【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年3月15日提出
【計算期間】	第31特定期間(自 2020年6月16日至 2020年12月15日)
【ファンド名】	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍　秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	新屋敷　昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

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

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇内外

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

◇資産複合

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

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

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

◇年12回（毎月）

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

◇グローバル（含む日本）

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

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

2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

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

3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

●インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。

●毎月15日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

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

「財産3分法」とは?

財産を「不動産・現金（預金）・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。
先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

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

主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

［世界の財産3分法ファンド］
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。
連動をめざす指数（インデックス）
東証REIT指数（配当込み）

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。
連動をめざす指数（インデックス）
TOPIX（東証株価指数）

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。
連動をめざす指数（インデックス）
S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。
連動をめざす指数（インデックス）
MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）

※「基本組入比率」および「連動をめざす指数（インデックス）」は、2020年12月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。
連動をめざす指数（インデックス）
NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。
連動をめざす指数（インデックス）
FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

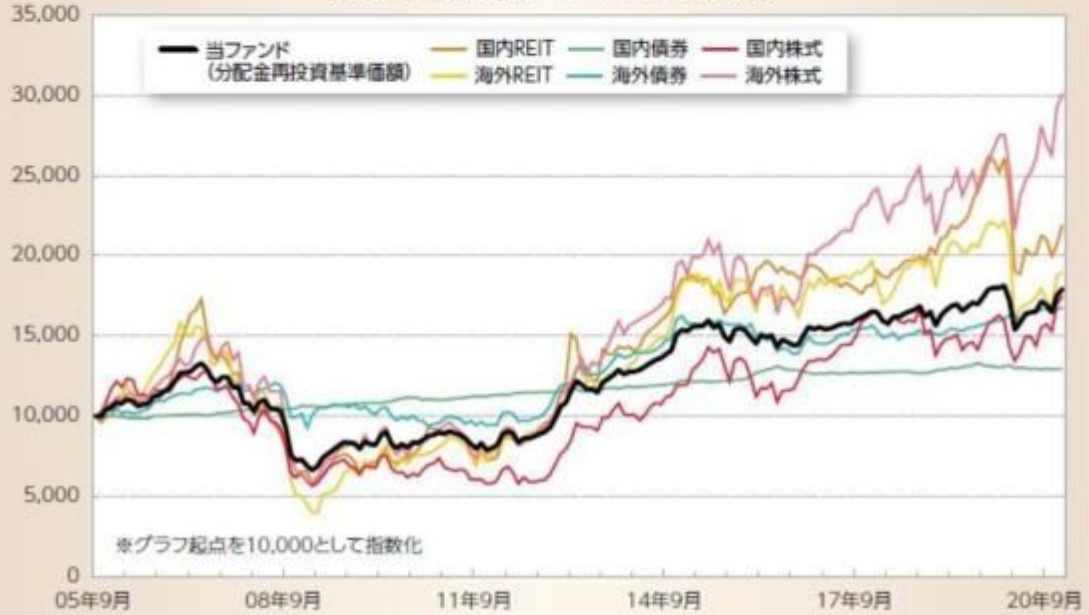
各資産の値動きの特徴

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

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

ご参考：設定来のファンドと各資産の推移（マザーファンドベース）

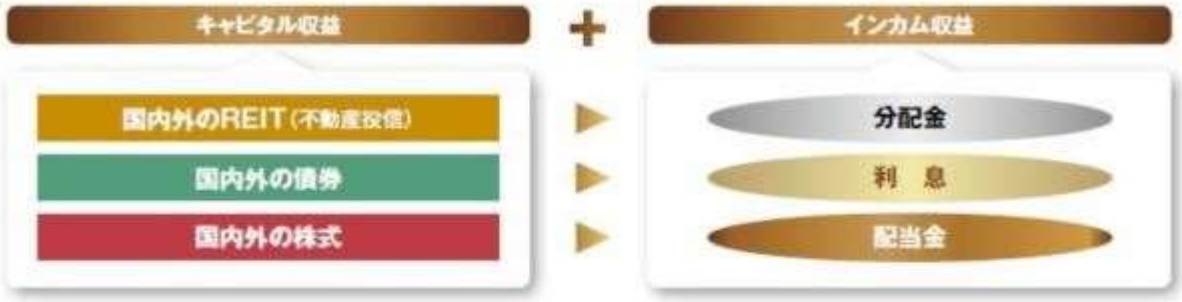
（2005年9月（設定月）～2020年12月、月末値）



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

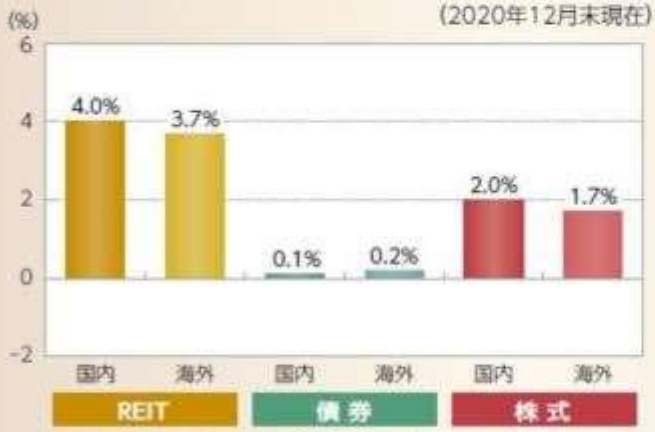
3 インカム収益（投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など）に加え、キャピタル収益（投資した資産自体の値上がり益）を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。

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



ご参考：各指数の利回り

（2020年12月末現在）



◆REIT：実績分配金利回り
　国内：東証REIT指数（配当込み）
　海外：S&P先進国REIT指数（除く日本）
◆債券：最終利回りなど
　国内：NOMURA-BPI総合
　海外：FTSE世界国債インデックス（除く日本）
◆株式：実績配当利回りなど
　国内：TOPIX（東証株価指数）
　海外：MSCI-KOKUSAIインデックス

※利回りは切り捨てにて端数処理しています。

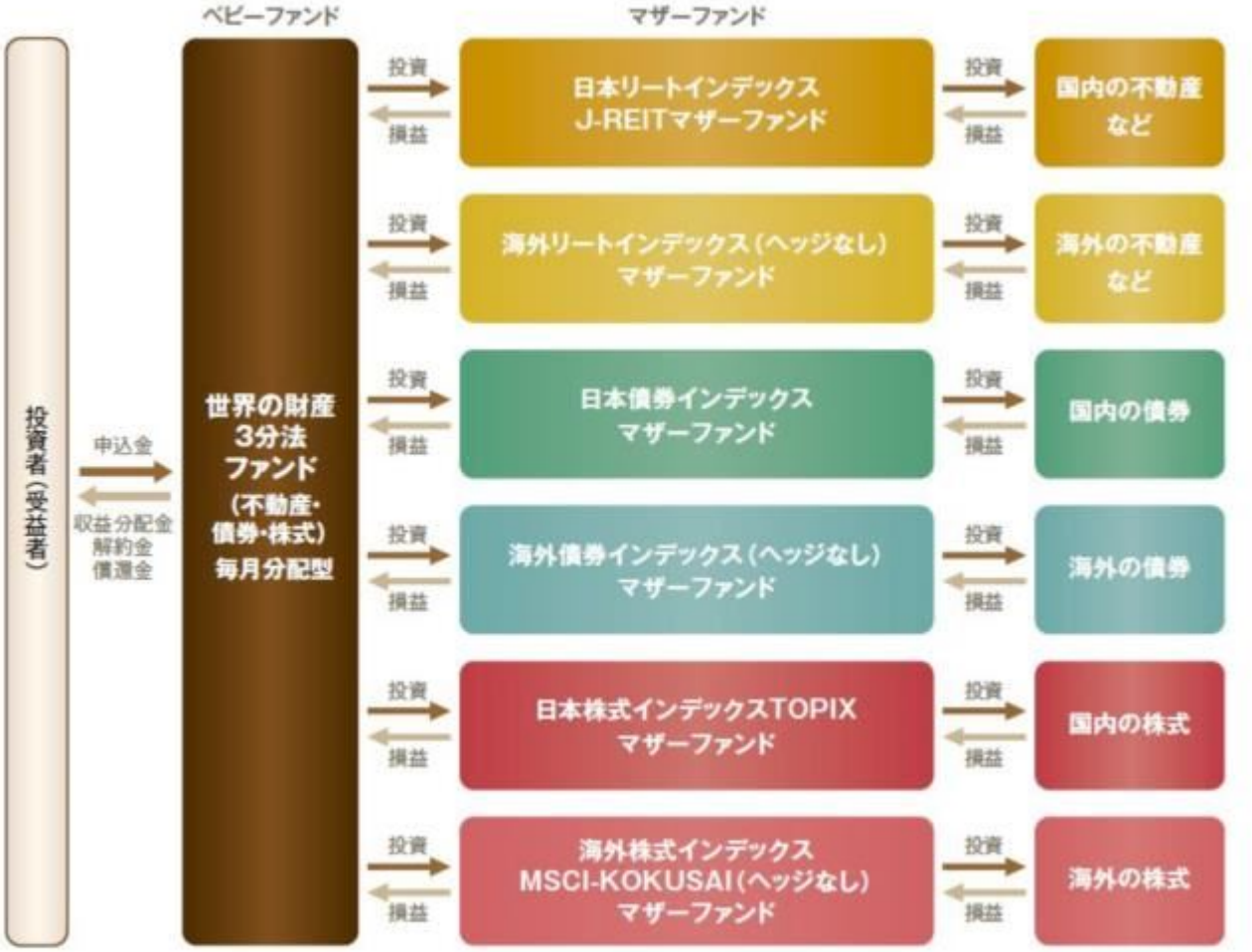
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数（インデックス）の著作権などの権利について

