
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	7,301	22.89	167,119.89
VF CORP	14,390	84.71	1,218,976.90
WHIRLPOOL CORP	3,060	128.74	393,944.40
ARAMARK	11,643	35.56	414,025.08
BLOCK H & R INC	10,235	27.21	278,494.35
CARNIVAL CORPORATION	18,317	52.23	956,696.91
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,083	709.87	768,789.21
DARDEN RESTAURANTS INC	5,327	121.32	646,271.64
DOMINO'S PIZZA INC	1,716	287.00	492,492.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,868	92.51	1,190,418.68
LAS VEGAS SANDS CORP	14,684	56.08	823,478.72
MARRIOTT INTL A	12,913	132.52	1,711,230.76
MCDONALD'S CORP	34,118	205.48	7,010,566.64
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	19.37	203,598.07
MGM RESORTS INTERNATIONAL	24,157	26.28	634,845.96
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,482	52.59	498,658.38
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,513	120.97	908,847.61
STARBUCKS CORP	55,225	82.48	4,554,958.00
VAIL RESORTS INC	1,670	237.13	396,007.10
WYNN RESORTS LTD	4,366	111.02	484,713.32
YUM BRANDS INC	14,173	109.07	1,545,849.11
ACTIVISION BLIZZARD INC	33,382	45.38	1,514,875.16
ALPHABET INC-CL A	13,217	1,068.37	14,120,646.29
ALPHABET INC-CL C	13,880	1,066.04	14,796,635.20
ALTICE USA INC- A	6,423	24.71	158,712.33
CBS CORP-CL B	15,534	48.42	752,156.28
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,956	394.04	2,740,942.24
COMCAST CORP-CL A	199,367	41.48	8,269,743.16
DISCOVERY INC - A	7,886	28.42	224,120.12
DISCOVERY INC-C	14,253	26.49	377,561.97
DISH NETWORK CORPORATION-A	9,561	37.10	354,713.10

ELECTRONIC ARTS INC	13,186	96.99	1,278,910.14
FACEBOOK INC-A	105,329	173.35	18,258,782.15
FOX CORP - CLASS A	15,812	34.01	537,766.12
FOX CORP- CLASS B	6,589	33.68	221,917.52
IAC/INTERACTIVECORP	3,234	228.18	737,934.12
INTERPUBLIC GROUP OF COS	16,191	21.95	355,392.45
LIBERTY BROADBAND-C	4,295	102.22	439,034.90
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	26.24	205,485.44
LIBERTY GLOBAL PLC-C	23,297	25.61	596,636.17
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	38.12	376,816.20
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	6,975	35.80	249,705.00
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	35.69	113,172.99
LIVE NATION ENTERTAINMENT	5,790	62.19	360,080.10
NETFLIX INC	19,270	360.87	6,953,964.90
NEWS CORP-CLASS A	16,730	11.72	196,075.60
OMNICOM GROUP	10,331	79.31	819,351.61
SIRIUS XM HOLDINGS INC	70,068	5.31	372,061.08
SNAP INC - A	26,226	13.87	363,754.62
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,126	111.65	572,317.90
THE WALT DISNEY CO	79,458	138.04	10,968,382.32
TRIPADVISOR INC	4,286	45.27	194,027.22
TWITTER INC	31,034	37.93	1,177,119.62
VIACOM INC-CLASS B	15,680	29.28	459,110.40
ZILLOW GROUP INC-C	5,057	46.54	235,352.78
ADVANCE AUTO PARTS	3,293	155.35	511,567.55
AMAZON.COM	18,418	1,804.03	33,226,624.54
AUTOZONE INC	1,056	1,099.14	1,160,691.84
BEST BUY COMPANY INC	10,819	63.72	689,386.68
BOOKING HOLDINGS INC	1,959	1,778.29	3,483,670.11
BURLINGTON STORES INC	3,121	163.38	509,908.98
CARMAX INC	7,647	79.89	610,918.83
DOLLAR GENERAL CORP	11,473	133.15	1,527,629.95
DOLLAR TREE INC	10,680	102.64	1,096,195.20
EBAY	37,152	37.51	1,393,571.52
EXPEDIA GROUP INC	5,616	122.60	688,521.60
GAP	10,261	18.21	186,852.81
GENUINE PARTS CO	6,575	102.29	672,556.75
GRUBHUB INC	4,540	65.22	296,098.80
HOME DEPOT	49,691	197.30	9,804,034.30
KOHL'S CORP	7,505	48.18	361,590.90
L BRANDS INC	9,728	22.70	220,825.60
LKQ CORP	13,137	26.56	348,918.72

LOWES COMPANIES	35,779	96.76	3,461,976.04
MACY'S INC	13,046	20.43	266,529.78
MERCADOLIBRE INC	1,832	604.49	1,107,425.68
NORDSTROM INC	5,106	31.67	161,707.02
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,464	382.26	1,324,148.64
QURATE RETAIL INC	18,532	12.89	238,877.48
ROSS STORES INC	16,274	99.16	1,613,729.84
TARGET (DAYTON HUDSON)	22,382	86.85	1,943,876.70
TIFFANY & CO	4,819	90.47	435,974.93
TJX COMPANIES INC	53,617	51.92	2,783,794.64
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,562	108.57	603,866.34
ULTA BEAUTY INC	2,528	338.16	854,868.48
WAYFAIR INC- CLASS A	2,697	154.28	416,093.16
COSTCO WHOLESALE CORP	19,457	256.01	4,981,186.57
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	7.71	131,070.00
KROGER CO	35,590	23.93	851,668.70
SYSCO CORP	21,272	71.50	1,520,948.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,312	51.97	1,835,164.64
WALMART INC	64,166	106.06	6,805,445.96
ALTRIA GROUP INC	82,704	51.38	4,249,331.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,973	39.58	948,851.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,795	56.50	722,917.50
BUNGE LIMITED	6,250	55.15	344,687.50
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,946	43.08	342,313.68
COCA-COLA CO	179,289	51.49	9,231,590.61
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	9,654	57.61	556,166.94
CONAGRA BRANDS INC	22,174	29.63	657,015.62
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,321	188.40	1,379,276.40
GENERAL MILLS INC	25,674	51.81	1,330,169.94
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,369	138.01	878,985.69
HORMEL FOODS CORP	12,393	42.05	521,125.65
INGREDION INC	2,843	80.71	229,458.53
JM SMUCKER CO	5,075	124.53	631,989.75
KELLOGG CO	11,660	55.99	652,843.40
KRAFT HEINZ CO/THE	28,278	28.74	812,709.72
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,742	60.99	411,194.58
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,226	157.80	824,662.80
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,447	56.97	481,225.59
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	63,702	54.02	3,441,182.04
MONSTER BEVERAGE CORP	17,658	65.92	1,164,015.36
PEPSICO INC	62,004	133.47	8,275,673.88
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,608	78.17	5,363,087.36

TYSON FOODS INC	13,383	82.45	1,103,428.35
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,915	77.98	851,151.70
CLOROX COMPANY	5,812	156.63	910,333.56
COLGATE-PALMOLIVE CO	36,096	73.99	2,670,743.04
COTY INC-CL A	15,799	13.52	213,602.48
ESTEE LAUDER CO-CL A	9,618	176.86	1,701,039.48
KIMBERLY-CLARK CORP	15,181	134.91	2,048,068.71
PROCTER & GAMBLE CO	110,439	108.77	12,012,450.03
ABBOTT LABORATORIES	77,563	80.74	6,262,436.62
ABIOMED INC	1,891	267.87	506,542.17
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,394	307.66	1,044,198.04
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,377	83.48	615,831.96
ANTHEM INC	11,336	278.13	3,152,881.68
BAXTER INTERNATIONAL	21,878	77.58	1,697,295.24
BECTON DICKINSON & CO	12,026	238.38	2,866,757.88
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,264	41.28	2,570,257.92
CARDINAL HEALTH	13,433	43.85	589,037.05
CENTENE CORP	18,310	54.21	992,585.10
CERNER CORP	13,721	72.74	998,065.54
CIGNA CORP	16,758	157.47	2,638,882.26
CVS HEALTH CORP	57,565	53.92	3,103,904.80
DANAHER CORP	27,852	137.52	3,830,207.04
DAVITA INC	6,479	47.69	308,983.51
DENTSPLY SIRONA INC	10,232	55.94	572,378.08
DEXCOM INC	4,071	125.98	512,864.58
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,054	183.81	1,664,215.74
HCA HEALTHCARE INC	12,016	128.41	1,542,974.56
HENRY SCHEIN INC	6,861	69.76	478,623.36
HOLOGIC INC	11,102	47.00	521,794.00
HUMANA INC	5,972	248.87	1,486,251.64
IDEXX LABORATORIES INC	3,926	264.92	1,040,075.92
INTUITIVE SURGICAL INC	5,117	499.04	2,553,587.68
LABORATORY CRP OF AMER	4,584	166.98	765,436.32
MCKESSON CORP	8,657	130.28	1,127,833.96
MEDTRONIC PLC	59,487	97.11	5,776,782.57
QUEST DIAGNOSTICS	6,077	99.34	603,689.18
RESMED INC	6,412	117.40	752,768.80
STERIS PLC	3,424	138.02	472,580.48
STRYKER CORP	14,791	194.30	2,873,891.30
TELEFLEX INC	1,940	305.28	592,243.20
THE COOPER COS INC	2,123	321.95	683,499.85
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,360	246.77	10,453,177.20

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	123.71	482,221.58
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,067	130.69	531,516.23
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,351	162.20	867,932.20
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,296	288.33	662,005.68
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,231	120.73	1,114,458.63
ABBVIE INC	65,102	77.43	5,040,847.86
AGILENT TECHNOLOGIES	13,682	69.52	951,172.64
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,546	118.40	1,130,246.40
ALKERMES PLC	6,874	22.83	156,933.42
ALLERGAN PLC	14,661	127.13	1,863,852.93
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,367	70.40	307,436.80
AMGEN	27,459	175.51	4,819,329.09
BEIGENE LTD-ADR	1,700	122.50	208,250.00
BIOGEN INC	8,670	227.23	1,970,084.10
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,661	80.64	617,783.04
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,019	46.75	3,366,888.25
CELGENE CORP	31,275	96.04	3,003,651.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,191	32.69	398,523.79
EXACT SCIENCES CORP	5,107	108.05	551,811.35
GILEAD SCIENCES INC	56,290	65.35	3,678,551.50
ILLUMINA INC	6,620	335.49	2,220,943.80
INCYTE CORP	7,617	80.83	615,682.11
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,182	63.68	329,989.76
IQVIA HOLDINGS INC	7,572	138.74	1,050,539.28
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	130.97	348,773.11
JOHNSON & JOHNSON	117,597	138.55	16,293,064.35
LILLY (ELI) & CO	39,427	118.35	4,666,185.45
MERCK & CO	113,944	82.46	9,395,822.24
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,064	790.88	841,496.32
MYLAN NV	23,155	17.40	402,897.00
NEKTAR THERAPEUTICS	7,098	33.00	234,234.00
PERKINELMER INC	4,410	92.92	409,777.20
PERRIGO CO PLC	5,954	44.02	262,095.08
PFIZER	245,086	42.92	10,519,091.12
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,411	306.72	1,046,221.92
SEATTLE GENETICS INC	5,163	70.55	364,249.65
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,857	9.26	406,115.82
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,607	281.69	4,959,715.83
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,513	173.51	1,997,620.63
WATERS CORP	3,288	208.77	686,435.76
ZOETIS INC	21,111	110.06	2,323,476.66
BANK OF AMERICA CORP	405,160	27.53	11,154,054.80

BB&T CORP	33,523	48.83	1,636,928.09
CIT GROUP INC	5,078	48.95	248,568.10
CITIGROUP	103,787	65.69	6,817,768.03
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,232	33.86	685,055.52
COMERICA INC	7,447	70.14	522,332.58
EAST WEST BANCORP INC	6,421	44.23	284,000.83
FIFTH THIRD BANCORP	34,171	26.83	916,807.93
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,006	97.94	686,167.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	13.26	656,529.12
JPMORGAN CHASE & CO	144,562	109.16	15,780,387.92
KEY CORP	44,407	16.71	742,040.97
M & T BANK CORP	6,028	165.76	999,201.28
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,184	15.98	242,640.32
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,539	132.88	2,729,222.32
REGIONS FINL CORP	46,000	13.88	638,480.00
SIGNATURE BANK	2,135	116.66	249,069.10
SUNTRUST BANKS	19,945	62.67	1,249,953.15
SVB FINANCIAL GROUP	2,318	212.94	493,594.92
US BANCORP	67,142	52.67	3,536,369.14
WELLS FARGO & CO	190,876	45.63	8,709,671.88
ZIONS BANCORPORATION	8,203	43.64	357,978.92
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,299	89.28	205,254.72
ALLY FINANCIAL INC	18,129	29.85	541,150.65
AMERICAN EXPRESS	31,625	121.11	3,830,103.75
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,178	149.87	925,896.86
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,436	20.87	238,669.32
BANK NEW YORK CO	37,952	44.40	1,685,068.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	57,635	205.81	11,861,859.35
BLACKROCK INC	5,288	444.11	2,348,453.68
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,946	90.26	1,890,585.96
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,031	111.31	560,000.61
CME GROUP INC	15,780	202.11	3,189,295.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,954	78.14	1,168,505.56
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,854	46.06	499,935.24
EATON VANCE CORP	5,267	40.34	212,470.78
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,538	292.16	449,342.08
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	33.64	496,122.72
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,617	189.81	2,774,452.77
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,929	85.38	2,128,438.02
INVESCO LTD	19,405	20.58	399,354.90
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	12,843	18.00	231,174.00
KKR & CO INC -A	21,470	23.96	514,421.20

MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,520	334.61	508,607.20
MOODY'S CORP	7,406	189.91	1,406,473.46
MORGAN STANLEY	57,267	42.70	2,445,300.90
MSCI INC	3,844	240.30	923,713.20
NASDAQ INC	5,565	96.16	535,130.40
NORTHERN TRUST CORP	9,149	88.27	807,582.23
PRICE T ROWE GROUP INC	10,375	105.69	1,096,533.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,365	83.75	449,318.75
S&P GLOBAL INC	11,118	224.67	2,497,881.06
SCHWAB (CHARLES) CORP	54,100	43.00	2,326,300.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	53.84	338,599.76
STATE STREET CORP	16,655	56.62	943,006.10
SYNCHRONY FINANCIAL	28,151	33.78	950,940.78
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,743	52.11	664,037.73
VOYA FINANCIAL INC	6,370	53.82	342,833.40
AFLAC	33,273	54.55	1,815,042.15
ALLEGHANY CORP	620	690.74	428,258.80
ALLSTATE CORP	15,101	100.72	1,520,972.72
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,005	100.88	303,144.40
AMERICAN INT'L GROUP	38,661	52.91	2,045,553.51
AON PLC	10,514	190.24	2,000,183.36
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,198	35.64	612,936.72
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,112	87.79	712,152.48
ASSURANT INC	2,482	104.34	258,971.88
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	43.03	280,426.51
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,534	37.96	172,110.64
CHUBB LTD	20,512	149.44	3,065,313.28
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,944	102.64	712,732.16
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	919	233.32	214,421.08
EVEREST RE GROUP LTD	1,724	252.65	435,568.60
FNF GROUP	12,232	39.81	486,955.92
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,057	54.97	882,653.29
LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	62.77	613,827.83
LOEWS CORP	12,517	53.84	673,915.28
MARKEL CORP	609	1,090.00	663,810.00
MARSH & MCLENNAN COS	21,834	99.18	2,165,496.12
METLIFE INC	35,850	48.33	1,732,630.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,999	55.37	719,754.63
PROGRESSIVE CORP	25,056	83.18	2,084,158.08
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,074	99.42	1,796,917.08
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,601	151.25	393,401.25
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,736	176.35	306,143.60

TORCHMARK CORP	4,553	88.87	404,625.11
TRAVELERS COS INC/THE	11,612	149.53	1,736,342.36
UNUM GROUP	9,797	33.51	328,297.47
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,957	186.88	1,113,244.16
WR BERKLEY CORP	5,743	64.31	369,332.33
CBRE GROUP INC-A	14,472	49.26	712,890.72
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,400	6.71	318,054.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	131.76	293,824.80
WEYERHAEUSER CO	34,135	23.79	812,071.65
ACCENTURE PLC-CL A	28,129	182.92	5,145,356.68
ADOBE INC	21,525	278.16	5,987,394.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,570	79.42	601,209.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,154	142.82	307,634.28
ANSYS INC	3,623	193.29	700,289.67
AUTODESK INC	9,411	165.30	1,555,638.30
AUTOMATIC DATA PROCESS	19,589	166.92	3,269,795.88
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,223	131.02	684,317.46
CADENCE DESIGN SYSTEMS	12,649	65.57	829,394.93
CDK GLOBAL INC	5,199	47.78	248,408.22
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,591	111.99	626,136.09
CITRIX SYSTEMS INC	5,700	95.86	546,402.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	25,224	62.78	1,583,562.72
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	129.11	167,843.00
DOCUSIGN INC	4,516	48.16	217,490.56
DROPBOX INC-CLASS A	8,461	23.03	194,856.83
DXC TECHNOLOGY CO	12,201	49.18	600,045.18
EPAM SYSTEMS INC	2,341	176.75	413,771.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,224	122.54	1,743,008.96
FIRST DATA CORP- CLASS A	23,472	26.63	625,059.36
FISERV INC	17,584	89.74	1,577,988.16
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,777	258.99	978,205.23
FORTINET INC	5,865	73.82	432,954.30
GARTNER INC	3,870	157.48	609,447.60
GLOBAL PAYMENTS INC	7,160	160.91	1,152,115.60
GODADDY INC - CLASS A	7,097	73.20	519,500.40
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,269	133.31	5,234,950.39
INTUIT INC	11,263	257.47	2,899,884.61
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,199	135.39	433,112.61
LEIDOS HOLDINGS	6,384	79.42	507,017.28
MASTERCARD INC-CLASS A	40,305	265.80	10,713,069.00
MICROSOFT CORP	322,104	131.40	42,324,465.60
MONGODB INC	1,494	169.97	253,935.18

OKTA INC	4,484	127.31	570,858.04
ORACLE CORP	110,872	53.26	5,905,042.72
PALO ALTO NETWORKS INC	4,133	195.54	808,166.82
PAYCHEX INC	14,576	87.60	1,276,857.60
PAYCOM SOFTWARE INC	2,192	222.45	487,610.40
PAYPAL HOLDINGS INC	49,185	114.02	5,608,073.70
PTC INC	5,381	88.76	477,617.56
RED HAT INC	7,991	185.44	1,481,851.04
SABRE CORP	10,169	21.62	219,853.78
SALESFORCE.COM INC	34,054	161.27	5,491,888.58
SERVICENOW INC	8,181	274.55	2,246,093.55
SPLUNK INC	6,291	111.34	700,439.94
SQUARE INC - A	13,794	68.46	944,337.24
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,353	58.40	546,215.20
SYMANTEC CORP	26,285	19.15	503,357.75
SYNOPSIS INC	6,658	123.90	824,926.20
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,182	125.21	398,418.22
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,332	129.10	946,561.20
TWILIO INC - A	4,129	144.11	595,030.19
VERISIGN INC	4,738	207.09	981,192.42
VISA INC-CLASS A SHARES	77,268	170.05	13,139,423.40
VMWARE INC-CLASS A	3,606	169.23	610,243.38
WESTERN UNION CO	20,387	20.15	410,798.05
WIX.COM LTD	2,000	144.78	289,560.00
WORKDAY INC-CLASS A	6,462	211.47	1,366,519.14
WORLDPAY INC-CLASS A	13,494	123.95	1,672,581.30
AMPHENOL CORPORATION	12,924	93.19	1,204,387.56
APPLE INC	208,225	190.15	39,593,983.75
ARISTA NETWORKS INC	2,252	246.44	554,982.88
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	66.58	256,399.58
CDW CORP/DE	6,846	104.86	717,871.56
CISCO SYSTEMS	194,349	55.93	10,869,939.57
COGNEX CORP	8,111	44.33	359,560.63
COMMSCOPE HOLDING CO INC	6,775	16.54	112,058.50
CORNING	36,416	30.58	1,113,601.28
DELL TECHNOLOGIES -C	6,194	54.30	336,334.20
F5 NETWORKS INC	2,755	140.43	386,884.65
FLEX LTD	21,868	9.51	207,964.68
FLIR SYSTEMS INC	5,527	50.70	280,218.90
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	65,377	14.09	921,161.93
HP INC	70,636	19.71	1,392,235.56
IPG PHOTONICS CORP	1,782	131.80	234,867.60

JUNIPER NETWORKS INC	16,308	26.74	436,075.92
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,361	82.13	686,688.93
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,260	163.58	1,187,590.80
NETAPP INC	10,843	61.30	664,675.90
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	43.56	512,570.52
TE CONNECTIVITY LTD	15,023	90.91	1,365,740.93
TRIMBLE IMS HOLDINGS	10,999	42.51	467,567.49
WESTERN DIGITAL CORP	13,413	36.94	495,476.22
XEROX CORP	9,091	34.16	310,548.56
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,538	188.37	478,083.06
AT&T INC	321,638	32.49	10,450,018.62
CENTURYLINK INC	43,253	10.54	455,886.62
SPRINT CORP	39,898	7.10	283,275.80
T-MOBILE US INC	15,154	77.03	1,167,312.62
VERIZON COMMUNICATIONS	182,469	57.24	10,444,525.56
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,950	32.68	325,166.00
AES CORP	27,865	16.70	465,345.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	10,283	49.00	503,867.00
AMEREN CORPORATION	10,875	75.88	825,195.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,740	89.54	1,946,599.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,011	116.29	931,599.19
ATMOS ENERGY CORP	4,707	104.21	490,516.47
CENTERPOINT ENERGY INC	22,540	28.82	649,602.80
CMS ENERGY CORP	12,638	57.79	730,350.02
CONSOLIDATED EDISON INC	14,002	88.31	1,236,516.62
DOMINION ENERGY INC	34,747	75.79	2,633,475.13
DTE ENERGY COMPANY	8,072	128.58	1,037,897.76
DUKE ENERGY CORP	32,025	87.04	2,787,456.00
EDISON INTL	14,680	62.64	919,555.20
ENTERGY CORP	8,099	100.60	814,759.40
EVERGY INC	11,198	60.48	677,255.04
EVERSOURCE ENERGY	14,253	76.30	1,087,503.90
EXELON CORP	43,521	49.95	2,173,873.95
FIRSTENERGY CORP	22,434	43.04	965,559.36
NEXTERA ENERGY INC	21,173	204.39	4,327,549.47
NISOURCE INC	16,007	28.54	456,839.78
NRG ENERGY INC	12,298	34.73	427,109.54
OGE ENERGY CORP	8,794	43.55	382,978.70
PINNACLE WEST CAPITAL	4,956	97.68	484,102.08
PPL CORPORATION	31,240	31.02	969,064.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	21,647	60.01	1,299,036.47
SEMPRA ENERGY	12,361	134.49	1,662,430.89

	SOUTHERN CO	45,673	54.71	2,498,769.83
	UGI CORP	7,302	53.71	392,190.42
	VISTRA ENERGY CORP	14,141	24.31	343,767.71
	WEC ENERGY GROUP INC	14,208	82.96	1,178,695.68
	XCEL ENERGY INC	22,910	59.43	1,361,541.30
	ADVANCED MICRO DEVICES	41,274	32.41	1,337,690.34
	ANALOG DEVICES	16,620	100.69	1,673,467.80
	APPLIED MATERIALS	41,828	41.51	1,736,280.28
	BROADCOM INC	17,478	274.87	4,804,177.86
	INTEL CORP	198,509	46.03	9,137,369.27
	KLA-TENCOR CORP	7,032	109.42	769,441.44
	LAM RESEARCH CORP	6,718	186.68	1,254,116.24
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	25,681	24.05	617,628.05
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,629	56.53	713,917.37
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,561	83.67	883,638.87
	MICRON TECHNOLOGY	49,463	33.99	1,681,247.37
	NVIDIA CORP	25,398	145.50	3,695,409.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,849	92.64	1,190,331.36
	ON SEMICONDUCTOR CORP	19,013	19.06	362,387.78
	QORVO INC	5,629	64.38	362,395.02
	QUALCOMM	53,957	68.69	3,706,306.33
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,199	70.15	575,159.85
	TEXAS INSTRUMENTS	41,459	111.17	4,608,997.03
	XILINX INC	11,010	107.49	1,183,464.90
	アメリカドル 小計	13,379,726		1,085,107,925.40 (117,755,912,064)
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	13.65	261,888.90
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,225	35.50	1,924,987.50
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	10.94	548,695.70
	ENBRIDGE	90,282	47.14	4,255,893.48
	ENCANA CORP	56,301	6.70	377,216.70
	HUSKY ENERGY INC	12,746	12.47	158,942.62
	IMPERIAL OIL	11,645	36.43	424,227.35
	INTER PIPELINE LTD	18,856	20.42	385,039.52
	KEYERA CORP	7,525	32.30	243,057.50
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,276	48.40	1,126,558.40
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,703	17.59	170,675.77
	SUNCOR ENERGY	68,780	40.52	2,786,965.60
	TC ENERGY CORP	40,558	66.63	2,702,379.54
	TOURMALINE OIL CORP	12,981	16.98	220,417.38
	VERMILION ENERGY INC	6,153	28.45	175,052.85
	AGNICO EAGLE MINES	11,064	61.34	678,665.76

BARRICK GOLD CORP	73,767	18.01	1,328,543.67
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	63.80	465,867.60
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,625	10.69	348,761.25
FRANCO-NEVADA CORP	8,688	102.89	893,908.32
KINROSS GOLD CORP	60,197	4.61	277,508.17
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	7,500	49.86	373,950.00
LUNDIN MINING CORP	30,173	6.31	190,391.63
METHANEX CORP	2,991	56.05	167,645.55
NUTRIEN LTD	26,842	68.65	1,842,703.30
TECK RESOURCES LTD-CL B	21,579	28.38	612,412.02
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,615	54.25	141,863.75
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,916	30.47	515,430.52
BOMBARDIER B	104,404	2.07	216,116.28
CAE INC	9,539	34.40	328,141.60
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	23.98	210,424.50
WSP GLOBAL INC	5,400	71.20	384,480.00
THOMSON REUTERS CORP	9,046	88.81	803,375.26
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,711	121.15	3,841,787.65
CP RAILWAY LIMITED	6,333	311.71	1,974,059.43
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,849	59.43	882,476.07
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	48.96	489,600.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	11,055	89.03	984,226.65
STARS GROUP INC/THE	9,180	22.41	205,723.80
QUEBECOR INC -CL B	6,100	31.98	195,078.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,409	27.71	593,243.39
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,526	135.40	342,020.40
DOLLARAMA INC	12,978	42.80	555,458.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	18,698	85.40	1,596,809.20
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	31.00	227,230.00
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	70.75	641,561.00
METRO INC	11,606	50.20	582,621.20
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	103.01	381,652.05
SAPUTO INC	10,742	40.13	431,076.46
AURORA CANNABIS INC	30,000	10.13	303,900.00
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	28.26	411,013.44
CANOPY GROWTH CORP	8,800	56.11	493,768.00
CRONOS GROUP INC	8,200	21.12	173,184.00
BANK MONTREAL	28,847	98.97	2,854,987.59
BANK NOVA SCOTIA	53,557	70.40	3,770,412.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	19,509	103.48	2,018,791.32
NATIONAL BANK OF CANADA	14,068	61.89	870,668.52
ROYAL BANK OF CANADA	63,082	103.22	6,511,324.04