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

■ファンドの仕組み

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



（主な投資制限）

・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

（分配方針）

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託で分配金が支払われるイメージ

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

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合　　分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合

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

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

④　信託金限度額

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

（2）【ファンドの沿革】

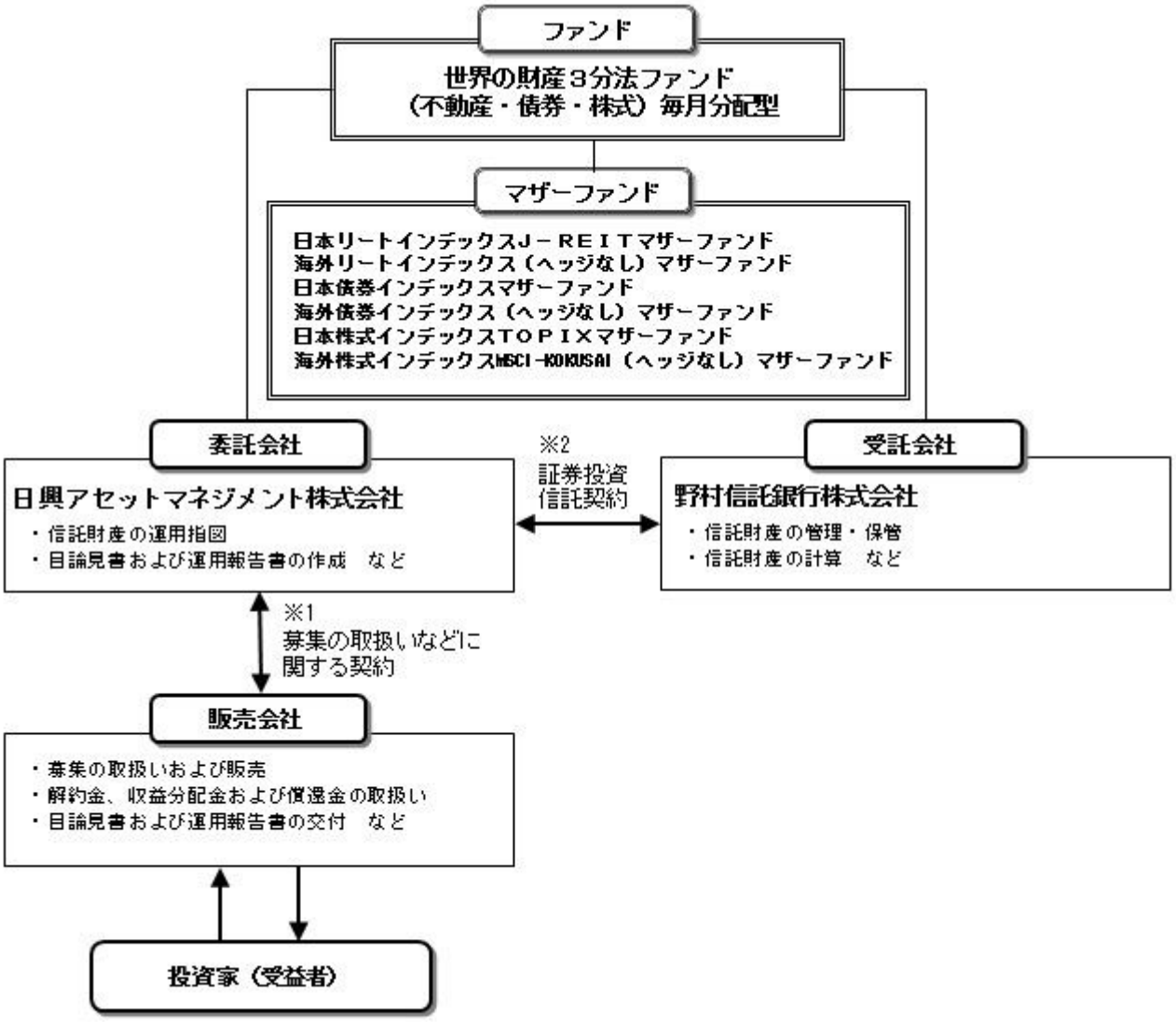
2005年 9月29日

・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年３月９日
・ファンド名称変更
新名称：世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
旧名称：世界の財産３分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

（３）【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



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

② 委託会社の概況（2020年12月末現在）

１）資本金
17,363百万円

２）沿革
1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

３）大株主の状況

名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	179,869,100株	91.29%

DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

（2）【投資対象】

＜世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型＞
投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
　１）有価証券
　２）金銭債権
　３）約束手形
　４）為替手形

② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
　１）証券投資信託「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」
　２）証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
　３）証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
　４）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
　５）証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
　６）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
　７）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
　８）外国または外国の者の発行する証券または証書で、７）の証券の性質を有するもの
　９）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）

10）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
11）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
④　次の取引ができます。
１）外国為替予約取引
２）資金の借入
＜日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド＞
わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）金銭債権
３）約束手形
４）為替手形
②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
２）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
３）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
４）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞
日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）金銭債権
３）約束手形
４）為替手形
②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
２）外国または外国の者の発行する証券または証書で、１）の証券の性質を有するもの
３）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい

ます。）
4）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
5）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
1）預金
2）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3）コール・ローン
4）手形割引市場において売買される手形
④　次の取引ができます。
1）外国為替予約取引

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

わが国の公社債を主要投資対象とします。
①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
1）有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
2）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
3）金銭債権
4）約束手形
5）為替手形
②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
1）国債証券
2）地方債証券
3）特別の法律により法人の発行する債券
4）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
5）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
6）コマーシャル・ペーパー
7）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、１）～６）の証券の性質を有するもの
8）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
9）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
10）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
1）預金
2）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3）コール・ローン
4）手形割引市場において売買される手形
5）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④　次の取引ができます。
１）先物取引等
２）スワップ取引
３）金利先渡取引
４）有価証券の貸付
５）公社債の空売
６）公社債の借入

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞
内外の公社債を主要投資対象とします。

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

②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）国債証券
２）地方債証券
３）特別の法律により法人の発行する債券
４）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
５）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
６）コマーシャル・ペーパー
７）外国または外国の者の発行する証券で、１）～６）の証券の性質を有するもの
８）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
９）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
10）外国法人が発行する譲渡性預金証書
11）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
12）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
13）外国の者に対する権利で12）の有価証券の性質を有するもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。
１）先物取引等
２）スワップ取引

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）～８）の証券の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
14）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引

５）有価証券の貸付
６）公社債の空売
７）公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する証券で、２）～７）の証券の性質を有するもの
10）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
11）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12）に定めるもの以外のもの
12）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
13）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
14）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
15）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
16）外国法人が発行する譲渡性預金証書
17）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
18）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
19）外国の者に対する権利で18）の有価証券の性質を有するもの

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④ 次の取引ができます。

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

◆投資対象とする投資信託証券の概要
＜日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）＊の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

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

＊東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているＪ－ＲＥＩＴ全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。東京証券取引所に上場しているＪ－ＲＥＩＴ全銘柄の時価総額加重平均を2003年３月31日を1,000として指数化したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）＊の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
	主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

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

＊Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）は、スタンダード＆プアーズ ファイナンシャル サービシーズ エル エル シー（Ｓ＆Ｐ社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行なわずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はＳ＆Ｐ社に帰属します。また、Ｓ＆Ｐ社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1998年10月30日設定）