	TORONTO-DOMINION BANK	80,093	75.33	6,033,405.69
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	37,208	63.41	2,359,359.28
	CI FINANCIAL CORP	9,872	20.96	206,917.12
	IGM FINANCIAL INC	3,890	37.34	145,252.60
	ONEX CORP	3,102	75.36	233,766.72
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,189	633.37	753,076.93
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,567	30.90	357,420.30
	IA FINANCIAL CORP INC	3,734	51.61	192,711.74
	INTACT FINANCIAL CORP	6,633	118.67	787,138.11
	MANULIFE FINANCIAL CORP	87,856	23.73	2,084,822.88
	POWER CORP OF CANADA	13,509	28.30	382,304.70
	POWER FINANCIAL CORP	12,518	30.33	379,670.94
	SUN LIFE FINANCIAL INC	26,701	53.83	1,437,314.83
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	22.07	154,490.00
	BLACKBERRY LIMITED	25,075	10.55	264,541.25
	CGI INC - CL A	10,929	100.17	1,094,757.93
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	862	1,182.79	1,019,564.98
	OPEN TEXT CORP	10,909	54.64	596,067.76
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,154	405.69	1,685,236.26
	BCE INC	7,663	62.24	476,945.12
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,589	70.92	1,105,571.88
	TELUS CORP	11,560	50.07	578,809.20
	ALTAGAS INCOME LTD	8,078	19.60	158,328.80
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	46.00	201,112.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	38.30	228,957.40
	EMERA INC	1,710	53.10	90,801.00
	FORTIS INC	19,700	51.87	1,021,839.00
	HYDRO ONE LTD	14,740	22.92	337,840.80
	カナダドル 小計	1,795,883		81,242,886.62 (6,641,605,981)
ユーロ	ENAGAS	8,653	25.43	220,045.79
	ENI	113,983	13.96	1,591,202.68
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	13.64	323,686.69
	NESTE OIL OYJ	17,466	30.12	526,075.92
	OMV AG	5,641	42.38	239,065.58
	REPSOL SA	61,264	14.66	898,130.24
	SNAM SPA	91,077	4.72	430,520.97
	TENARIS SA	19,529	10.73	209,643.81
	TOTAL SA	106,930	47.79	5,110,719.35
	VOPAK	3,661	37.63	137,763.43
	AIR LIQUIDE	18,583	116.90	2,172,352.70
	AKZO NOBEL	9,943	79.14	786,889.02

ARCELORMITTAL	30,928	13.48	417,033.15
ARKEMA	3,446	75.96	261,758.16
BASF SE	41,168	61.28	2,522,775.04
COVESTRO AG	8,327	41.37	344,487.99
CRH PLC	36,044	28.57	1,029,777.08
EVONIK INDUSTRIES AG	6,772	24.20	163,882.40
FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	35.20	114,259.20
HEIDELBERGCEMENT AG	6,759	67.80	458,260.20
IMERYS SA	2,111	39.96	84,355.56
KONINKLIJKE DSM NV	7,836	104.15	816,119.40
LANXESS	3,921	46.30	181,542.30
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,350	25.53	264,235.50
SOLVAY SA	2,897	86.58	250,822.26
STORA ENSO OYJ R	23,291	9.39	218,795.65
SYMRISE AG	5,350	87.90	470,265.00
THYSSEN KRUPP	18,959	11.67	221,251.53
UMICORE	9,946	26.77	266,254.42
UPM KYMMENE OYJ	23,447	22.45	526,385.15
VOESTALPINE AG	5,948	24.03	142,930.44
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,360	37.30	386,428.00
AIRBUS SE	26,294	120.92	3,179,470.48
ALSTOM	6,679	41.83	279,382.57
ANDRITZ AG	3,617	32.60	117,914.20
BOUYGUES ORD	9,144	31.65	289,407.60
BRENTAG AG	7,062	43.00	303,666.00
CNH INDUSTRIAL NV	43,124	8.06	347,579.44
DASSAULT AVIATION SA	121	1,222.00	147,862.00
EIFFAGE	3,707	87.76	325,326.32
FERROVIAL SA	20,441	21.67	442,956.47
GEA GROUP AG	7,649	25.15	192,372.35
HOCHTIEF AG	998	106.90	106,686.20
KINGSPAN GROUP PLC	5,706	47.16	269,094.96
KION GROUP AG	3,430	50.48	173,146.40
KNORR-BREMSE AG	1,738	98.75	171,627.50
KONE OYJ-B	14,855	49.27	731,905.85
LEGRAND SA	12,078	61.94	748,111.32
LEONARDO SPA	22,011	10.53	231,885.88
METSO OYJ	4,950	30.13	149,143.50
MTU AERO ENGINES AG	2,433	201.30	489,762.90
PRYSMIAN SPA	11,275	16.60	187,221.37
SAFRAN SA	14,464	122.35	1,769,670.40
SAINT-GOBAIN	22,629	33.56	759,542.38

SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,645	73.16	1,729,868.20
SIEMENS	33,595	104.24	3,501,942.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	14.43	177,868.07
THALES SA	4,691	102.80	482,234.80
VINCI S.A.	21,944	90.28	1,981,104.32
WARTSILA OYJ	18,738	13.08	245,093.04
BUREAU VERITAS SA	13,374	21.12	282,458.88
EDENRED	10,133	42.55	431,159.15
RANDSTAD NV	5,866	47.17	276,699.22
SOCIETE BIC SA	1,751	70.05	122,657.55
TELEPERFORMANCE	2,616	175.80	459,892.80
WOLTERS KLUWER	12,729	64.02	814,910.58
ADP	1,532	153.40	235,008.80
AENA SME SA	2,696	172.50	465,060.00
ATLANTIA SPA	21,349	23.12	493,588.88
BOLLORE	37,200	3.92	146,121.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,748	17.58	171,418.58
DEUTSCHE POST AG-REG	44,062	27.32	1,203,773.84
FRAPORT AG	1,934	74.50	144,083.00
GETLINK	18,631	14.08	262,324.48
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,831	62.32	924,267.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	53.00	136,846.00
CONTINENTAL AG	4,832	124.20	600,134.40
DAIMLER AG	40,787	47.60	1,941,665.13
FAURECIA	3,558	34.87	124,067.46
FERRARI NV	5,161	132.85	685,638.85
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,762	11.67	592,392.54
MICHELIN	7,746	104.05	805,971.30
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	26.14	160,943.98
PEUGEOT SA	26,059	20.54	535,251.86
PIRELLI & C SPA	20,549	5.19	106,649.31
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,141	56.50	403,466.50
RENAULT SA	8,523	53.69	457,599.87
VALEO SA	10,585	24.38	258,062.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,341	141.88	1,183,421.08
VOLKSWAGEN STAMM	1,238	145.10	179,633.80
ADIDAS AG	7,731	265.25	2,050,647.75
ESSILORLUXOTTICA	13,066	107.00	1,398,062.00
HERMES INTERNATIONAL	1,412	611.40	863,296.80
HUGO BOSS AG	3,285	53.62	176,141.70
KERING	3,286	479.60	1,575,965.60
LVMH	12,385	357.05	4,422,064.25

MONCLER SPA	7,343	34.70	254,802.10
PUMA AG	349	557.00	194,393.00
SEB SA	1,191	152.90	182,103.90
ACCOR	7,846	34.25	268,725.50
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,702	66.12	178,656.24
SODEXO	3,785	104.15	394,207.75
AXEL SPRINGER SE	2,214	56.05	124,094.70
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	16.19	140,448.25
JC DECAUX SA	3,750	25.98	97,425.00
PUBLICIS GROUPE	9,131	49.58	452,714.98
RTL GROUP	2,176	43.88	95,482.88
SES	16,206	13.91	225,506.49
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	49.24	139,398.44
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,479	73.00	253,967.00
VIVENDI	42,396	24.44	1,036,158.24
DELIVERY HERO SE	4,800	38.29	183,792.00
INDITEX	48,248	25.08	1,210,059.84
ZALANDO SE	4,976	36.16	179,932.16
CARREFOUR	25,231	16.78	423,376.18
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	32.38	106,789.24
COLRUYT SA	2,228	67.50	150,390.00
JERONIMO MARTINS	13,062	14.56	190,182.72
KONINKLIJKE AHOLD NV	51,403	20.42	1,049,649.26
METRO AG	8,880	14.49	128,715.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,377	75.47	2,518,962.19
DANONE (GROUPE)	26,663	72.26	1,926,668.38
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	8.78	233,969.44
HEINEKEN HOLDING NV	4,955	90.90	450,409.50
HEINEKEN NV	11,372	97.10	1,104,221.20
KERRY GROUP PLC-A	6,639	105.90	703,070.10
PERNOD-RICARD	9,206	160.20	1,474,801.20
REMY COINTREAU	1,020	120.80	123,216.00
BEIERSDORF AG	4,768	105.45	502,785.60
HENKEL AG & CO KGAA	4,514	78.60	354,800.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	7,927	83.52	662,063.04
LOREAL	10,959	245.10	2,686,050.90
UNILEVER NV-CVA	64,041	54.14	3,467,179.74
BIOMERIEUX	1,835	74.50	136,707.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,352	86.95	117,556.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,583	66.32	635,544.56
FRESENIUS SE&CO KGAA	18,774	45.90	861,726.60
KONINKLIJKE PHILIPS	41,751	35.43	1,479,237.93

SARTORIUS AG-VORZUG	1,250	174.80	218,500.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,294	36.18	227,716.92
BAYER	41,799	52.87	2,209,913.13
EUROFINS SCIENTIFIC	389	368.60	143,385.40
GRIFOLS SA	11,921	24.26	289,203.46
IPSEN	1,866	112.70	210,298.20
MERCK KGAA	5,323	89.46	476,195.58
ORION OYJ-CLASS B	5,393	30.58	164,917.94
QIAGEN N.V.	11,006	34.45	379,156.70
RECORDATI SPA	5,195	38.10	197,929.50
SANOFI	50,194	78.32	3,931,194.08
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,200	129.00	154,800.00
UCB (GROUPE)	5,104	68.92	351,767.68
ABN AMRO GROUP NV-CVA	19,718	19.09	376,515.21
AIB GROUP PLC	37,786	3.61	136,709.74
BANCO BILBAO VIZCAYA	286,929	4.92	1,412,551.46
BANCO DE SABADELL SA	216,777	0.94	203,857.09
BANCO SANTANDER SA	707,738	3.96	2,805,827.30
BANK OF IRELAND GROUP PLC	46,790	4.65	217,573.50
BANKIA SA	59,546	2.17	129,631.64
BANKINTER SA	24,407	6.35	155,082.07
BNP PARIBAS	49,994	40.81	2,040,505.11
CAIXABANK	152,587	2.61	399,167.59
COMMERZBANK AG	46,733	6.25	292,127.98
CREDIT AGRICOLE SA	51,640	10.29	531,375.60
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	32.06	449,128.54
FINECOBANK SPA	18,971	9.30	176,430.30
ING GROEP NV-CVA	170,047	9.85	1,675,813.18
INTESA SANPAOLO	647,852	1.83	1,187,383.14
KBC GROEP NV	10,861	57.80	627,765.80
MEDIOBANCA	29,447	8.43	248,355.99
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	20.52	161,410.32
SOCIETE GENERALE	33,271	22.10	735,455.45
UNICREDIT SPA	89,297	10.02	894,755.94
AMUNDI SA	2,812	58.75	165,205.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	87,471	5.96	521,851.98
DEUTSCHE BOERSE	8,615	126.35	1,088,505.25
EURAZEO SA	2,340	63.85	149,409.00
EXOR NV	4,379	58.72	257,134.88
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,728	84.94	316,656.32
NATIXIS	40,748	4.00	162,992.00
WENDEL	1,047	116.60	122,080.20

AEGON	76,385	4.22	322,726.62
AGEAS	7,693	44.39	341,492.27
ALLIANZ SE-REG	18,665	204.30	3,813,259.50
ASSICURAZIONI GENERALI	51,245	15.85	812,489.47
AXA	84,125	22.40	1,884,400.00
CNP ASSURANCES	8,406	19.82	166,606.92
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,358	139.60	329,176.80
MAPFRE SA	56,454	2.66	150,506.36
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,824	221.10	1,508,786.40
NN GROUP NV	14,216	36.18	514,334.88
POSTE ITALIANE SPA	25,777	9.10	234,622.25
SAMPO OYJ-A SHS	19,591	40.07	785,011.37
SCOR SE	6,580	38.22	251,487.60
AROUNDTOWN SA	35,430	7.50	265,725.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,109	35.81	576,863.29
VONOVIA SE	21,618	44.72	966,756.96
ADYEN NV	400	707.80	283,120.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	19,420	71.40	1,386,588.00
ATOS SE	4,174	70.12	292,680.88
CAPGEMINI SA	7,143	99.36	709,728.48
DASSAULT SYSTEMES SA	5,884	135.35	796,399.40
SAP SE	43,230	113.72	4,916,115.60
WIRECARD AG	5,219	146.55	764,844.45
WORLDLINE SA	2,854	58.85	167,957.90
INGENICO GROUP	3,351	75.96	254,541.96
NOKIA OYJ	251,415	4.44	1,116,911.13
1&1 DRILLISCH AG	2,406	27.06	65,106.36
CELLNEX TELECOM SA	7,114	31.65	225,158.10
DEUTSCHE TELEKOM	149,447	15.38	2,299,690.43
ELISA A	7,434	41.65	309,626.10
ILIAD SA	1,337	101.85	136,173.45
KPN (KON.)	142,629	2.85	406,635.27
ORANGE	86,416	13.72	1,186,059.60
PROXIMUS	7,531	26.16	197,010.96
TELECOM ITALIA ORD	534,432	0.44	239,318.64
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.42	147,264.02
TELEFONICA	207,234	7.47	1,548,037.98
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.55	104,568.48
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	32.52	191,510.28
E.ON SE	98,112	9.92	973,761.60
ELECTRICITE DE FRANCE	24,433	12.65	309,077.45
ENDESA	12,358	23.58	291,401.64

	ENEL	363,911	5.89	2,143,799.70
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	118,885	3.47	413,006.49
	ENGIE	83,020	13.21	1,097,109.30
	FORTUM OYJ	19,008	19.41	369,040.32
	IBERDROLA SA	254,637	8.87	2,258,630.19
	INNOGY SE	6,865	41.60	285,584.00
	NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	25.90	366,407.30
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,346	19.67	341,195.82
	RWE STAMM	21,261	23.47	498,995.67
	SUEZ	17,194	12.48	214,667.09
	TERNA SPA	66,644	5.74	382,536.56
	UNIPER SE	8,984	26.31	236,369.04
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	21.34	530,320.34
	VERBUND AG	3,100	46.18	143,158.00
	ASML HOLDING NV	18,482	173.80	3,212,171.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	50,873	14.92	759,330.39
	STMICROELECTRONICS	29,889	14.12	422,182.12
	ユーロ 小計	8,712,978		166,025,125.79 (20,392,866,200)
イギリスポンド	BP PLC	890,579	5.51	4,914,214.92
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	196,886	25.23	4,967,433.78
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	166,963	25.30	4,224,998.71
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	33,000	4.02	132,891.00
	ANGLO AMERICAN PLC	46,963	19.73	926,955.69
	ANTOFAGASTA PLC	16,971	8.05	136,616.55
	BHP GROUP PLC	91,562	18.24	1,670,274.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,497	52.00	285,844.00
	EVRAZ PLC	16,686	6.33	105,622.38
	FRESNILLO PLC	10,869	8.12	88,256.28
	GLENCORE PLC	509,769	2.60	1,329,987.32
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,385	31.43	263,540.55
	MONDI PLC	15,660	16.78	262,853.10
	RIO TINTO PLC REG	51,066	45.18	2,307,417.21
	ASHTREAD GROUP PLC	22,351	19.54	436,738.54
	BAE SYSTEMS PLC	144,528	4.76	687,953.28
	BUNZL PLC	14,890	21.79	324,453.10
	DCC PLC	4,508	68.56	309,068.48
	FERGUSON PLC	10,326	53.48	552,234.48
	MEGGITT PLC	31,622	5.11	161,778.15
	MELROSE INDUSTRIES PLC	208,890	1.70	356,470.78
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	74,095	9.09	673,819.93
	SMITHS GROUP PLC	20,046	14.84	297,582.87

SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,872	85.60	245,843.20
WEIR GROUP PLC/THE	12,587	14.81	186,476.40
EXPERIAN PLC	38,764	24.00	930,336.00
G4S PLC	77,964	2.14	167,388.70
INTERTEK GROUP PLC	7,061	54.32	383,553.52
RELX PLC	85,706	18.72	1,604,416.32
RENTOKIL INITIAL PLC	72,952	3.78	276,123.32
EASYJET PLC	9,909	9.10	90,171.90
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.65	288,025.70
BURBERRY GROUP PLC	18,236	17.82	324,965.52
PERSIMMON PLC	13,492	20.41	275,371.72
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.57	261,442.57
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	35.66	233,573.00
CARNIVAL PLC	8,185	39.28	321,506.80
COMPASS GROUP PLC	68,629	18.44	1,265,861.90
GVC HOLDINGS PLC	20,500	6.31	129,519.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,472	52.15	389,664.80
MERLIN ENTERTAINME	30,924	3.73	115,624.83
TUI AG-DI	17,558	7.43	130,491.05
WHITBREAD PLC	7,881	47.20	371,983.20
AUTO TRADER GROUP PLC	42,371	5.96	252,700.64
INFORMA PLC	54,925	7.91	434,786.30
ITV PLC	154,979	1.08	168,229.70
PEARSON	33,153	7.99	265,091.38
WPP PLC	56,653	9.88	559,958.25
KINGFISHER PLC	90,095	2.09	188,658.93
MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	2.20	181,623.64
NEXT PLC	6,461	57.16	369,310.76
OCADO GROUP PLC	16,600	11.13	184,758.00
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	1.95	218,933.50
SAINSBURY (J) PLC	82,018	1.97	161,903.53
TESCO	441,556	2.29	1,012,929.46
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,323	25.24	386,752.52
BRITISH AMERICAN TOBACCO	102,261	30.14	3,082,146.54
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	29.12	265,428.80
DIAGEO	107,795	34.07	3,672,575.65
IMPERIAL BRANDS PLC	41,332	20.73	856,812.36
RECKITT BENCKISER PLC	30,716	63.95	1,964,288.20
UNILEVER PLC	49,297	49.14	2,422,454.58
NMC HEALTH PLC	4,750	22.00	104,500.00
SMITH & NEPHEW PLC	39,534	16.93	669,310.62
ASTRAZENECA	56,458	60.28	3,403,288.24

	GLAXOSMITHKLINE	221,189	15.65	3,462,050.22
	BARCLAYS	741,595	1.51	1,120,253.40
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	887,685	6.50	5,777,941.66
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,125,749	0.57	1,800,743.99
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	205,762	2.14	441,359.49
	STANDARD CHARTERED PLC	125,164	6.92	866,134.88
	3I GROUP PLC	42,422	10.55	447,764.21
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,976	19.39	232,274.52
	INVESTEC PLC	32,355	4.67	151,227.27
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	13,833	54.12	748,641.96
	SCHRODERS PLC	5,525	29.62	163,650.50
	ST JAMES' S PLACE PLC	26,728	10.44	279,173.96
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	105,646	2.75	290,949.08
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	20.90	206,324.80
	AVIVA PIC	181,949	4.17	758,727.33
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.28	225,850.96
	LEGAL & GENERAL GROUP	269,808	2.70	728,481.60
	PRUDENTIAL	112,358	16.24	1,824,693.92
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	5.70	294,753.48
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,136	19.39	293,487.04
	SAGE GROUP PLC	46,955	7.54	354,322.43
	HALMA PLC	16,936	18.92	320,429.12
	BT GROUP PLC	382,244	2.07	792,009.56
	VODAFONE GROUP PLC	1,191,443	1.29	1,547,684.45
	CENTRICA PLC	239,385	0.95	229,474.46
	NATIONAL GRID PLC	145,466	8.22	1,197,039.71
	SEVERN TRENT PLC	11,927	20.78	247,843.06
	SSE PLC	45,896	11.20	514,264.68
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	8.34	289,809.16
	イギリス債券 小計	13,316,283		79,843,147.05 (11,023,943,313)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	18.63	163,018.98
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	619.50	252,756.00
	GIVAUDAN-REG	401	2,729.00	1,094,329.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	21,140	49.52	1,046,852.80
	SIKA AG-BR	5,812	154.80	899,697.60
	ABB LTD	81,841	19.09	1,562,344.69
	GEBERIT AG-REG	1,662	452.40	751,888.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	208.40	189,852.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,651	214.50	354,139.50
	ADECCO GROUP AG-REG	6,618	55.38	366,504.84
	SGS SA	225	2,585.00	581,625.00

	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,431	135.35	329,035.85	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	23,231	78.62	1,826,421.22	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,228	265.10	325,542.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	50.80	152,603.20	
	DUFREY AG-REG	1,811	82.88	150,095.68	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	1,983.00	198,300.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	78,200.00	391,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	48	6,910.00	331,680.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	135,009	101.40	13,689,912.60	
	ALCON INC	19,395	58.34	1,131,504.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	221.00	590,512.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	839.40	402,912.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,226	321.30	1,036,513.80	
	NOVARTIS	95,440	87.30	8,331,912.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	30,931	269.40	8,332,811.40	
	VIFOR PHARMA AG	2,126	140.50	298,703.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	113,429	11.39	1,291,956.31	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,752	40.07	430,832.64	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	74.50	170,530.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	766	706.40	541,102.40	
	UBS GROUP AG	172,537	11.63	2,006,605.31	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	171.60	400,514.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,587	468.60	743,668.20	
	SWISS RE LTD	13,799	98.86	1,364,169.14	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,775	334.10	2,263,527.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	82.35	298,271.70	
	TEMENOS AG - REG	2,443	175.80	429,479.40	
	SWISSCOM	1,063	493.40	524,484.20	
	スイスフラン 小計	781,950		55,247,611.16 (6,054,585,707)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	260.10	2,405,925.00	
	BOLIDEN AB	13,081	222.40	2,909,214.40	
	BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	13,081	4.24	55,528.84	
	ALFA LAVAL AB	14,233	199.55	2,840,195.15	
	ASSA ABLOY AB-B	43,306	197.85	8,568,092.10	
	ATLAS COPCO A	28,978	266.30	7,716,841.40	
	ATLAS COPCO B	18,786	242.80	4,561,240.80	
	EPIROC AB-A	26,536	93.04	2,468,909.44	
	EPIROC AB-B	12,127	89.14	1,081,000.78	
	SANDVIK AB	48,851	154.60	7,552,364.60	
	SKANSKA B	13,987	163.35	2,284,776.45	
	SKF AB-B	18,340	156.30	2,866,542.00	

	VOLVO B	63,885	138.20	8,828,907.00	
	SECURITAS B	15,577	164.25	2,558,522.25	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,955	221.90	1,987,114.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	82.86	1,809,745.26	
	HENNES & MAURITZ B	32,859	149.44	4,910,448.96	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	393.60	1,857,398.40	
	SWEDISH MATCH AB	6,770	433.00	2,931,410.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	25,364	289.80	7,350,487.20	
	NORDEA BANK ABP	134,014	68.91	9,234,904.74	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	69,722	87.26	6,083,941.72	
	SVENSKA HANDELSBK A	65,730	91.94	6,043,216.20	
	SWEDBANK AB-A	39,241	139.45	5,472,157.45	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	198.15	1,710,232.65	
	INVESTOR AB-B SHS	19,673	425.60	8,372,828.80	
	KINNEVIK AB - B	11,182	250.00	2,795,500.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,030	331.40	672,742.00	
	ERICSSON (LM) B	134,339	93.60	12,574,130.40	
	HEXAGON AB-B SHS	12,400	469.90	5,826,760.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,225	516.00	1,664,100.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,919	131.10	2,480,280.90	
	TELIA CO AB	133,145	40.65	5,412,344.25	
	スウェーデンクローナ 小計	1,092,777		145,887,803.64 (1,683,545,254)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,500	236.50	1,300,750.00	
	EQUINOR ASA	42,951	170.60	7,327,440.60	
	NORSK HYDRO	61,358	31.59	1,938,299.22	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,407	393.00	2,910,951.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	228.40	1,074,850.40	
	MOWI ASA	18,884	208.00	3,927,872.00	
	ORKLA	33,665	76.94	2,590,185.10	
	DNB ASA	43,059	152.90	6,583,721.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	175.00	1,951,775.00	
	TELENOR ASA	32,710	185.20	6,057,892.00	
	ノルウェークローネ 小計	261,393		35,663,736.42 (448,649,804)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,151	724.20	3,006,154.20	
	NOVOZYMES A/S	9,595	306.10	2,937,029.50	
	VESTAS WIND SYSEMS	9,068	548.40	4,972,891.20	
	ISS A/S	6,102	196.70	1,200,263.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	6,915.00	1,376,085.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	270	7,292.00	1,968,840.00	
	DSV A/S	8,200	611.20	5,011,840.00	

	PANDORA A/S	5,549	230.40	1,278,489.60
	CARLSBERG AS-B	5,005	895.40	4,481,477.00
	COLOPLAST-B	5,071	739.00	3,747,469.00
	DEMANT A/S	4,463	225.80	1,007,745.40
	GENMAB A/S	2,406	1,176.00	2,829,456.00
	H LUNDBECK A/S	3,647	256.60	935,820.20
	NOVO NORDISK A/S-B	75,451	323.75	24,427,261.25
	DANSKE BANK A/S	32,879	109.75	3,608,470.25
	TRYG A/S	5,192	215.00	1,116,280.00
	ORSTED A/S	8,810	560.60	4,938,886.00
	デンマーククローネ 小計	186,058		68,844,458.00 (1,132,491,334)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	26.19	335,781.99
	OIL SEARCH LTD	52,747	6.93	365,536.71
	ORIGIN ENERGY LIMITED	72,570	7.08	513,795.60
	SANTOS	83,906	6.79	569,721.74
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	21.89	106,057.05
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,887	34.64	1,450,965.68
	WORLEYPARSONS LTD	14,417	13.39	193,043.63
	ALUMINA LIMITED	75,453	2.41	181,841.73
	AMCOR PLC-CDI	51,848	15.72	815,050.56
	BHP GROUP LTD	131,644	37.84	4,981,408.96
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	10.93	235,530.57
	BORAL LIMITED	42,845	5.28	226,221.60
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	57,536	7.85	451,657.60
	INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.42	277,847.64
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	15,221	18.30	278,544.30
	NEWCREST MINING LIMITED	30,755	28.57	878,670.35
	ORICA LTD	19,570	20.71	405,294.70
	RIO TINTO LTD	15,767	98.00	1,545,166.00
	SOUTH32 LTD	216,184	3.24	700,436.16
	CIMIC GROUP LIMITED	2,943	44.51	130,992.93
	BRAMBLES LTD	63,458	12.73	807,820.34
	SEEK LTD	17,113	21.00	359,373.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	5.21	487,676.84
	TRANSURBAN GROUP	112,078	14.26	1,598,232.28
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,733	29.51	759,380.83
	CROWN RESORTS LTD	18,801	12.35	232,192.35
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,974	38.39	114,171.86	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	42.47	126,900.36	
TABCORP HOLDINGS LTD	90,583	4.48	405,811.84	
REA GROUP LTD	3,000	90.35	271,050.00	

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	4.15	153,637.15	
	WESFARMERS LTD	50,229	37.65	1,891,121.85	
	COLES GROUP LTD	50,229	12.94	649,963.26	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	57,160	31.51	1,801,111.60	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	9.86	218,359.56	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	14.94	515,131.20	
	COCHLEAR LIMITED	2,282	200.39	457,289.98	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,371	70.53	378,816.63	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,089	26.48	505,476.72	
	CSL LIMITED	20,235	203.80	4,123,893.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	124,005	28.37	3,518,021.85	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	9.51	181,621.98	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	11.50	274,608.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	77,408	80.00	6,192,640.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	123,216	26.90	3,314,510.40	
	WESTPAC BANKING	150,107	27.98	4,199,993.86	
	AMP LTD	113,052	2.13	240,800.76	
	ASX LTD	7,739	79.29	613,625.31	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	7.98	243,637.38	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	14,169	119.21	1,689,086.49	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	96,651	7.59	733,581.09	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	102,821	3.35	344,450.35	
	QBE INSURANCE GROUP	54,883	11.67	640,484.61	
	SUNCORP GROUP LIMITED	60,266	13.20	795,511.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	16.69	366,679.30	
	TELSTRA CORP	186,467	3.72	693,657.24	
	TPG TELECOM LTD	22,697	6.39	145,033.83	
	AGL ENERGY LTD	26,594	20.91	556,080.54	
	AUSNET SERVICES	47,066	1.85	87,307.43	
	オーストラリアドル 小計	3,076,943		55,332,308.27 (4,196,402,259)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	49,092	5.27	258,714.84	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	8.69	426,800.66	
	A2 MILK CO LTD	28,382	14.40	408,700.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,518	15.64	414,741.52	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	11.38	250,360.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	66,673	3.78	252,357.30	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.38	280,468.92	
	ニュージーランドドル 小計	305,813		2,292,144.04 (165,584,485)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	120,448	75.85	9,135,980.80	
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	15.28	1,123,080.00	

	MTR CORP	68,000	48.30	3,284,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	57,500	51.90	2,984,250.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	20.90	982,300.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	88,000	46.80	4,118,400.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	11.52	695,808.00	
	SANDS CHINA LTD	104,600	34.95	3,655,770.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	38,000	9.50	361,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	42,000	8.67	364,140.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	15.64	950,912.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	24,000	43.55	1,045,200.00	
	WH GROUP LTD	363,500	7.22	2,624,470.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	24.00	1,127,136.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	162,500	30.35	4,931,875.00	
	HANG SENG BANK	33,700	195.10	6,574,870.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,500	250.60	13,156,500.00	
	AIA GROUP LTD	537,000	74.30	39,899,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,948	58.40	6,654,563.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	72,000	17.16	1,235,520.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,761	40.65	2,307,334.65	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	40.40	1,252,400.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	30.25	1,119,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	11.86	3,617,300.00	
	SINO LAND CO	128,600	12.86	1,653,796.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	126.40	8,848,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	96.15	1,923,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	40,600	33.45	1,358,070.00	
	WHARF HOLDINGS	61,000	20.45	1,247,450.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	54.20	3,306,200.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	40,000	52.60	2,104,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.60	975,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	62.50	2,000,000.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	88.70	6,430,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	446,457	16.92	7,554,052.44	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	59,000	55.10	3,250,900.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	73.80	863,460.00	
	香港ドル 小計	3,850,978		154,716,438.09 (2,141,275,503)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	57,500	6.05	347,875.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	2.36	146,320.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.08	305,184.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	117,400	1.40	164,360.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.50	284,750.00	

	SINGAPORE AIRLINES	17,500	9.16	160,300.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	14,600	4.98	72,708.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.86	276,540.50	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	2.33	197,001.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	34.98	160,908.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.27	131,414.40	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	3.35	257,280.00	
	DBS GROUP	79,000	24.39	1,926,810.00	
	OCBC BANK	136,050	10.64	1,447,572.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	58,100	24.23	1,407,763.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	7.49	318,325.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.27	388,803.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	8.47	186,340.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.94	172,112.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	15.39	220,077.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	347,180	3.28	1,138,750.40	
	シンガポールドル 小計	2,272,900		9,711,193.80 (772,622,578)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	18.40	524,105.60	
	ELBIT SYSTEMS LTD	732	523.50	383,202.00	
	BANK HAPOLIM BM	43,070	25.45	1,096,131.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,200	24.68	1,461,056.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	38,227	13.80	527,532.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	80.39	504,206.08	
	AZRIELI GROUP	1,471	223.80	329,209.80	
	NICE LTD	2,295	491.00	1,126,845.00	
	イスラエルシェケル 小計	179,751		5,952,288.58 (180,592,435)	
	合 計	49,213,433		172,590,076,917 (172,590,076,917)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	46,179	498,733.20	
		LENDLEASE GROUP	27,483	358,103.49	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	409,754.00	
		オーストラリアドル 小計	127,577	1,266,590.69 (96,058,237)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,002,300.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,342,100.00	
			315,000	3,344,400.00	

		香港ドル 小計		(46,286,496)
投資信託受益証券合計			442,577	142,344,733 (142,344,733)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	23,507	393,742.25
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,686	706,180.20
		AMERICAN TOWER CORPORATION	19,462	4,134,896.52
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	55,661	500,949.00
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,260	1,308,715.60
		BOSTON PROPERTIES	6,944	945,495.04
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,103	435,779.63
		CROWN CASTLE INTL CORP	18,686	2,526,720.92
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,268	1,075,088.00
		DUKE REALTY CORP	15,871	499,301.66
		EQUINIX INC	3,545	1,771,082.00
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,424	421,083.52
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,603	1,294,701.94
		ESSEX PROPERTY TRUST	2,962	878,736.54
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,625	615,825.00
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,090	407,571.00
		HCP INC	20,968	665,314.64
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,932	603,972.88
		INVITATION HOMES INC	15,261	406,705.65
		IRON MOUNTAIN INC	12,039	375,496.41
		KIMCO REALTY CORP	17,599	322,589.67
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,658	279,788.10
		MACERICH CO/THE	4,623	163,792.89
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,069	594,745.77
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	397,777.00
		PROLOGIS INC	28,374	2,218,563.06
		PUBLIC STORAGE	7,084	1,737,067.64
		REALTY INCOME CORP	12,818	931,227.70
		REGENCY CENTERS CORP	6,825	460,482.75
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,947	1,090,813.50
		SIMON PROPERTY GROUP	13,909	2,272,591.51
		SL GREEN REALTY CORP	4,007	354,779.78
		SUN COMMUNITIES INC	3,481	451,764.18
UDR INC	11,920	549,988.80		
VENTAS INC	16,040	1,036,504.80		
VEREIT INC	40,232	363,697.28		
VORNADO REALTY TRUST	7,639	522,278.43		
WELLTOWER INC	16,702	1,390,107.46		
WP CAREY INC	6,973	592,914.19		

アメリカドル 小計		502,097	35,698,832.91 (3,874,037,347)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,812	178,426.08
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	239,010.40
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	97,909.76
カナダドル 小計		19,699	515,346.24 (42,129,555)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-
	COVIVIO(FP)	1,902	179,739.00
	GECINA SA	1,960	260,876.00
	ICADE	1,843	143,846.15
	KLEPIERRE	8,356	245,833.52
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,283	857,001.20
ユーロ 小計		1,625,928	1,687,295.87 (207,250,551)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	210,526.45
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	272,929.20
	SEGRO PLC	43,067	308,101.31
イギリスポンド 小計		114,374	791,556.96 (109,290,269)
オーストラリアドル	DEXUS	47,933	644,698.85
	GOODMAN GROUP	73,073	1,044,213.17
	GPT GROUP	84,564	511,612.20
	MIRVAC GROUP	176,235	551,615.55
	SCENTRE GROUP	228,183	876,222.72
	STOCKLAND	121,481	545,449.69
	VICINITY CENTERS	163,023	425,490.03
オーストラリアドル 小計		894,492	4,599,302.21 (348,811,079)
香港ドル	LINK REIT	96,000	9,302,400.00
香港ドル 小計		96,000	9,302,400.00 (128,745,216)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,300	351,276.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	221,100.00
	CAPITALAND MALL TRUST	117,100	298,605.00
	SUNTEC REIT	113,000	210,180.00
シンガポールドル 小計		460,400	1,081,161.00 (86,017,169)
投資証券合計		3,712,990	4,796,281,186 (4,796,281,186)
合計			4,938,625,919 (4,938,625,919)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 616銘柄	96.8%			66.3%
	投資証券 39銘柄			3.2%	2.2%
カナダドル	株式 86銘柄	99.4%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			11.5%
	投資証券 6銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 94銘柄	99.0%			6.2%
	投資証券 3銘柄			1.0%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.4%			2.4%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券 7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 37銘柄	92.4%			1.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			5.6%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	90.0%			0.4%
	投資証券 4銘柄			10.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	80,379,905
コール・ローン	2,223,098,026
国債証券	132,185,396,963
派生商品評価勘定	15,501,369
未収入金	404,315
未収利息	923,315,059
前払費用	32,087,847
差入委託証拠金	206,945,287
流動資産合計	135,667,128,771
資産合計	135,667,128,771
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,100,606
前受金	9,820,735
未払金	16,292,997
未払解約金	79,126,597
未払利息	4,619
流動負債合計	115,345,554
負債合計	115,345,554
純資産の部	
元本等	
元本	56,698,877,187
剰余金	
剰余金又は欠損金()	78,852,906,030
元本等合計	135,551,783,217
純資産合計	135,551,783,217
負債純資産合計	135,667,128,771

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p>

2019年 6月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,698,877,187口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3907円 (1万口当たり純資産額) (23,907円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2019年 6月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(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)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 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>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2019年 6月10日現在

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月12日
期首元本額	59,954,266,750円
期中追加設定元本額	4,787,171,339円
期中一部解約元本額	8,042,560,902円
期末元本額	56,698,877,187円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,285,042,511円
D C 外国債券インデックスファンド	2,047,877,439円
D C 外国債券インデックスファンド L	12,223,184,925円
D C バランスファンド 3 0	737,116,373円
D C バランスファンド 5 0	720,171,476円
D C バランスファンド 7 0	138,992,430円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	441,259,867円
外国債券インデックス e	1,356,892,989円
インデックスコレクション（外国債券）	3,563,792,162円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,326,109,750円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	442,564,504円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	120,536,262円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,714,552,918円
外国債券パッシブファンド私募 A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,258,903,415円
外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	730,338,573円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	209,605,532円

区分	2019年 6月10日現在
バランスVA50（適格機関投資家専用）	897,582,368円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	452,964,977円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	846,645,118円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	834,613円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,513,598,551円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,199,106,174円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	732,951,055円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,709,014,689円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	368,599,786円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	398,446,880円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,890,927,719円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	136,668,681円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	230,271,757円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	120,353,991円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	59,868,854円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	44,950,191円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,628,712,335円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	13,434,960円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	312,147,501円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	95,899,182円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,708,158,569円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	20,798,110円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,384,303,161
合計	4,384,303,161

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,779,447,316	-	1,789,268,051	9,820,735

合計	1,779,447,316	-	1,789,268,051	9,820,735
----	---------------	---	---------------	-----------

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,350,771,222	-	2,346,351,250	4,419,972
	アメリカドル	1,168,095,179	-	1,162,905,600	5,189,579
	カナダドル	105,534,970	-	106,249,000	714,030
	ユーロ	909,015,990	-	911,398,600	2,382,610
	イギリスポンド	168,125,083	-	165,798,050	2,327,033
合計		2,350,771,222	-	2,346,351,250	4,419,972

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	4,550,000.00	4,490,458.97	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,943,437.52	
		T 1.25% 03/31/21	8,500,000.00	8,404,873.01	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,857,884.77	

T 1.25% 10/31/21	4,950,000.00	4,883,291.02	
T 1.375% 01/31/21	1,600,000.00	1,586,031.24	
T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,972,636.73	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,968,652.35	
T 1.375% 08/31/20	1,750,000.00	1,737,216.79	
T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,384,908.19	
T 1.375% 09/30/20	2,950,000.00	2,927,241.22	
T 1.375% 09/30/23	7,100,000.00	6,961,328.12	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,951,835.96	
T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	2,975,156.25	
T 1.5% 02/28/23	4,200,000.00	4,150,125.00	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,951,406.24	
T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	8,033,492.22	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,630,058.62	
T 1.625% 04/30/23	8,100,000.00	8,036,085.97	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,279,765.65	
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,314,656.25	
T 1.625% 07/31/20	1,200,000.00	1,194,960.93	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,391,304.68	
T 1.625% 08/31/22	500,000.00	496,855.47	
T 1.625% 10/15/20	5,270,000.00	5,246,017.38	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,973,593.76	
T 1.625% 11/30/20	5,000,000.00	4,976,562.50	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,642,650.38	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,642,728.50	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,495,410.15	
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	1,995,859.38	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,590,835.92	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,744,599.60	
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,495,410.15	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,988,203.12	
T 1.75% 12/31/20	3,000,000.00	2,991,621.09	
T 1.875% 01/31/22	1,550,000.00	1,551,755.85	
T 1.875% 03/31/22	5,100,000.00	5,109,363.29	
T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,803,937.50	
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,353,396.47	
T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,195,624.99	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,603,859.38	
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,502,812.50	
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,003,750.00	
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,503,417.96	
T 2.125% 01/31/21	6,000,000.00	6,019,804.68	

T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,214,718.75
T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,335,244.12
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,016,875.00
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,109,925.78
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,518,164.07
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,917,332.02
T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	1,001,738.28
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,013,203.12
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,226,554.68
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,731,746.08
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,417,171.88
T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,839,484.39
T 2.25% 01/31/24	8,100,000.00	8,240,800.76
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,970,992.20
T 2.25% 03/31/21	900,000.00	905,853.51
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,733,230.45
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,537,968.75
T 2.25% 08/15/27	6,330,000.00	6,439,291.43
T 2.25% 08/15/46	7,450,000.00	6,979,136.75
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,546,386.72
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,091,992.20
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,619,082.01
T 2.25% 11/15/27	6,800,000.00	6,914,218.78
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,560,156.25
T 2.25% 12/31/24	3,700,000.00	3,769,230.47
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,697,593.76
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,863,574.20
T 2.375% 12/31/20	4,300,000.00	4,329,058.58
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,128,281.24
T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	5,287,722.68
T 2.5% 02/15/46	7,500,000.00	7,400,976.60
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,811,000.00
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,541,775.38
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,406,214.85
T 2.625% 02/15/29	3,390,000.00	3,550,230.47
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,598,144.52
T 2.625% 05/15/21	6,000,000.00	6,086,132.82
T 2.625% 08/15/20	2,400,000.00	2,417,812.51
T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,372,352.54
T 2.75% 02/15/24	8,900,000.00	9,257,390.62
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,933,052.36
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,343,554.69
T 2.75% 08/15/42	2,100,000.00	2,186,789.07

T 2.75% 08/15/47	4,700,000.00	4,862,664.08	
T 2.75% 09/30/20	1,400,000.00	1,414,000.00	
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,620,351.56	
T 2.75% 11/15/42	2,740,000.00	2,850,456.25	
T 2.75% 11/15/47	4,700,000.00	4,862,296.87	
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,422,996.08	
T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,410,960.94	
T 2.875% 05/15/43	1,250,000.00	1,327,246.10	
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,483,828.14	
T 2.875% 08/15/45	8,130,000.00	8,622,246.13	
T 2.875% 10/15/21	4,250,000.00	4,350,937.50	
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,114,531.25	
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,538,847.64	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,081,195.31	
T 2% 02/28/21	3,150,000.00	3,155,229.50	
T 2% 04/30/24	8,000,000.00	8,050,625.04	
T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,514,931.62	
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,510,839.84	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,006,210.94	
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,000,781.24	
T 2% 07/31/22	6,000,000.00	6,032,343.78	
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,765,380.85	
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,214,601.55	
T 2% 09/30/20	4,000,000.00	4,001,250.00	
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,216,570.30	
T 2% 11/15/21	1,300,000.00	1,305,636.72	
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,702,320.32	
T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,802,460.94	
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,532,011.70	
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,395,975.77	
T 3.125% 02/15/42	1,300,000.00	1,442,898.44	
T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,324,929.69	
T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,399,047.87	
T 3.125% 08/15/44	7,200,000.00	7,971,750.00	
T 3.125% 11/15/28	4,940,000.00	5,382,670.33	
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	966,583.59	
T 3.375% 05/15/44	3,000,000.00	3,460,546.88	
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,297,312.50	
T 3.625% 02/15/21	7,050,000.00	7,249,520.49	
T 3.625% 02/15/44	2,650,000.00	3,178,964.85	
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,917,750.00	
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,341,140.62	