	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		

	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

＊ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

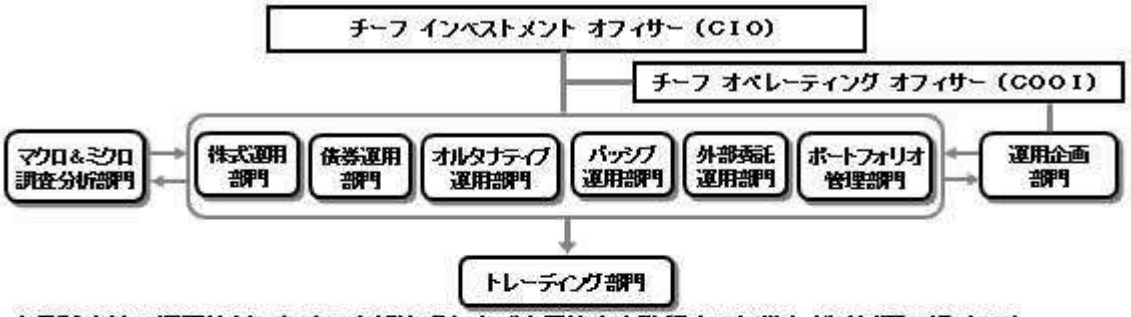
運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）＊に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		

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

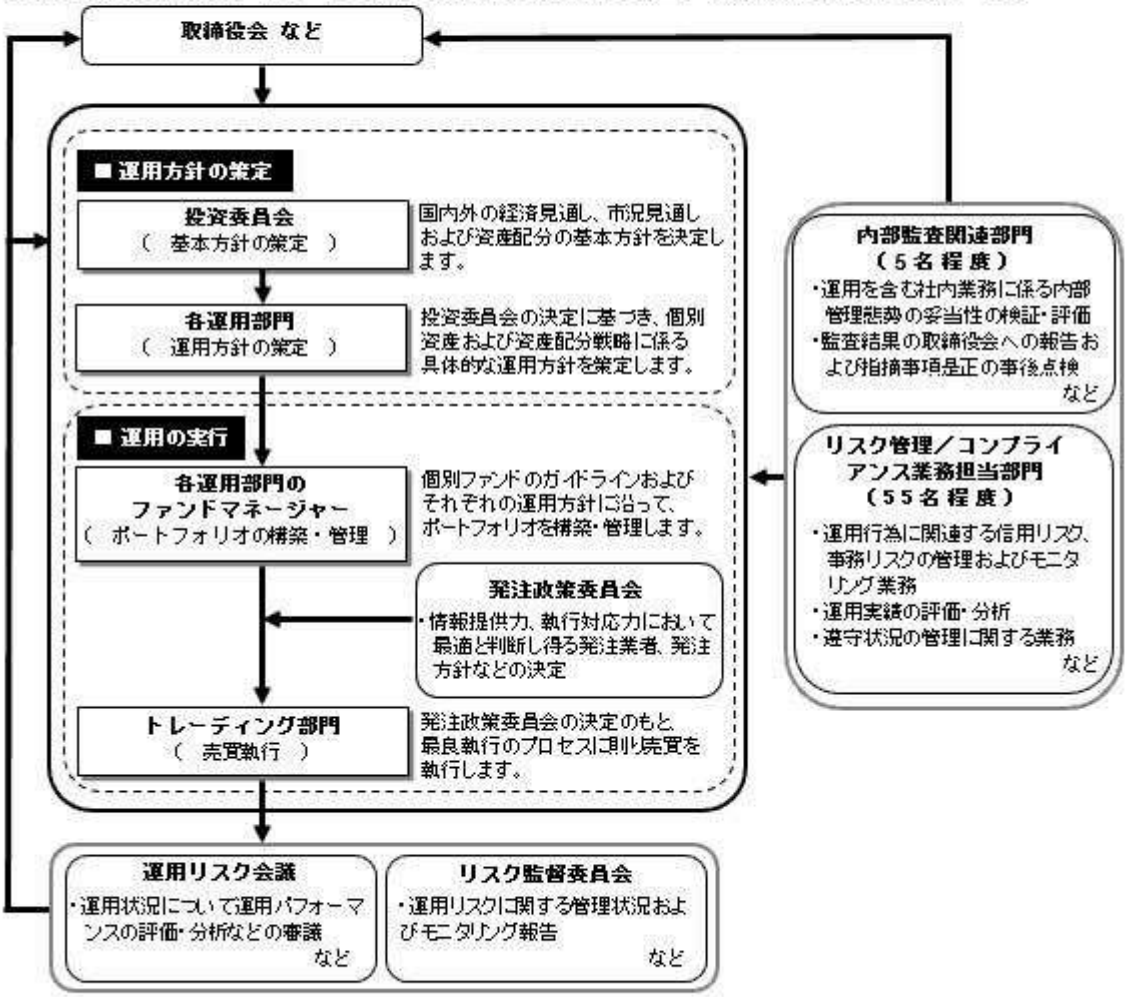
＊MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行なわずに円換算したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

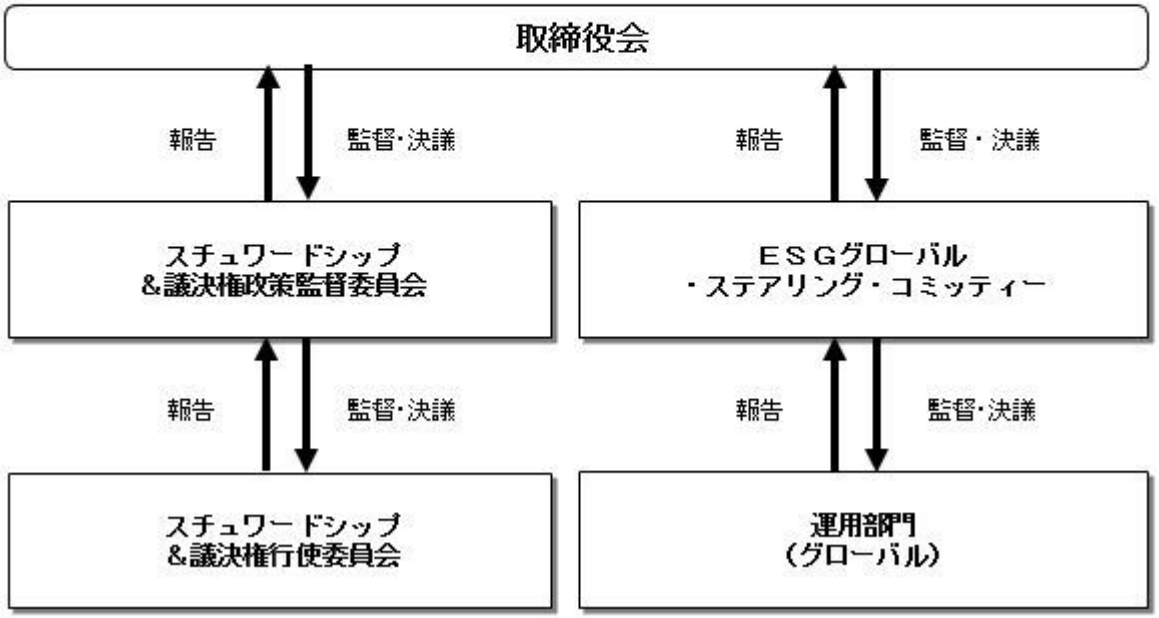


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

ＥＳＧ（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。
（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



※上記体制は2020年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針
毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。
１）分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
２）分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

② 収益分配金の支払い
＜分配金再投資コース＞
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
＜分配金受取りコース＞
毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
＜世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型＞
１）投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
２）有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないませ

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

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

＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞
1）投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
2）有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
3）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
4）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
5）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資は行ないません。

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

4）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

5）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

6）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

7）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

8）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

9）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

10）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

4）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

5）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

6）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を

行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

８）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

９）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

12）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。

２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

３）外貨建資産への投資は行ないません。

４）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

６）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

８）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信

託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

9）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

12）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

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

1）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。

2）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

3）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

4）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

5）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

6）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

7）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

8）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

9）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

10）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が

可能なものについてはこの限りではありません。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

12）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

15）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に不動産投信、債券および株式を実質的な投資対象としますので、不動産投信、債券および株式の価格の下落や、不動産投信、債券および株式の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

・一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴なう不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。

・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおい

ては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

② 流動性リスク

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

③ 信用リスク

・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も不動産投信の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。