	T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,666,562.50
	T 3.875% 08/15/40	1,550,000.00	1,922,605.47
	T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,195,820.31
	T 3% 05/15/45	200,000.00	217,000.00
	T 3% 05/15/47	3,400,000.00	3,693,250.00
	T 3% 08/15/48	5,950,000.00	6,464,117.18
	T 3% 09/30/25	7,000,000.00	7,441,328.16
	T 3% 10/31/25	5,950,000.00	6,327,220.71
	T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,222,007.81
	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,104,601.56
	T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,173,304.69
	T 4.375% 02/15/38	500,000.00	656,601.56
	T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	2,116,750.00
	T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,790,332.03
	T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,387,558.59
	T 4.5% 02/15/36	1,000,000.00	1,311,250.00
	T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,677,246.10
	T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,045,976.57
	T 4.75% 02/15/41	350,000.00	486,500.00
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	910,660.15
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	638,515.62
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,144,054.69
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,001,425.78
	T 5.5% 08/15/28	250,000.00	321,562.50
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	751,125.00
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,381,406.25
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,010,418.75
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,588,570.31
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	589,675.78
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	2,977,710.94
	T 8.75% 08/15/20	6,340,000.00	6,838,532.01
	アメリカドル 小計	557,790,000.00	573,973,567.30 (62,287,611,523)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	850,000.00	830,301.25
	CAN 0.75% 03/01/21	1,980,000.00	1,957,170.60
	CAN 0.75% 09/01/20	1,750,000.00	1,732,981.25
	CAN 0.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,367,108.00
	CAN 1.5% 06/01/23	2,440,000.00	2,454,408.20
	CAN 1.5% 06/01/26	1,450,000.00	1,459,954.25
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	1,026,334.40
	CAN 1% 09/01/22	1,150,000.00	1,136,493.25
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	697,959.10
	CAN 2.25% 06/01/25	970,000.00	1,018,960.75

	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	418,631.85
	CAN 2.5% 06/01/24	1,530,000.00	1,615,213.35
	CAN 2.75% 06/01/22	1,100,000.00	1,144,055.00
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	1,076,698.95
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	468,629.00
	CAN 2% 06/01/28	350,000.00	366,511.25
	CAN 3.25% 06/01/21	1,400,000.00	1,450,344.00
	CAN 3.5% 06/01/20	1,980,000.00	2,015,224.20
	CAN 3.5% 12/01/45	1,500,000.00	2,062,110.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,486,453.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,110,000.00	1,546,768.35
	CAN 5.75% 06/01/33	590,000.00	897,555.20
	CAN 5% 06/01/37	1,060,000.00	1,607,421.10
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	717,240.00
	カナダドル 小計	28,480,000.00	31,554,526.80 (2,579,582,565)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,485,632.00
	MBONO 10% 12/05/24	25,400,000.00	27,924,760.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	8,450,000.00	7,535,625.50
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	16,790,739.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	25,200,000.00	24,549,840.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	2,300,000.00	2,267,903.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	16,410,000.00	16,037,246.85
	MBONO 7.75% 05/29/31	11,850,000.00	11,618,688.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,500,000.00	14,668,037.50
	MBONO 7.75% 11/23/34	7,650,000.00	7,413,462.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	8,000,000.00	8,309,760.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	8,404,385.00
	MBONO 8% 06/11/20	22,400,000.00	22,401,008.00
	MBONO 8% 11/07/47	5,830,000.00	5,627,057.70
	MBONO 8% 12/07/23	10,250,000.00	10,335,075.00
	メキシコペソ 小計	191,240,000.00	191,369,220.05 (1,077,408,708)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	180,000.00	185,329.80
	BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	366,129.75
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,173,518.50
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	802,770.00
	BGB 0.8% 06/22/28	970,000.00	1,036,120.05
	BGB 0.9% 06/22/29	380,000.00	408,188.40
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	448,522.00
	BGB 1.6% 06/22/47	710,000.00	805,931.65
	BGB 1.7% 06/22/50	430,000.00	493,126.15

BGB 1.9% 06/22/38	330,000.00	396,069.30
BGB 1% 06/22/26	1,200,000.00	1,301,472.00
BGB 1% 06/22/31	1,360,000.00	1,468,908.80
BGB 2.15% 06/22/66	310,000.00	393,217.95
BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,080,259.90
BGB 2.25% 06/22/57	290,000.00	372,906.65
BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,383,540.00
BGB 3.75% 06/22/45	620,000.00	1,019,115.70
BGB 3.75% 09/28/20	1,130,000.00	1,193,698.10
BGB 3% 06/22/34	500,000.00	679,642.50
BGB 4.25% 03/28/41	1,240,000.00	2,075,586.40
BGB 4.25% 09/28/21	1,250,000.00	1,391,012.50
BGB 4.25% 09/28/22	1,330,000.00	1,544,356.10
BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,257,771.50
BGB 4% 03/28/22	790,000.00	892,632.85
BGB 4% 03/28/32	450,000.00	655,897.50
BGB 5.5% 03/28/28	1,350,000.00	2,003,008.50
BGB 5% 03/28/35	1,340,000.00	2,236,553.80
BTPS 0.05% 04/15/21	1,720,000.00	1,710,617.40
BTPS 0.35% 06/15/20	2,400,000.00	2,409,456.00
BTPS 0.35% 11/01/21	800,000.00	795,684.00
BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	545,246.80
BTPS 0.65% 11/01/20	1,200,000.00	1,208,712.00
BTPS 0.95% 03/01/23	2,750,000.00	2,725,937.50
BTPS 1.25% 12/01/26	1,600,000.00	1,535,184.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,400,000.00	2,429,976.00
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,052,826.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,571,343.50
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	594,459.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,481,475.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,329,736.50
BTPS 1.65% 03/01/32	450,000.00	410,922.00
BTPS 2.05% 08/01/27	2,350,000.00	2,354,911.50
BTPS 2.1% 07/15/26	300,000.00	303,121.50
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,760,571.00
BTPS 2.2% 06/01/27	2,530,000.00	2,568,076.50
BTPS 2.25% 09/01/36	1,170,000.00	1,098,641.70
BTPS 2.45% 09/01/33	500,000.00	491,407.50
BTPS 2.5% 12/01/24	1,800,000.00	1,880,127.00
BTPS 2.7% 03/01/47	1,700,000.00	1,590,511.50
BTPS 2.8% 03/01/67	520,000.00	461,817.20
BTPS 2.8% 12/01/28	1,100,000.00	1,155,528.00
BTPS 2.95% 09/01/38	550,000.00	551,584.00

BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,063,030.50	
BTPS 3.25% 09/01/46	450,000.00	463,430.25	
BTPS 3.35% 03/01/35	650,000.00	697,905.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,160,000.00	1,222,228.20	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,146,131.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	1,030,000.00	1,090,924.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,647,417.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	1,900,000.00	2,030,112.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,922,978.40	
BTPS 3.85% 09/01/49	600,000.00	663,180.00	
BTPS 3% 08/01/29	600,000.00	635,475.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,040,000.00	2,317,103.40	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,622,296.25	
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,179,034.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,833,137.95	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,630,000.00	2,870,066.40	
BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	2,014,014.75	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,380,000.00	1,746,003.60	
BTPS 4% 02/01/37	2,000,000.00	2,314,620.00	
BTPS 4% 09/01/20	1,470,000.00	1,540,493.85	
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,862,049.60	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	2,902,991.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,939,198.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,518,835.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,010,000.00	2,711,289.00	
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,612,008.50	
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,048,867.40	
BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,299,104.00	
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,057,728.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	1,250,000.00	1,670,968.75	
BTPS 6% 05/01/31	2,300,000.00	3,114,154.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	476,456.75	
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,381,778.00	
DBR 0.25% 02/15/27	2,930,000.00	3,086,974.75	
DBR 0.25% 02/15/29	990,000.00	1,039,401.00	
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,367,450.50	
DBR 0.5% 02/15/25	700,000.00	743,501.50	
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,458,389.50	
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,624,035.20	
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	967,324.50	
DBR 0% 08/15/26	2,050,000.00	2,121,042.75	
DBR 1.25% 08/15/48	1,090,000.00	1,370,200.85	

DBR 1.5% 02/15/23	1,950,000.00	2,108,993.25
DBR 1.5% 05/15/23	1,360,000.00	1,477,810.00
DBR 1.5% 05/15/24	1,450,000.00	1,603,874.00
DBR 1.5% 09/04/22	2,050,000.00	2,197,056.75
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,391,818.75
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,774,847.25
DBR 1% 08/15/24	1,950,000.00	2,114,599.50
DBR 1% 08/15/25	760,000.00	833,967.00
DBR 2.25% 09/04/20	1,900,000.00	1,968,286.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,079,177.75
DBR 2.5% 01/04/21	2,130,000.00	2,238,065.55
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	2,780,442.00
DBR 2.5% 08/15/46	1,820,000.00	2,869,903.40
DBR 2% 01/04/22	1,370,000.00	1,465,461.60
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,103,683.40
DBR 3.25% 07/04/21	1,700,000.00	1,838,737.00
DBR 3.25% 07/04/42	990,000.00	1,671,243.75
DBR 3% 07/04/20	2,750,000.00	2,856,741.25
DBR 4.0% 01/04/37	1,550,000.00	2,619,523.25
DBR 4.25% 07/04/39	970,000.00	1,762,548.20
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	1,029,822.50
DBR 4.75% 07/04/34	1,330,000.00	2,294,908.35
DBR 4.75% 07/04/40	1,050,000.00	2,055,170.25
DBR 5.5% 01/04/31	1,160,000.00	1,937,553.80
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,288,760.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,808,564.40
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	1,038,088.85
DBR 6.5% 07/04/27	200,000.00	313,717.00
FRTR 0.25% 11/25/20	1,350,000.00	1,367,239.50
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,118,439.25
FRTR 0.5% 05/25/25	1,800,000.00	1,891,755.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,367,911.25
FRTR 0.5% 05/25/29	640,000.00	666,441.60
FRTR 0.75% 05/25/28	3,280,000.00	3,510,026.40
FRTR 0.75% 11/25/28	1,450,000.00	1,549,491.75
FRTR 0% 02/25/22	1,400,000.00	1,422,869.00
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,919,705.60
FRTR 0% 03/25/24	950,000.00	970,999.75
FRTR 0% 05/25/21	550,000.00	556,737.50
FRTR 1.25% 05/25/34	1,350,000.00	1,506,087.00
FRTR 1.25% 05/25/36	1,910,000.00	2,118,619.75
FRTR 1.5% 05/25/31	3,200,000.00	3,674,000.00
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,839,161.00

FRTR 1.75% 05/25/66	540,000.00	639,246.60
FRTR 1.75% 06/25/39	1,100,000.00	1,317,365.50
FRTR 1.75% 11/25/24	3,000,000.00	3,358,005.00
FRTR 1% 05/25/27	2,900,000.00	3,165,321.00
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,431,475.20
FRTR 2.25% 05/25/24	2,390,000.00	2,715,709.20
FRTR 2.25% 10/25/22	2,900,000.00	3,180,270.50
FRTR 2.5% 05/25/30	2,450,000.00	3,075,619.75
FRTR 2.5% 10/25/20	3,450,000.00	3,598,436.25
FRTR 2.75% 10/25/27	2,400,000.00	2,983,932.00
FRTR 2% 05/25/48	1,360,000.00	1,707,024.40
FRTR 3.25% 05/25/45	2,710,000.00	4,199,416.00
FRTR 3.25% 10/25/21	4,120,000.00	4,502,068.20
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,945,458.40
FRTR 3.75% 04/25/21	3,200,000.00	3,464,560.00
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,142,700.00
FRTR 4.25% 10/25/23	4,000,000.00	4,850,700.00
FRTR 4.5% 04/25/41	2,450,000.00	4,325,769.00
FRTR 4.75% 04/25/35	1,950,000.00	3,239,496.00
FRTR 4% 04/25/55	1,090,000.00	2,026,871.35
FRTR 4% 04/25/60	920,000.00	1,773,939.40
FRTR 4% 10/25/38	1,800,000.00	2,913,381.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,852,125.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,220,000.00	3,814,348.50
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	2,040,324.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,491,352.50
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	776,073.75
IRISH 0.9% 05/15/28	380,000.00	405,754.50
IRISH 1.1% 05/15/29	240,000.00	259,438.80
IRISH 1.3% 05/15/33	60,000.00	65,325.30
IRISH 1.5% 05/15/50	260,000.00	279,723.60
IRISH 1.7% 05/15/37	590,000.00	674,337.55
IRISH 1% 05/15/26	740,000.00	796,317.70
IRISH 2.4% 05/15/30	820,000.00	998,374.60
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	756,852.60
IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	495,786.90
IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	675,592.70
IRISH 5.4% 03/13/25	950,000.00	1,257,852.25
IRISH 5% 10/18/20	440,000.00	473,156.20
NETHER 0.25% 07/15/25	630,000.00	656,548.20
NETHER 0.25% 07/15/29	340,000.00	351,889.80
NETHER 0.5% 01/15/40	420,000.00	435,960.00

NETHER 0.5% 07/15/26	1,450,000.00	1,538,870.50
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	974,605.50
NETHER 0.75% 07/15/28	600,000.00	651,750.00
NETHER 0% 01/15/22	1,100,000.00	1,118,386.50
NETHER 1.75% 07/15/23	1,670,000.00	1,831,230.15
NETHER 2.25% 07/15/22	1,120,000.00	1,221,640.00
NETHER 2.5% 01/15/33	940,000.00	1,250,858.00
NETHER 2.75% 01/15/47	970,000.00	1,579,722.60
NETHER 2% 07/15/24	1,560,000.00	1,762,183.80
NETHER 3.25% 07/15/21	1,300,000.00	1,407,393.00
NETHER 3.5% 07/15/20	710,000.00	742,237.55
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	348,048.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,080,000.00	1,904,709.60
NETHER 4% 01/15/37	1,120,000.00	1,864,335.20
NETHER 5.5% 01/15/28	740,000.00	1,111,591.00
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	907,700.50
OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,821,825.00
OBL 0% 04/08/22	1,270,000.00	1,294,707.85
OBL 0% 04/09/21	540,000.00	546,644.70
OBL 0% 04/14/23	600,000.00	615,732.00
RAGB 0.5% 02/20/29	280,000.00	292,861.80
RAGB 0.5% 04/20/27	150,000.00	157,918.50
RAGB 0.75% 02/20/28	40,000.00	42,919.20
RAGB 0.75% 10/20/26	1,800,000.00	1,928,646.00
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	663,588.25
RAGB 0% 09/20/22	270,000.00	274,974.75
RAGB 1.2% 10/20/25	760,000.00	834,597.80
RAGB 1.5% 02/20/47	100,000.00	119,223.50
RAGB 1.5% 11/02/86	190,000.00	227,861.30
RAGB 1.65% 10/21/24	650,000.00	722,403.50
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	824,501.25
RAGB 2.1% 09/20/17	290,000.00	443,215.70
RAGB 2.4% 05/23/34	560,000.00	724,914.40
RAGB 3.15% 06/20/44	730,000.00	1,154,155.55
RAGB 3.4% 11/22/22	670,000.00	762,500.20
RAGB 3.5% 09/15/21	1,100,000.00	1,203,400.00
RAGB 3.65% 04/20/22	570,000.00	639,631.20
RAGB 3.8% 01/26/62	260,000.00	529,353.50
RAGB 3.9% 07/15/20	880,000.00	923,089.20
RAGB 4.15% 03/15/37	1,000,000.00	1,629,760.00
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,284,504.50
RAGB 6.25% 07/15/27	370,000.00	564,198.20
RFBG 0.5% 04/15/26	420,000.00	442,297.80

RFGB 0.5% 09/15/27	470,000.00	494,820.70
RFGB 0.5% 09/15/28	140,000.00	147,246.40
RFGB 0.75% 04/15/31	480,000.00	513,717.60
RFGB 0.875% 09/15/25	190,000.00	204,505.55
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	254,161.25
RFGB 1.125% 04/15/34	260,000.00	290,771.00
RFGB 1.375% 04/15/47	170,000.00	204,167.45
RFGB 1.5% 04/15/23	720,000.00	777,171.60
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	407,320.10
RFGB 2.625% 07/04/42	310,000.00	456,772.60
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	478,473.20
RFGB 2% 04/15/24	420,000.00	470,803.20
RFGB 3.5% 04/15/21	720,000.00	774,950.40
RFGB 4% 07/04/25	360,000.00	456,863.40
SPGB 0.05% 01/31/21	500,000.00	503,452.50
SPGB 0.05% 10/31/21	890,000.00	898,548.45
SPGB 0.4% 04/30/22	1,770,000.00	1,808,178.90
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	819,908.00
SPGB 0.75% 07/30/21	500,000.00	512,025.00
SPGB 1.15% 07/30/20	950,000.00	967,014.50
SPGB 1.3% 10/31/26	1,750,000.00	1,889,798.75
SPGB 1.4% 04/30/28	1,420,000.00	1,546,067.60
SPGB 1.4% 07/30/28	540,000.00	586,097.10
SPGB 1.45% 04/30/29	1,000,000.00	1,086,415.00
SPGB 1.45% 10/31/27	2,000,000.00	2,184,250.00
SPGB 1.5% 04/30/27	1,200,000.00	1,313,520.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,367,575.00
SPGB 1.85% 07/30/35	360,000.00	400,267.80
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,504,927.20
SPGB 1.95% 07/30/30	1,560,000.00	1,776,005.40
SPGB 2.15% 10/31/25	1,550,000.00	1,754,576.75
SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,533,074.70
SPGB 2.7% 10/31/48	600,000.00	753,975.00
SPGB 2.75% 10/31/24	1,900,000.00	2,187,764.50
SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,433,487.00
SPGB 3.45% 07/30/66	700,000.00	1,023,949.50
SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,789,035.00
SPGB 4.2% 01/31/37	1,420,000.00	2,126,741.10
SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,585,260.60
SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,809,868.95
SPGB 4.7% 07/30/41	1,390,000.00	2,287,919.15
SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,415,379.75

	SPGB 4.85% 10/31/20	1,000,000.00	1,073,370.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,220,000.00	2,038,491.90
	SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,073,842.50
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,040,000.00	1,854,496.80
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,870,000.00	3,462,210.15
	SPGB 5.5% 04/30/21	2,740,000.00	3,044,646.90
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,354,502.75
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,020,000.00	2,352,330.40
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,850,000.00	2,600,693.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,578,697.50
	ユーロ 小計	347,300,000.00	413,708,037.50 (50,815,758,246)
イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	1,650,000.00	1,650,412.50
	UKT 0.75% 07/22/23	1,950,000.00	1,966,740.75
	UKT 1.25% 07/22/27	1,390,000.00	1,448,359.15
	UKT 1.5% 01/22/21	1,360,000.00	1,381,304.40
	UKT 1.5% 07/22/26	2,150,000.00	2,278,344.25
	UKT 1.5% 07/22/47	1,480,000.00	1,515,135.20
	UKT 1.625% 10/22/28	1,450,000.00	1,556,654.75
	UKT 1.625% 10/22/71	110,000.00	124,361.60
	UKT 1.75% 07/22/57	500,000.00	564,020.00
	UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,706,100.20
	UKT 1.75% 09/07/37	1,440,000.00	1,548,835.20
	UKT 1% 04/22/24	1,540,000.00	1,571,446.80
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,243,375.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,350,000.00	1,913,179.50
	UKT 2.75% 09/07/24	420,000.00	467,218.50
	UKT 2% 07/22/20	2,220,000.00	2,254,643.10
	UKT 2% 09/07/25	540,000.00	586,566.90
	UKT 3.25% 01/22/44	1,550,000.00	2,148,803.75
	UKT 3.5% 01/22/45	1,250,000.00	1,815,350.00
	UKT 3.5% 07/22/68	1,920,000.00	3,443,433.60
	UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	1,820,283.45
	UKT 3.75% 09/07/20	890,000.00	924,750.05
	UKT 3.75% 09/07/21	620,000.00	664,956.20
	UKT 4.25% 03/07/36	1,540,000.00	2,250,340.40
	UKT 4.25% 06/07/32	1,100,000.00	1,531,673.00
	UKT 4.25% 09/07/39	930,000.00	1,417,650.15
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	969,738.75
	UKT 4.25% 12/07/40	1,130,000.00	1,746,522.35
	UKT 4.25% 12/07/46	1,600,000.00	2,640,736.00
	UKT 4.25% 12/07/49	1,060,000.00	1,816,956.60
	UKT 4.25% 12/07/55	1,350,000.00	2,487,125.25

	UKT 4.5% 09/07/34	1,350,000.00	1,985,006.25
	UKT 4.5% 12/07/42	1,340,000.00	2,186,967.10
	UKT 4.75% 12/07/30	900,000.00	1,277,239.50
	UKT 4.75% 12/07/38	620,000.00	993,010.60
	UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	1,844,795.00
	UKT 4% 03/07/22	1,750,000.00	1,918,122.50
	UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,997,944.00
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	664,767.00
	UKT 8% 06/07/21	50,000.00	57,457.00
イギリスポンド 小計		48,210,000.00	62,380,326.30 (8,612,851,652)
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	3,200,000.00	3,441,520.00
	SGB 0.75% 11/12/29	2,180,000.00	2,340,317.20
	SGB 1.5% 11/13/23	5,270,000.00	5,744,853.35
	SGB 1% 11/12/26	3,560,000.00	3,883,283.60
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,861,579.75
	SGB 3.5% 03/30/39	3,210,000.00	5,006,540.70
	SGB 3.5% 06/01/22	7,450,000.00	8,356,404.25
	SGB 5% 12/01/20	6,420,000.00	6,954,625.50
スウェーデンクローナ 小計		35,440,000.00	40,589,124.35 (468,398,494)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,540,000.00	3,589,365.30
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	2,985,303.50
	NGB 1.75% 03/13/25	2,040,000.00	2,099,945.40
	NGB 1.75% 09/06/29	1,450,000.00	1,489,063.00
	NGB 2% 04/26/28	1,640,000.00	1,721,704.80
	NGB 2% 05/24/23	4,550,000.00	4,695,600.00
	NGB 3.75% 05/25/21	5,420,000.00	5,692,056.90
	NGB 3% 03/14/24	3,550,000.00	3,845,058.25
ノルウェークローネ 小計		25,090,000.00	26,118,097.15 (328,565,662)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	4,010,000.00	4,063,854.30
	DGB 0.5% 11/15/27	2,000,000.00	2,152,070.00
	DGB 1.5% 11/15/23	3,700,000.00	4,055,033.50
	DGB 1.75% 11/15/25	5,460,000.00	6,270,345.90
	DGB 3% 11/15/21	6,120,000.00	6,672,850.20
	DGB 4.5% 11/15/39	9,590,000.00	18,145,814.40
デンマーククローネ 小計		30,880,000.00	41,359,968.30 (680,371,478)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,054,633.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,028,900.00
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,040,000.00	1,065,776.40

	POLGB 2.5% 04/25/24	330,000.00	338,370.45
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	3,202,935.75
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	1,931,258.30
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,560,000.00	1,603,960.80
	POLGB 2.75% 10/25/29	240,000.00	246,436.80
	POLGB 2% 04/25/21	2,630,000.00	2,648,620.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,250,000.00	3,463,671.25
	POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,121,813.80
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,300,000.00	2,416,115.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,166,242.50
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,300,000.00	1,463,267.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,130,000.00	1,237,547.75
	ポーランドズロチ 小計	26,660,000.00	27,989,549.70 (806,938,717)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,750,000.00	1,766,213.75
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,551,181.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,040,000.00	1,147,099.20
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,400,000.00	1,508,269.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	290,000.00	328,815.05
	ACGB 2.75% 06/21/35	580,000.00	664,160.90
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	2,106,302.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	1,951,766.25
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,440,000.00	1,618,855.20
	ACGB 2% 12/21/21	1,710,000.00	1,750,663.80
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,050,000.00	2,287,953.75
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,530,000.00	1,782,993.15
	ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	674,443.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	820,000.00	1,064,647.00
	ACGB 3% 03/21/47	900,000.00	1,073,254.50
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,150,000.00	2,569,379.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,659,193.90
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	3,008,580.00
	ACGB 5.5% 04/21/23	1,820,000.00	2,124,577.00
	ACGB 5.75% 05/15/21	1,940,000.00	2,112,863.70
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,285,380.00
	オーストラリアドル 小計	30,690,000.00	35,036,591.15 (2,657,175,072)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	290,000.00	287,068.10
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	203,069.00
	SIGB 2.25% 06/01/21	790,000.00	798,504.35
	SIGB 2.25% 08/01/36	210,000.00	207,317.25
	SIGB 2.375% 06/01/25	350,000.00	360,501.75
	SIGB 2.625% 05/01/28	230,000.00	241,243.55

	SIGB 2.75% 03/01/46	480,000.00	500,774.40
	SIGB 2.75% 04/01/42	380,000.00	399,395.20
	SIGB 2.75% 07/01/23	650,000.00	675,070.50
	SIGB 2.875% 07/01/29	100,000.00	107,384.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	397,161.70
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,996.80
	SIGB 3.125% 09/01/22	320,000.00	334,022.40
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	611,358.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	270,000.00	306,364.95
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	589,020.80
	SIGB 3% 09/01/24	470,000.00	497,605.45
	シンガポールドル 小計	6,560,000.00	6,836,858.70 (543,940,478)
マレーシアリングット	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,201,936.00
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,301,904.50
	MGS 3.502% 05/31/27	670,000.00	658,573.15
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	956,080.00
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	843,913.70
	MGS 3.889% 07/31/20	1,350,000.00	1,360,111.50
	MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,210,518.00
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	365,659.20
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	152,672.25
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	768,997.50
	MGS 4.127% 04/15/32	690,000.00	700,805.40
	MGS 4.16% 07/15/21	1,880,000.00	1,911,941.20
	MGS 4.181% 07/15/24	1,650,000.00	1,700,110.50
	MGS 4.232% 06/30/31	240,000.00	246,850.80
	MGS 4.254% 05/31/35	1,050,000.00	1,061,660.25
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,724,365.50
	MGS 4.498% 04/15/30	1,900,000.00	2,011,815.00
	MGS 4.642% 11/07/33	180,000.00	192,975.30
	MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,127,828.45
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,243,322.80
	MGS 4.935% 09/30/43	640,000.00	681,209.60
	MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,056,547.25
	マレーシアリングット 小計	22,870,000.00	23,479,797.85 (612,822,723)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	16,050,000.00	17,849,927.25
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,348,689.50
	SAGB 6.5% 02/28/41	7,550,000.00	5,246,683.75
	SAGB 6.75% 03/31/21	3,660,000.00	3,673,706.70
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,360,000.00	6,417,494.40
	SAGB 7% 02/28/31	8,840,000.00	7,373,841.80

	SAGB 8.25% 03/31/32	5,430,000.00	4,933,263.60	
	SAGB 8.5% 01/31/37	9,000,000.00	7,967,835.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	13,200,000.00	11,709,654.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	11,300,000.00	10,009,427.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,594,690.00	
	SAGB 8% 01/31/30	9,400,000.00	8,635,921.00	
	SAGB 9% 01/31/40	4,850,000.00	4,446,795.25	
	南アフリカランド 小計	108,740,000.00	98,207,929.25	(713,971,645)
	合計		132,185,396,963	(132,185,396,963)

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 162銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 274銘柄	100.0%	38.4%
イギリスポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
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 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 22銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2019年6月11日から2019年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2019年 6月10日現在)	第13期中間計算期間 (2019年12月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,165,514	27,414,822
親投資信託受益証券	3,149,458,046	3,301,545,031
未収入金	10,796,797	1,945,455
流動資産合計	3,174,420,357	3,330,905,308
資産合計	3,174,420,357	3,330,905,308
負債の部		
流動負債		
未払解約金	799,999	1,960,299
未払受託者報酬	843,628	872,496
未払委託者報酬	9,279,807	9,597,457
未払利息	29	9
その他未払費用	84,303	87,186
流動負債合計	11,007,766	12,517,447
負債合計	11,007,766	12,517,447
純資産の部		
元本等		
元本	1,999,287,386	1,958,574,675
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	1,164,125,205	1,359,813,186
(分配準備積立金)	1,001,178,408	946,177,306
元本等合計	3,163,412,591	3,318,387,861
純資産合計	3,163,412,591	3,318,387,861
負債純資産合計	3,174,420,357	3,330,905,308