・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④ 為替変動リスク

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

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

＜その他の留意事項＞

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

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

基準価額が大きく変動する可能性があります。

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

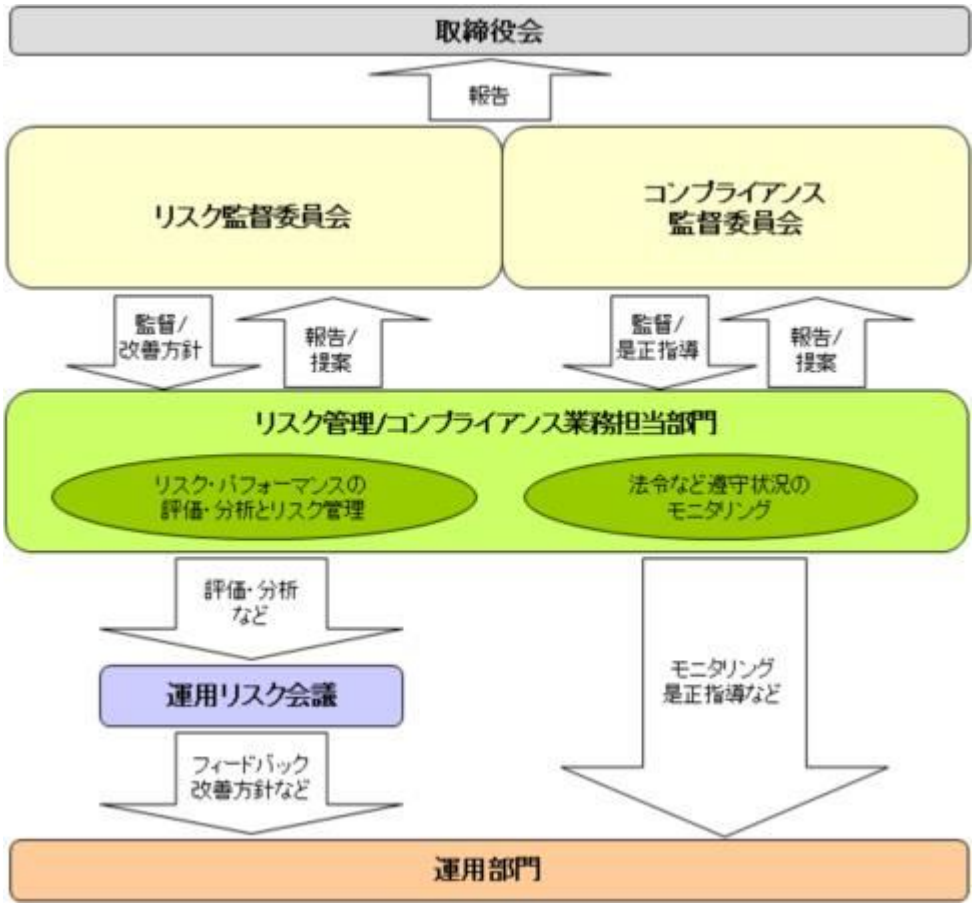
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（2）リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

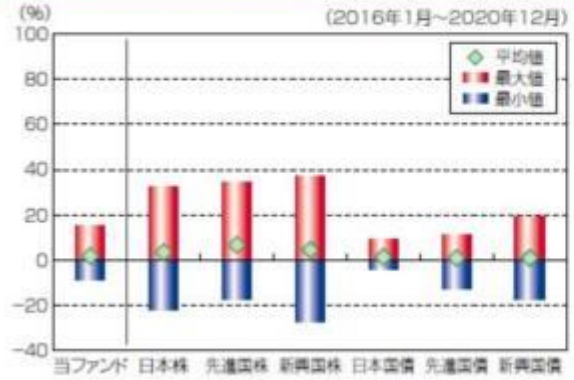
■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は2020年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%)）

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.9%	3.6%	6.8%	4.6%	1.4%	1.0%	1.0%
最大値	15.0%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-8.7%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※上記は2016年1月から2020年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)
先進国株…MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2016年1月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数（TOPIX、配当込）

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

MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

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

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対

象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜３％）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（１口当たり）が差し引かれます。
※「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことです。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.045%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。
※この他に、投資対象とする「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」および「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

委託会社	委託した資金の運用の対価

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③ 支払時期

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

（4）【その他の手数料等】

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

① やむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
② 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。
③ 目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
④ 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑤ 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑥ ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
⑦ 格付の取得に要する費用。
⑧ ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。
⑨ ファンドの主要投資対象の１つである「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）」その他これに類する標章の使用料。
⑩ ファンドの主要投資対象の１つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」その他これに類する標章の使用料。

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

① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。
② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とする投資信託証券に係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができ

ないため、表示することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

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

① 個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

② 法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

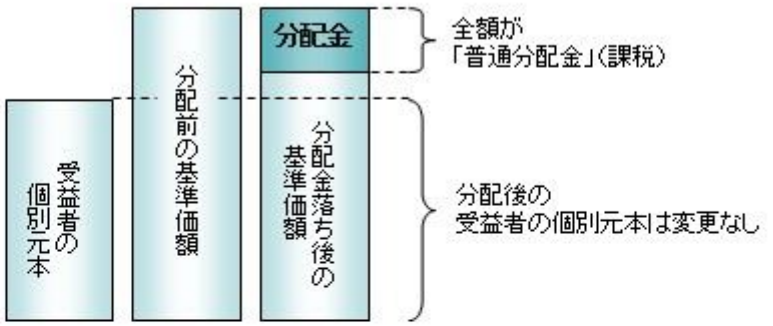
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

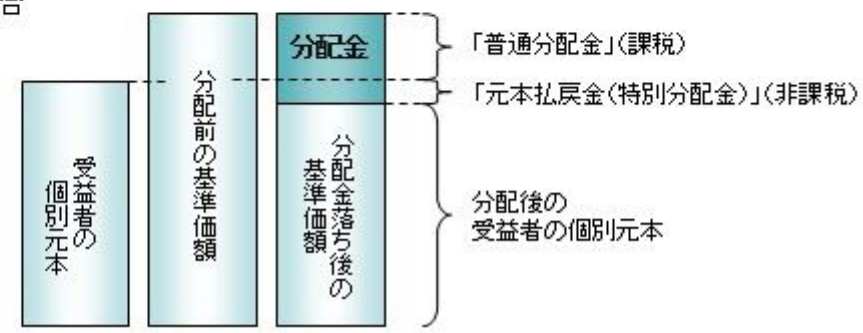
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



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

※上記は2021年3月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	30,761,125,691	98.13
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	587,504,571	1.87
合計（純資産総額）		31,348,630,262	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	2,394,989,986	2.1023	5,034,987,448	2.1957	5,258,679,512	16.77
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	3,056,122,934	1.6942	5,177,683,475	1.7179	5,250,113,588	16.75
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	1,691,565,271	3.0412	5,144,388,303	3.0959	5,236,916,922	16.71
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,561,359,635	1.9664	5,036,657,587	1.9873	5,090,190,002	16.24
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,007,884,611	2.4932	5,006,057,912	2.4862	4,992,002,719	15.92
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	3,488,595,537	1.4165	4,941,595,578	1.4141	4,933,222,948	15.74

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.13
合　　計	98.13

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

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

第22特定期間末	(2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末	(2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末	(2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末	(2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末	(2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末	(2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末	(2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末	(2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末	(2020年 6月15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31特定期間末	(2020年12月15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
	2019年12月末日	32,948	—	0.9197	—
	2020年 1月末日	33,102	—	0.9246	—
	2月末日	31,310	—	0.8766	—
	3月末日	27,701	—	0.7834	—
	4月末日	28,413	—	0.8051	—
	5月末日	29,572	—	0.8314	—
	6月末日	29,760	—	0.8350	—
	7月末日	29,866	—	0.8369	—
	8月末日	30,880	—	0.8674	—
	9月末日	30,442	—	0.8558	—
	10月末日	29,515	—	0.8325	—
	11月末日	30,927	—	0.8842	—
	12月末日	31,348	—	0.9024	—

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

②【分配の推移】

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

第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	0.0060

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	△0.09
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	△9.91
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	7.03
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	12.46
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	19.36
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	△4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	△3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	△1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	△8.10
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	7.91

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

（4）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	1,451,825,844	17,852,733,674
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	1,137,780,912	15,842,664,215
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	787,842,918	13,892,127,349

第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	645,492,480	11,463,657,624
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	755,347,566	13,250,917,932
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256

（参考）

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	98,437,258,590	98.85
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	1,146,649,524	1.15
合計（純資産総額）		99,583,908,114	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人　投資証券	11,598	634,976.01	7,364,451,763	598,000	6,935,604,000	6.96
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	10,305	555,332.69	5,722,703,370	596,000	6,141,780,000	6.17
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人　投資証券	32,199	143,314.82	4,614,593,889	162,600	5,235,557,400	5.26

日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	15,592	295,882.21	4,613,395,418	322,000	5,020,624,000	5.04
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	33,324	136,337.49	4,543,310,516	147,600	4,918,622,400	4.94
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人　投資証券	14,703	256,673.89	3,773,876,204	255,200	3,752,205,600	3.77
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人　投資証券	19,361	137,725.27	2,666,498,952	187,600	3,632,123,600	3.65
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人　投資証券	20,532	141,404.38	2,903,314,730	170,500	3,500,706,000	3.52
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	9,788	297,638.58	2,913,286,421	309,500	3,029,386,000	3.04
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	22,038	116,200.32	2,560,822,652	127,600	2,812,048,800	2.82
日本	投資証券	産業ファンド投資法人　投資証券	14,566	165,103.45	2,404,896,852	190,500	2,774,823,000	2.79
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	30,309	67,753.66	2,053,545,680	75,000	2,273,175,000	2.28
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	5,164	366,314.76	1,891,649,420	435,500	2,248,922,000	2.26
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券	3,188	581,296.7	1,853,173,879	700,000	2,231,600,000	2.24
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	6,416	321,155.65	2,060,534,650	342,000	2,194,272,000	2.20
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	3,551	627,598.03	2,228,600,604	580,000	2,059,580,000	2.07
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	6,733	281,009.53	1,892,037,165	304,500	2,050,198,500	2.06
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人　投資証券	11,484	159,307.05	1,829,482,162	166,400	1,910,937,600	1.92
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人　投資証券	3,597	459,973.05	1,654,523,060	523,000	1,881,231,000	1.89
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	33,196	43,480.93	1,443,392,952	53,000	1,759,388,000	1.77
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人　投資証券	12,105	137,699.86	1,666,856,805	142,300	1,722,541,500	1.73
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人　投資証券	2,196	584,560.29	1,283,694,396	656,000	1,440,576,000	1.45
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人　投資証券	43,088	29,968.39	1,291,277,988	33,150	1,428,367,200	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人　投資証券	10,452	109,599.32	1,145,532,092	132,000	1,379,664,000	1.39
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人　投資証券	3,420	341,342.96	1,167,392,923	399,000	1,364,580,000	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	4,497	311,469.44	1,400,678,071	297,300	1,336,958,100	1.34
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人　投資証券	13,456	94,791.19	1,275,510,252	95,700	1,287,739,200	1.29
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人　投資証券	8,296	131,413	1,090,202,248	153,900	1,276,754,400	1.28
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人　投資証券	6,723	177,741.58	1,194,956,642	189,500	1,274,008,500	1.28
日本	投資証券	日本リート投資法人　投資証券	3,347	340,104.23	1,138,328,857	370,500	1,240,063,500	1.25

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.85
合　　計	98.85

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	65,632,863,806	70.48
	カナダ	1,761,881,803	1.89
	ドイツ	305,946,896	0.33
	イタリア	20,749,793	0.02
	フランス	2,411,810,708	2.59
	オランダ	180,995,530	0.19
	スペイン	449,006,144	0.48
	ベルギー	1,337,960,618	1.44
	アイルランド	136,330,071	0.15
	イギリス	5,273,493,129	5.66
	オーストラリア	7,415,517,116	7.96
	ニュージーランド	269,018,751	0.29
	香港	1,608,293,323	1.73
	シンガポール	3,972,217,167	4.27
	韓国	116,070,772	0.12
	イスラエル	66,900,783	0.07
	ガーンジー	234,338,464	0.25
	マン島	23,649,535	0.03
	小計	91,217,044,409	97.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,909,944,811	2.05
合計（純資産総額）		93,126,989,220	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	390,834,193	0.42
	売建	—	391,276,000	△0.42

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	521,474	9,777.64	5,098,787,648	10,114.01	5,274,198,465	5.66
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	62,890	70,198.87	4,414,807,249	73,358.73	4,613,530,530	4.95
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	197,820	14,125.68	2,794,342,018	14,283.00	2,825,463,060	3.03
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	107,402	20,336.71	2,184,203,865	23,577.30	2,532,249,175	2.72
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	231,407	7,848.40	1,816,175,856	8,620.51	1,994,847,515	2.14
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	294,410	5,688.35	1,674,710,067	6,539.12	1,925,185,263	2.07
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,188,184	1,169.19	1,389,221,406	1,521.61	1,807,955,033	1.94
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	98,568	16,899.47	1,665,747,944	16,271.23	1,603,823,091	1.72
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	87,415	16,548.61	1,446,597,180	18,129.06	1,584,751,780	1.70
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	247,790	6,238.97	1,545,956,854	6,310.39	1,563,652,777	1.68
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	241,904	6,549.48	1,584,345,410	6,040.25	1,461,163,055	1.57
香港	投資証券	LINK REIT	1,462,000	893.78	1,306,710,015	946.51	1,383,804,930	1.49
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	264,162	4,062.37	1,073,125,105	5,074.60	1,340,517,806	1.44
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	395,627	2,862.81	1,132,604,932	3,012.88	1,191,978,654	1.28
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	75,949	14,410.30	1,094,448,254	15,435.98	1,172,348,004	1.26
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	380,006	2,831.76	1,076,085,791	3,080.16	1,170,479,281	1.26
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	841,193	1,224.82	1,030,312,702	1,339.19	1,126,522,267	1.21
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	46,043	25,738.37	1,185,072,230	24,305.93	1,119,118,395	1.20
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	91,324	10,007.41	913,917,168	11,779.33	1,075,735,990	1.16
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	262,440	3,659.76	960,467,415	4,082.04	1,071,290,578	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	80,728	12,303.04	993,200,217	12,859.87	1,038,151,989	1.11
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	378,260	2,312.19	874,608,990	2,614.41	988,926,727	1.06
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	100,086	9,954.62	996,319,098	9,655.51	966,381,874	1.04
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	123,838	7,138.39	884,004,560	7,261.55	899,257,067	0.97
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	378,189	1,998.58	755,842,863	2,245.95	849,393,585	0.91
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,671,027	179.75	659,886,193	224.69	824,857,741	0.89
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	97,791	7,252.65	709,244,238	8,317.76	813,402,459	0.87
アメリカ	投資証券	UDR INC	208,181	4,033.39	839,676,204	3,878.14	807,356,104	0.87
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	119,697	6,567.07	786,059,176	6,417.00	768,095,649	0.82
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	497,935	1,299.95	647,295,582	1,485.22	739,545,510	0.79

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.95
合　　計	97.95

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,776,905.62	391,239,000	390,834,193	0.42
	加ドル	売建	500,000.00	40,305,000	40,410,000	△0.04
	英ポンド	売建	1,100,000.00	154,209,000	153,791,000	△0.17
	豪ドル	売建	2,500,000.00	196,725,000	197,075,000	△0.21

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	34,197,141,966	76.00
地方債証券	日本	3,658,476,000	8.13
特殊債券	日本	4,603,291,044	10.23
社債券	日本	2,432,387,033	5.41
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	101,983,496	0.23
合計（純資産総額）		44,993,279,539	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	820,000,000	100.96	827,872,000	101.07	828,823,200	0.100	2029/12/20	1.84
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	102.09	714,672,000	102.04	714,308,000	0.300	2025/12/20	1.59
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	610,000,000	101.23	617,545,700	101.19	617,307,800	0.100	2026/12/20	1.37
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	600,000,000	100.89	605,398,000	100.89	605,388,000	0.100	2030/6/20	1.35