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2018年 6月12日 至 2018年12月11日	第13期中間計算期間 自 2019年 6月11日 至 2019年12月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	140,599,927	232,075,649
営業収益合計	140,599,927	232,075,649
営業費用		
支払利息	7,196	6,083
受託者報酬	924,916	872,496
委託者報酬	10,174,005	9,597,457
その他費用	92,812	87,194
営業費用合計	11,198,929	10,563,230
営業利益又は営業損失（ ）	151,798,856	221,512,419
経常利益又は経常損失（ ）	151,798,856	221,512,419
中間純利益又は中間純損失（ ）	151,798,856	221,512,419
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	435,144	5,137,708
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,320,407,236	1,164,125,205
剰余金増加額又は欠損金減少額	52,316,575	44,594,839
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	52,316,575	44,594,839
剰余金減少額又は欠損金増加額	91,440,852	65,281,569
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	91,440,852	65,281,569
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,129,919,247	1,359,813,186

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2019年 6月10日現在)	第13期中間計算期間 (2019年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,999,287,386口	1,958,574,675口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5823円 (15,823円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6943円 (16,943円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2019年12月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 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)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第13期中間計算期間 (2019年12月10日現在)
3. 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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第12期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日	第13期中間計算期間 自 2019年 6月11日 至 2019年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,128,429,347円	1,999,287,386円
期中追加設定元本額	164,740,715円	71,883,163円
期中一部解約元本額	293,882,676円	112,595,874円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,562,513,099
株式	234,639,743,500

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	2,079,000
未収入金	37,778,950
未収配当金	74,257,120
差入委託証拠金	26,746,200
流動資産合計	237,343,117,869
資産合計	237,343,117,869
負債の部	
流動負債	
前受金	2,079,000
未払金	4,195,504
未払解約金	347,367,819
未払利息	864
その他未払費用	199
流動負債合計	353,643,386
負債合計	353,643,386
純資産の部	
元本等	
元本	127,660,137,704
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	109,329,336,779
元本等合計	236,989,474,483
純資産合計	236,989,474,483
負債純資産合計	237,343,117,869

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2019年12月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,660,137,704口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8564円 (1万口当たり純資産額) (18,564円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 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)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	132,345,809,414円
期中追加設定元本額	4,651,114,612円
期中一部解約元本額	9,336,786,322円
期末元本額	127,660,137,704円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	725,781,165円
DC日本株式インデックスファンド	323,115,069円
DC日本株式インデックスファンドL	53,572,450,438円
DC日本株式インデックスファンドA	1,133,618,217円
DCバランスファンド30	2,243,301,232円
DCバランスファンド50	3,394,509,560円
DCバランスファンド70	1,765,772,606円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	604,733,459円
日本株式インデックスe	1,744,495,479円
インデックスコレクション（国内株式）	11,185,664,770円
インデックスコレクション（バランス株式30）	7,083,172,146円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,152,144,326円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,627,920,766円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,445,543,562円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,290,144,704円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,574,265,730円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	109,572,534円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,067,776,416円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	111,657,340円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	546,598,719円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,591,192円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	795,142,921円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,253,978,389円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	610,839,933円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	10,273,519,081円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	879,717,680円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	135,845,151円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,622,148,914円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	43,351,234円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	212,109,143円

区分	2019年12月10日現在
バランスファンドV A (適格機関投資家専用)	2,604,217,268円
V Aバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	78,700,135円
V Aバランス50-50 (適格機関投資家専用)	79,610,223円
V Aファンド25 (適格機関投資家専用)	75,597,130円
バランスファンドV A 2 (適格機関投資家専用)	873,441,405円
バランスV A 20L (適格機関投資家専用)	612,966円
バランスV A 25L (適格機関投資家専用)	421,739,285円
バランスファンドV A 3 (適格機関投資家専用)	6,618,069,331円
世界バランスV A 25 (適格機関投資家専用)	125,112,042円
国内バランスV A 30 (適格機関投資家専用)	63,003,379円
国内バランスV A 25 (適格機関投資家専用)	11,637,849円
V Aバランス20-80 (適格機関投資家専用)	169,640,820円
私募日本株式インデックスファンドA L (適格機関投資家専用)	5,273,995円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,163,231,000	-	2,165,310,000	2,079,000
合計		2,163,231,000	-	2,165,310,000	2,079,000

(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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,331,632,882
コール・ローン	1,167,718,825
株式	185,647,977,904
投資信託受益証券	161,724,349
投資証券	5,189,965,280
派生商品評価勘定	121,222,313

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
未収入金	486,993
未収配当金	316,292,979
差入委託証拠金	2,816,620,856
流動資産合計	200,753,642,381
資産合計	200,753,642,381
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,471,266
前受金	93,241,946
未払解約金	168,907,471
未払利息	393
その他未払費用	75
流動負債合計	288,621,151
負債合計	288,621,151
純資産の部	
元本等	
元本	68,210,481,843
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	132,254,539,387
元本等合計	200,465,021,230
純資産合計	200,465,021,230
負債純資産合計	200,753,642,381

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2019年12月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	68,210,481,843口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.9389円 (1万口当たり純資産額) (29,389円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(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)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 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>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	68,863,760,422円
期中追加設定元本額	4,233,089,416円
期中一部解約元本額	4,886,367,995円
期末元本額	68,210,481,843円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,745,125,836円

区分	2019年12月10日現在
D C 外国株式インデックスファンド	4,470,123,631円
D C 外国株式インデックスファンド L	20,943,694,936円
D C バランスファンド 3 0	719,851,347円
D C バランスファンド 5 0	1,416,465,062円
D C バランスファンド 7 0	823,392,095円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	374,608,674円
外国株式インデックス e	5,573,029,923円
インデックスコレクション（外国株式）	5,536,200,924円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,316,303,195円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	906,235,988円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	766,304,961円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	6,389,785,973円
外国株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	1,308,025,372円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	842,210,439円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	68,401,375円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	664,381,252円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	69,714,403円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	341,250,366円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	1,454,244円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	2,481,722,311円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	534,517,705円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	337,893,721円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	6,434,926,212円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	624,765,583円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	254,428,741円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,012,740,906円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	27,065,070円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	130,733,552円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	147,392,767円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	447,297,141円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	46,617,624円
バランス V A 2 0 L（適格機関投資家専用）	382,422円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	120,369,902円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	317,713,835円
私募外国株式インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	15,354,355円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年12月10日現在）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,041,891,861	-	9,135,133,807	93,241,946
	合計	9,041,891,861	-	9,135,133,807	93,241,946

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,031,498,147	-	1,032,981,086	1,482,939
	アメリカドル	783,717,671	-	782,907,496	810,175
	ユーロ	155,965,800	-	156,286,000	320,200
	イギリスポンド	91,814,676	-	93,787,590	1,972,914
	売建	312,829,562	-	312,803,400	26,162
	アメリカドル	228,182,850	-	228,165,000	17,850
	カナダドル	18,051,110	-	18,048,800	2,310
	ユーロ	40,878,642	-	40,874,800	3,842
	イギリスポンド	25,716,960	-	25,714,800	2,160
		合計	1,344,327,709	-	1,345,784,486

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
預金	75,710,452
コール・ローン	1,434,775,046
国債証券	124,774,257,923
派生商品評価勘定	1,976,752
未収入金	3,914,575
未収利息	856,208,493
前払金	3,671,831
前払費用	20,607,356
差入委託証拠金	224,712,241
流動資産合計	127,395,834,669
資産合計	127,395,834,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,051,480
未払金	621,419
未払解約金	338,576,794
未払利息	483
その他未払費用	59
流動負債合計	344,250,235
負債合計	344,250,235
純資産の部	
元本等	
元本	52,202,568,566
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	74,849,015,868
元本等合計	127,051,584,434
純資産合計	127,051,584,434
負債純資産合計	127,395,834,669

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2019年12月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,202,568,566口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.4338円 (1万口当たり純資産額) (24,338円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(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)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

	2019年12月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <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>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	56,698,877,187円
期中追加設定元本額	3,235,374,270円
期中一部解約元本額	7,731,682,891円
期末元本額	52,202,568,566円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,250,520,811円
DC外国債券インデックスファンド	2,061,129,360円
DC外国債券インデックスファンドL	12,673,861,694円
DCバランスファンド30	742,571,289円
DCバランスファンド50	745,129,018円
DCバランスファンド70	142,525,521円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	442,920,703円
外国債券インデックスe	1,314,697,186円
インデックスコレクション(外国債券)	3,820,169,116円
インデックスコレクション(バランス株式30)	2,443,724,052円

区分	2019年12月10日現在
インデックスコレクション(バランス株式50)	476,858,816円
インデックスコレクション(バランス株式70)	132,118,780円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	3,844,252,921円
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,537,889,590円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	642,797,303円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	178,354,412円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	758,087,696円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	404,188,977円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	659,571,549円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	834,613円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,499,117,303円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,015,141,254円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	703,178,411円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	7,340,336,619円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	356,496,339円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	358,566,376円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,834,978,342円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	130,775,537円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	220,296,222円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	118,702,641円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	60,036,597円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	228,157,340円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	310,601円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	285,273,604円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	89,755,170円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,663,198,433円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	26,044,370円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2019年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	866,802,208	-	863,130,377	3,671,831
合計		866,802,208	-	863,130,377	3,671,831

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2019年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	963,111,297	-	963,708,400	597,103
	アメリカドル	491,956,208	-	490,917,200	1,039,008
	カナダドル	50,858,114	-	50,852,400	5,714
	ユーロ	346,069,794	-	346,233,600	163,806
	イギリスポンド	74,227,181	-	75,705,200	1,478,019
	合計	963,111,297	-	963,708,400	597,103

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

【純資産額計算書】

(2019年12月30日現在)

資産総額	3,363,629,408円
負債総額	1,820,197円
純資産総額（ - ）	3,361,809,211円
発行済口数	1,947,022,858口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7266円
（1万口当たり純資産額）	（17,266円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2019年12月30日現在)

資産総額	262,518,069,396円
負債総額	12,853,872,323円
純資産総額（ - ）	249,664,197,073円
発行済口数	134,246,090,223口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8598円
（1万口当たり純資産額）	（18,598円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(2019年12月30日現在)

資産総額	208,792,201,847円
負債総額	114,793,901円
純資産総額（ - ）	208,677,407,946円
発行済口数	67,999,808,525口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0688円
（1万口当たり純資産額）	（30,688円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(2019年12月30日現在)

資産総額	128,166,439,781円
負債総額	7,908,811円
純資産総額（ - ）	128,158,530,970円
発行済口数	51,988,310,094口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4651円
（1万口当たり純資産額）	（24,651円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

受益権の譲渡

イ．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又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．の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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．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又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等において、委託会社が必要と認めるとき又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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

質権口記載又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又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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終結の時までとします。

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終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

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。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[D0（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等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運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2020年 3月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2019年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	539	12,804,006
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	326,953
単位型公社債投資信託	17	140,733
合計	643	13,271,692

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）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年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「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条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに变更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）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、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）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：千円)	
		前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		23,973,152	23,830,484
有価証券		-	2,268,127
前払費用		157,614	197,843
未収委託者報酬		5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬		-	5,525,778
未収収益		896	212,722
その他		8,946	2,261,900
流動資産合計		29,513,917	40,648,447
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	36,782	282,407
器具備品	1	79,655	564,981
その他	1	1,912	14,462
有形固定資産合計		118,350	861,851
無形固定資産			
ソフトウェア		210,679	1,487,265
その他		4,377	7,256
無形固定資産合計		215,056	1,494,522
投資その他の資産			
投資有価証券		42,802	11,334,053
関係会社株式		-	4,663,000
長期貸付金		17,088	-
繰延税金資産		248,633	141,789
その他		32,880	32,492
貸倒引当金		17,088	-
投資その他の資産合計		324,317	16,171,335
固定資産合計		657,724	18,527,709
資産合計		30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）	当事業年度 （2019年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	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	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	-	1,317	3,744,907
当期末残高	182	-	182	25,592,216

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
剰余金の配当			

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	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	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

6. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（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）を採用しておりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、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する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

4. 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	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度（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）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

4. 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

2019年6月27日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

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、資金運用については、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いるほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、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。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと

考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。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。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6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

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（注2）を参照ください）。

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

（*）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。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-
(7) 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	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

（*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）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（4）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

（5）未払金、及び（6）未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（7）デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、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などができず、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。

（注3）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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5 年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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などができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

区分	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			
その他	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	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			
その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585

合計	13,602,178	13,035,220	566,957
----	------------	------------	---------

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)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などができず、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. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538,203	46,789	34,437

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(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) 通貨関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
	スイスフラン	1,110	-	5	5
香港ドル	560	-	4	4	
ユーロ	2,492	-	0	0	
合計	1,346,753	-	7,916	7,916	

(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います。

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) 株式関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計		6,739,103	-	8,766	8,766

(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います。

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

(1) 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 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建 ユーロ		6,313	-	86
			合計		8,643,951

(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。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	
有価証券評価差額	-		173,602	"
繰延ヘッジ損益	-		58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社(当社の親会社の連結子会社)を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

(2)実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

[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]

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]

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]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料等	9,571,581	未払 手数料	1,568,277
							投資助言費用	4,809,206	その他 未払金	424,421

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継			
							(承継資産合計)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	無対価		

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

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

前事業年度（2018年3月31日）

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、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2019年3月31日）

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、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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、潜在株式が存在し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。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34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		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
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	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
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	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	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	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34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

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定額法によっております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、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。

7．ヘッジ会計の会計処理

(1)ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2)ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3)ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4)ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

8. 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

(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ます。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34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 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34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)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

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6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

2019年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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。

(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)現金及び預金

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。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6)未払金

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。

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額:投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)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などができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（５）投資有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

時価のある子会社株式はありません。なお、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などができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	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			
その他	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）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などができず、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34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 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)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	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

（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います。

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) 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	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(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います。

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。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 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	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
合計			5,046	-	48

(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。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

(関連情報)

第34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

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省

略しております。

(2)有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(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34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34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34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)

第34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	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第34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	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(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)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行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うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又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

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

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。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書

（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・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 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
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」に掲げられている三井住友トラスト・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33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、三井住友トラスト・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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年8月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2018年6月12日から2019年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2019年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・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. XBR 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2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤 澤	孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹 内	知 明 印

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」に掲げられている三井住友トラスト・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34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、三井住友トラスト・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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2019年6月11日から2019年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月11日から2019年12月10日まで）の損益の状況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

三井住友トラスト・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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。