日本	国債証券	第１４０回利付国債（２０年）	448,000,000	118.60	531,345,920	118.58	531,269,760	1.700	2032/9/20	1.18
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	450,000,000	115.24	518,589,000	115.45	519,552,000	1.300	2035/6/20	1.15
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	510,000,000	100.88	514,532,400	101.01	515,166,300	0.100	2030/3/20	1.14
日本	国債証券	第１４４回利付国債（２０年）	430,000,000	116.64	501,552,000	116.67	501,681,000	1.500	2033/3/20	1.12
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	490,000,000	102.44	501,995,200	102.32	501,412,100	0.500	2024/9/20	1.11
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	490,000,000	101.33	496,517,000	101.36	496,693,400	0.100	2027/12/20	1.10
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	490,000,000	101.28	496,306,300	101.24	496,115,200	0.100	2027/3/20	1.10
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	480,000,000	101.33	486,422,400	101.34	486,436,800	0.100	2028/3/20	1.08
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	435,000,000	101.30	440,681,100	101.35	440,872,500	0.100	2028/6/20	0.98
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	420,000,000	102.46	430,336,200	102.46	430,340,400	0.400	2025/9/20	0.96
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	355,000,000	119.31	423,554,050	119.31	423,582,450	1.700	2033/6/20	0.94
日本	国債証券	第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	119.67	410,474,960	119.44	409,682,630	2.100	2030/3/20	0.91
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	350,000,000	113.75	398,132,000	113.89	398,618,500	1.200	2035/3/20	0.89
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	390,000,000	102.31	399,044,100	102.19	398,568,300	0.400	2025/3/20	0.89
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	390,000,000	101.26	394,949,100	101.35	395,292,300	0.100	2028/9/20	0.88
日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	350,000,000	111.09	388,821,500	111.21	389,252,500	1.000	2035/12/20	0.87
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	370,000,000	102.38	378,809,700	102.33	378,621,000	0.400	2025/6/20	0.84
日本	国債証券	第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	118.84	344,650,500	118.65	344,087,900	2.100	2029/9/20	0.76
日本	国債証券	第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	113.62	340,884,000	113.20	339,603,000	2.300	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第４６回利付国債（３０年）	250,000,000	122.67	306,690,000	122.78	306,962,500	1.500	2045/3/20	0.68
日本	国債証券	第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	103.29	304,720,250	103.00	303,861,800	1.400	2022/12/20	0.68
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	285,000,000	102.71	292,729,200	103.01	293,604,150	0.500	2038/3/20	0.65
日本	国債証券	第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	114.24	285,600,000	113.78	284,452,500	2.300	2026/9/20	0.63
日本	国債証券	第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	117.20	269,562,300	117.19	269,537,000	1.600	2032/6/20	0.60
日本	国債証券	第３４回利付国債（３０年）	200,000,000	134.70	269,406,000	134.65	269,314,000	2.200	2041/3/20	0.60
日本	国債証券	第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	117.03	257,468,200	116.94	257,279,000	1.600	2032/3/20	0.57

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.00
地方債証券	8.13
特殊債券	10.23
社債券	5.41

合　　計	99.77

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	65,477,403,718	42.42
	カナダ	3,023,536,719	1.96
	メキシコ	1,310,463,688	0.85
	ドイツ	11,990,293,303	7.77
	イタリア	14,676,216,580	9.51
	フランス	16,375,362,050	10.61
	オランダ	3,036,209,040	1.97
	スペイン	9,352,408,685	6.06
	ベルギー	3,909,075,279	2.53
	オーストリア	2,351,993,710	1.52
	フィンランド	983,282,747	0.64
	アイルランド	1,308,499,404	0.85
	イギリス	10,300,610,945	6.67
	スウェーデン	518,768,092	0.34
	ノルウェー	339,715,179	0.22
	デンマーク	801,256,288	0.52
	ポーランド	965,771,083	0.63
	オーストラリア	4,209,464,809	2.73
	シンガポール	676,973,597	0.44
	マレーシア	759,345,087	0.49
	イスラエル	683,811,881	0.44
	小計	153,050,461,884	99.15
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,304,667,162	0.85
合計（純資産総額）		154,355,129,046	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	312,149,280	0.20
	売建	—	68,987,184	△0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,369.70	829,576,628	10,379.51	830,361,042	0.250	2023/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,345.72	827,657,887	10,349.19	827,935,317	0.125	2022/10/31	0.54
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	24,020.10	729,010,277	24,069.26	730,502,132	4.500	2041/4/25	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,590,000	10,167.25	670,022,289	10,099.33	665,546,238	0.625	2030/5/15	0.43
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,005,000	21,271.74	639,215,847	21,362.58	641,945,752	2.500	2044/7/4	0.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,885,000	21,775.09	628,211,599	21,777.76	628,288,512	4.750	2035/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,663.73	607,832,859	10,638.26	606,380,992	1.875	2022/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,047.23	595,133,532	11,981.13	591,868,076	2.875	2028/5/15	0.38
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,692,000	21,837.93	587,877,317	21,945.15	590,763,527	2.500	2046/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	11,939.69	593,402,830	11,865.10	589,695,585	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,019.91	584,055,722	10,990.80	582,512,925	2.500	2023/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	11,317.27	581,708,189	11,297.67	580,700,334	2.250	2025/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,835,000	15,091.81	578,771,144	15,128.94	580,195,189	1.250	2034/5/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	14,609.78	574,164,623	14,506.23	570,094,986	4.250	2023/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,040,000	11,275.43	568,281,919	11,257.64	567,385,376	2.000	2026/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,157.38	560,100,512	11,145.65	559,511,944	2.000	2025/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,540,000	21,989.00	558,520,841	21,922.93	556,842,473	5.750	2032/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	13,616.71	558,285,468	13,541.11	555,185,719	3.000	2048/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	12,319.32	555,601,769	12,240.08	552,027,923	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	11,094.30	551,387,202	11,081.37	550,744,208	2.000	2025/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,458.17	549,992,525	11,433.51	548,808,750	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	11,681.55	549,032,911	11,645.36	547,332,233	3.000	2025/9/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,186.89	536,970,900	11,170.31	536,175,275	2.125	2025/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,019.64	533,350,818	11,015.47	533,148,839	1.625	2026/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,648.37	532,418,542	10,609.04	530,452,042	2.500	2022/1/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,745,000	19,246.33	528,311,784	19,182.20	526,551,622	5.500	2029/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,900,000	13,462.68	525,044,548	13,402.84	522,710,967	3.000	2045/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,176.38	516,348,861	11,155.56	515,386,927	2.375	2024/8/15	0.33
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,175,000	16,237.56	515,542,614	16,229.22	515,277,878	2.500	2030/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,275.36	513,768,173	10,256.20	512,810,156	0.500	2027/10/31	0.33

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.15
合　　計	99.15

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,500,000.00	259,475,000	258,700,000	0.17
	加ドル	買建	99,000.00	8,004,077	8,001,180	0.01
	ユーロ	買建	358,000.00	45,471,441	45,448,100	0.03
	米ドル	売建	666,671.68	68,996,018	68,987,184	△0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	36,410,111,820	99.49
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	188,321,046	0.51
合計（純資産総額）		36,598,432,866	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	162,405,000	0.44

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	162,500	6,991.12	1,136,057,000	7,957.00	1,293,012,500	3.53
日本	株式	ソニー	電気機器	91,300	8,030.82	733,213,866	10,285.00	939,020,500	2.57
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	113,400	6,891.58	781,505,172	8,058.00	913,777,200	2.50
日本	株式	キーエンス	電気機器	13,200	48,467.19	639,767,000	58,000.00	765,600,000	2.09
日本	株式	任天堂	その他製品	8,900	55,090.00	490,301,000	65,830.00	585,887,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	191,100	2,232.33	426,598,263	2,645.50	505,555,050	1.38
日本	株式	日本電産	電気機器	35,100	10,662.21	374,243,610	12,980.00	455,598,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	121,200	3,497.51	423,898,212	3,755.00	455,106,000	1.24
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	982,700	423.56	416,232,412	456.10	448,209,470	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	24,500	14,642.48	358,741,000	18,040.00	441,980,000	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	125,000	2,685.35	335,668,750	3,535.00	441,875,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	99,700	4,150.14	413,768,958	4,321.00	430,803,700	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,600	19,481.62	362,358,175	22,920.00	426,312,000	1.16
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	28,900	11,794.25	340,853,877	14,270.00	412,403,000	1.13
日本	株式	村田製作所	電気機器	42,800	7,394.69	316,492,732	9,320.00	398,896,000	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,200	28,513.22	262,321,624	38,400.00	353,280,000	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	13,700	21,612.61	296,092,812	25,360.00	347,432,000	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,700	2,588.24	296,871,128	2,877.50	330,049,250	0.90
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	104,200	2,799.97	291,756,874	3,066.00	319,477,200	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	99,400	2,981.21	296,332,274	3,188.00	316,887,200	0.87
日本	株式	エムスリー	サービス業	30,700	6,733.55	206,719,985	9,743.00	299,110,100	0.82
日本	株式	ＳＭＣ	機械	4,600	56,544.73	260,105,775	62,950.00	289,570,000	0.79
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	97,300	2,556.11	248,710,100	2,964.00	288,397,200	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	70,000	3,670.68	256,947,600	4,065.00	284,550,000	0.78
日本	株式	花王	化学	34,900	7,553.21	263,607,216	7,970.00	278,153,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	50,800	4,932.63	250,577,604	5,308.00	269,646,400	0.74
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	195,200	1,311.19	255,944,288	1,307.50	255,224,000	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	14,800	15,366.85	227,429,500	17,040.00	252,192,000	0.69
日本	株式	中外製薬	医薬品	45,600	4,172.33	190,258,665	5,503.00	250,936,800	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,100	2,443.93	229,973,813	2,541.00	239,108,100	0.65

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.34
		食料品	3.51
		繊維製品	0.47

		パルプ・紙	0.22
		化学	7.54
		医薬品	5.90
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.50
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.61
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.60
		機械	5.74
		電気機器	17.22
		輸送用機器	7.36
		精密機器	2.79
		その他製品	2.76
		電気・ガス業	1.29
		陸運業	3.47
		海運業	0.19
		空運業	0.38
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.11
		卸売業	4.54
		小売業	4.77
		銀行業	4.43
		証券、商品先物取引業	0.77
		保険業	1.90
		その他金融業	1.11
		不動産業	1.93
		サービス業	5.76
合　　計			99.49

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物　２０２１年０３月	買建	9	日本円	161,164,950	162,405,000	0.44

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

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2020年12月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	149,094,164,608	66.54
	カナダ	7,621,722,103	3.40
	ドイツ	7,016,309,846	3.13
	イタリア	1,390,330,115	0.62
	フランス	7,663,496,155	3.42
	オランダ	4,009,668,272	1.79
	スペイン	1,882,044,721	0.84
	ベルギー	677,303,992	0.30
	オーストリア	131,099,499	0.06
	ルクセンブルク	222,062,528	0.10
	フィンランド	905,134,867	0.40
	アイルランド	4,217,011,151	1.88
	ポルトガル	121,050,187	0.05
	イギリス	9,908,352,133	4.42
	スイス	7,876,742,956	3.52
	スウェーデン	2,413,187,024	1.08
	ノルウェー	438,451,715	0.20
	デンマーク	1,897,572,736	0.85
	ケイマン	385,027,628	0.17
	オーストラリア	4,760,480,705	2.12
	バミューダ	341,325,091	0.15
	ニュージーランド	286,650,636	0.13
	パプアニューギニア	22,086,491	0.01
	香港	1,887,925,763	0.84
	シンガポール	659,301,218	0.29
	イスラエル	534,048,525	0.24
	ジャージー	642,685,686	0.29
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	34,664,035	0.02
	小計	217,039,900,386	96.87
投資証券	アメリカ	3,936,509,069	1.76
	カナダ	50,630,457	0.02
	フランス	124,399,900	0.06
	イギリス	151,570,593	0.07
	オーストラリア	365,371,378	0.16
	香港	96,355,227	0.04

	シンガポール	132,876,755	0.06
	小計	4,857,713,379	2.17
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	2,153,406,483	0.96
合計（純資産総額）		224,051,020,248	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,732,543,425	0.77
	買建	ドイツ	354,761,775	0.16

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	―	1,332,828,000	0.59
	売建	―	389,842,200	△0.17

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	776,348	11,906.64	9,243,696,151	13,959.04	10,837,076,668	4.84
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	326,314	22,379.80	7,302,843,689	23,199.52	7,570,329,801	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	19,325	331,655.40	6,409,240,605	343,827.00	6,644,456,775	2.97
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	109,100	29,475.76	3,215,805,962	28,646.73	3,125,358,243	1.39
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,630	169,013.43	2,303,653,051	181,928.16	2,479,680,821	1.11
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,622	169,843.50	2,313,608,157	182,027.51	2,479,578,877	1.11
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	33,845	43,535.20	1,473,449,013	68,929.96	2,332,934,665	1.04
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	119,381	15,032.34	1,794,575,782	15,953.49	1,904,543,590	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	138,210	10,744.33	1,484,974,540	12,938.53	1,788,234,922	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	76,432	20,494.03	1,566,400,083	22,187.29	1,695,819,331	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	112,459	14,736.33	1,657,232,936	14,326.47	1,611,140,490	0.72

スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	130,593	12,483.50	1,630,258,238	12,253.89	1,600,272,257	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	43,090	34,217.10	1,474,414,839	35,950.72	1,549,116,740	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	63,540	22,015.48	1,398,863,917	23,760.49	1,509,741,852	0.67
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	81,932	13,284.22	1,088,403,123	18,350.55	1,503,497,263	0.67
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	27,980	56,263.63	1,574,256,507	53,585.05	1,499,309,839	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	40,500	34,114.63	1,381,642,717	35,879.31	1,453,112,055	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	48,800	29,290.50	1,429,376,400	27,550.66	1,344,472,452	0.60
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	50,697	21,014.63	1,065,379,204	23,911.60	1,212,246,639	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,818	34,840.40	1,108,552,165	35,959.19	1,144,149,587	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	187,507	5,998.85	1,124,828,242	6,086.83	1,141,324,170	0.51
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	21,729	50,559.75	1,098,612,808	51,968.38	1,129,221,038	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	206,914	4,663.70	964,986,890	5,335.42	1,103,974,128	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	19,990	50,536.98	1,010,234,231	54,945.04	1,098,351,450	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	353,489	2,577.14	910,994,176	3,106.03	1,097,949,206	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	184,842	5,228.81	966,505,546	5,602.45	1,035,568,987	0.46
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	192,672	4,988.69	961,182,806	5,111.86	984,913,253	0.44
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	100,563	8,959.63	901,007,472	9,662.53	971,693,205	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	19,282	40,192.36	774,989,278	50,310.28	970,082,915	0.43
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	251,770	3,740.49	941,743,168	3,834.67	965,456,125	0.43

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	2.89
		素材	4.41
		資本財	6.37
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	2.03
		自動車・自動車部品	1.99
		耐久消費財・アパレル	1.97

		消費者サービス	1.57
		メディア・娯楽	6.89
		小売	6.04
		食品・生活必需品小売り	1.44
		食品・飲料・タバコ	4.17
		家庭用品・パーソナル用品	2.00
		ヘルスケア機器・サービス	5.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.72
		銀行	5.50
		各種金融	4.30
		保険	3.11
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	12.06
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.29
		電気通信サービス	1.86
		公益事業	3.21
		半導体・半導体製造装置	4.23
投資証券	—	—	2.17
合　　計			99.04

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（各通貨）	契約額等（円）	評価額（各通貨）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2103	買建	90	米ドル	16,592,950	1,717,370,325	16,739,550	1,732,543,425	0.77
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2103	買建	90	ユーロ	2,766,570	351,216,061	2,794,500	354,761,775	0.16

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	10,800,000.00	1,119,987,150	1,116,939,000	0.50
	ユーロ	買建	1,700,000.00	214,009,500	215,889,000	0.10
	加ドル	売建	1,140,000.00	91,653,720	92,134,800	△0.04
	英ポンド	売建	1,340,000.00	187,972,520	187,345,400	△0.08
	豪ドル	売建	1,400,000.00	109,960,200	110,362,000	△0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2020年12月30日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額……9,024円

純資産総額……313.48億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2010年12月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

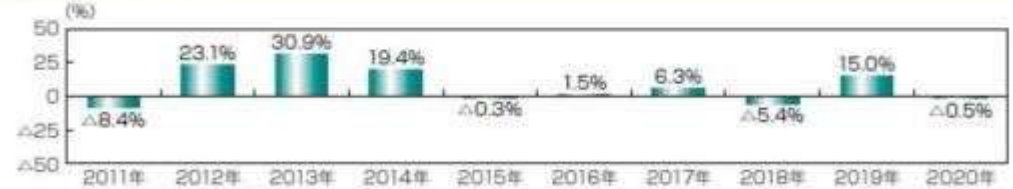
2020年8月	2020年9月	2020年10月	2020年11月	2020年12月	直近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,060円

主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.8%	日本ビルファンド投資法人　投資証券	日本	7.0%
			ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	日本	6.2%
			GLP投資法人　投資証券	日本	5.3%
			日本プロロジスリート投資法人　投資証券	日本	5.0%
			野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	日本	4.9%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	5.7%
			EQUINIX INC	アメリカ	5.0%
			DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.0%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.7%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	2.1%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	15.7%	第357回利付国債(10年)	日本	1.8%
			第341回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第359回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第140回利付国債(20年)	日本	1.2%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	15.9%	US TREASURY N/B(0.25%)	アメリカ	0.5%
			US TREASURY N/B(0.125%)	アメリカ	0.5%
			FRANCE (GOVT OF)(4.5%)	フランス	0.5%
			US TREASURY N/B(0.625%)	アメリカ	0.4%
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND(2.5%)	ドイツ	0.4%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.7%	トヨタ自動車	日本	3.5%
			ソニー	日本	2.6%
			ソフトバンクグループ	日本	2.5%
			キーエンス	日本	2.1%
			任天堂	日本	1.6%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.7%	APPLE INC	アメリカ	4.8%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	3.4%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	3.0%
			FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.4%
			ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
現金その他		1.9%			

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

年間収益率の推移



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

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第２【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（2）コースの選択

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

＜分配金再投資コース＞

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

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（3）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（4）取扱時間

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

（5）取得申込不可日

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

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ニューヨークの銀行休業日

（6）申込金額

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

（7）申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（8）申込代金の支払い

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

（9）受付の中止および取消

委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

（10）償還乗換

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

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

（11）乗換優遇

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

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（1）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（2）取扱時間

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

（3）解約請求不可日

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

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ニューヨークの銀行休業日

（4）解約制限

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

（5）解約価額

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

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

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（6）手取額

１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（7）解約単位

１口単位

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

（8）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。

（9）受付の中止および取消

・委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

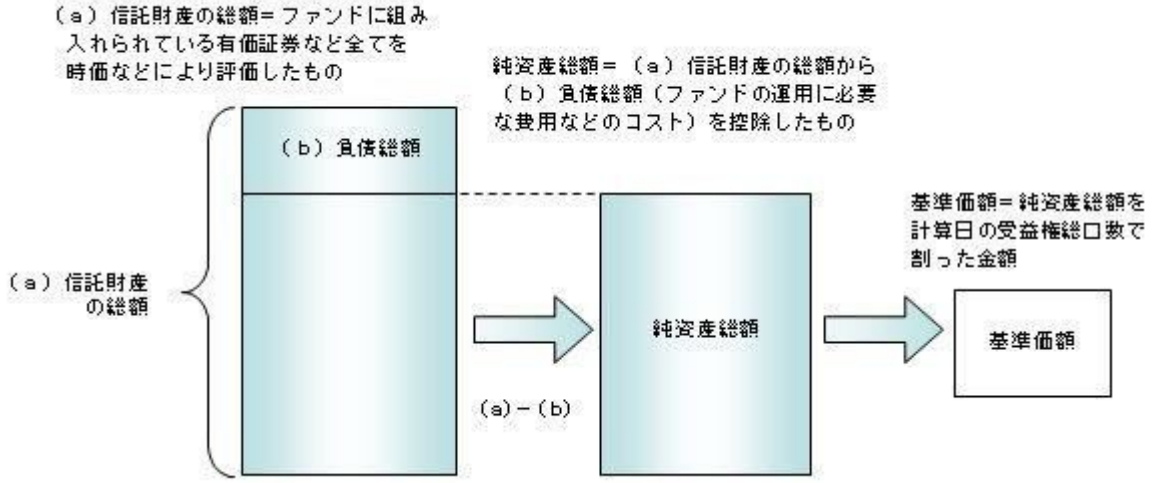
① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは１万口当たり

に換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

・価格情報会社の提供する価額

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

＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

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

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

２）この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（１ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

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

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

② 償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更

１）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

２）この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

４）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

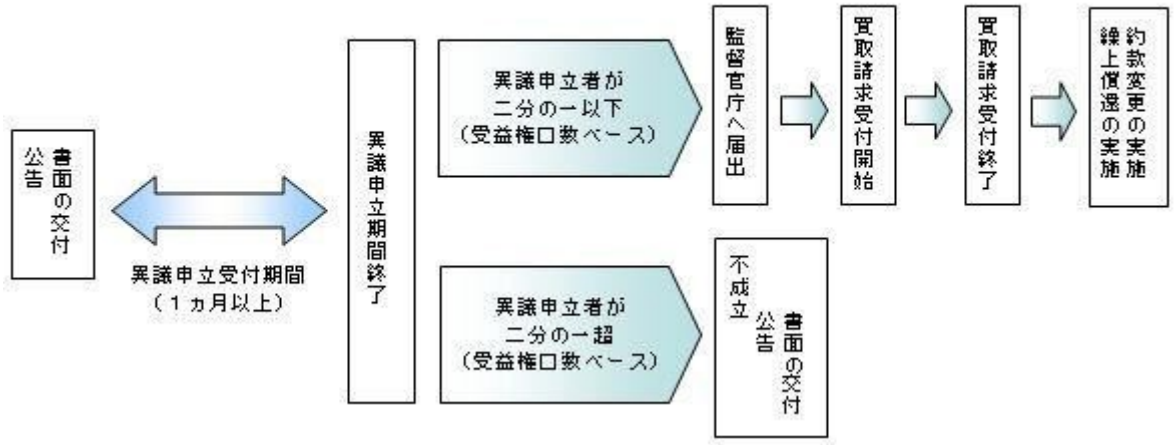
④ 異議の申立て

１）繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

２）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

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

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤　公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥　運用報告書の作成

・委託会社は、年２回（６月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

⑦　関係法人との契約について

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

（３）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2020年 6月16日から2020年12月15日までの特定期間の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2020年 6月15日現在	当期 2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	665,267,678	643,947,177
親投資信託受益証券	28,995,277,661	30,429,472,077
未収入金	2,444,443	16,841,486
流動資産合計	29,662,989,782	31,090,260,740
資産合計	29,662,989,782	31,090,260,740
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	35,584,769	34,811,559
未払解約金	23,826,746	19,823,469
未払受託者報酬	1,369,616	1,350,478
未払委託者報酬	24,653,307	24,308,797
未払利息	273	334
その他未払費用	6,122,046	3,187,878
流動負債合計	91,556,757	83,482,515
負債合計	91,556,757	83,482,515
純資産の部		
元本等		
元本	35,584,769,481	34,811,559,623
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△6,013,336,456	△3,804,781,398
（分配準備積立金）	3,263,575,925	3,190,152,896
元本等合計	29,571,433,025	31,006,778,225
純資産合計	29,571,433,025	31,006,778,225
負債純資産合計	29,662,989,782	31,090,260,740

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　2019年12月17日 至　2020年 6月15日	当期 自　2020年 6月16日 至　2020年12月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△2,484,225,345	2,481,808,237
営業収益合計	△2,484,225,345	2,481,808,237
営業費用		
支払利息	85,697	77,829
受託者報酬	8,300,682	8,373,385
委託者報酬	149,413,385	150,722,059
その他費用	3,351,485	3,749,662
営業費用合計	161,151,249	162,922,935
営業利益又は営業損失（△）	△2,645,376,594	2,318,885,302
経常利益又は経常損失（△）	△2,645,376,594	2,318,885,302
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,645,376,594	2,318,885,302
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（△）	△20,122,962	1,457,241
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△3,204,923,764	△6,013,336,456
剰余金増加額又は欠損金減少額	270,286,028	271,896,897
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	270,286,028	271,896,897
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	239,947,373	168,379,854
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	239,947,373	168,379,854
分配金	213,497,715	212,390,046
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△6,013,336,456	△3,804,781,398

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		前期 2020年 6月15日現在	当期 2020年12月15日現在
１．	期首元本額	35,945,058,246円	35,584,769,481円
	期中追加設定元本額	1,727,094,985円	1,154,110,398円
	期中一部解約元本額	2,087,383,750円	1,927,320,256円
２．	受益権の総数	35,584,769,481口	34,811,559,623口
３．	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	6,013,336,456円	3,804,781,398円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日		当期 自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2019年12月17日		自 2020年 6月16日	
至 2020年 1月15日		至 2020年 7月15日	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	69,680,913円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	60,345,416円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	349,535,548円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	536,242,032円	C 信託約款に定める収益調整金	682,287,758円
D 信託約款に定める分配準備積立金	2,453,614,862円	D 信託約款に定める分配準備積立金	3,245,966,494円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	3,409,073,355円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	3,988,599,668円
F 分配対象収益(1万口当たり)	952円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,118円
G 分配金額	35,807,761円	G 分配金額	35,650,697円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2020年 1月16日		自 2020年 7月16日	
至 2020年 2月17日		至 2020年 8月17日	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	48,900,190円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	46,731,995円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	482,921,287円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	563,958,711円	C 信託約款に定める収益調整金	701,909,383円

D	信託約款に定める分配準備積立金	2,808,544,640円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,904,324,828円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,090円
G	分配金額	35,791,550円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年 2月18日 至　2020年 3月16日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	43,070,644円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	581,872,717円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,258,039,212円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,882,982,573円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,093円
G	分配金額	35,517,220円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年 3月17日 至　2020年 4月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	105,843,252円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	598,517,704円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,228,488,720円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,932,849,676円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,113円
G	分配金額	35,321,052円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年 4月16日 至　2020年 5月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	18,349,787円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	628,724,829円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,286,170,817円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,933,245,433円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,108円
G	分配金額	35,475,363円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年 5月16日 至　2020年 6月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	46,045,621円

D	信託約款に定める分配準備積立金	3,251,232,727円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,999,874,105円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,122円
G	分配金額	35,648,476円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年 8月18日 至　2020年 9月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	55,994,637円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	721,950,879円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,235,169,640円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	4,013,115,156円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,127円
G	分配金額	35,579,020円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年 9月16日 至　2020年10月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	63,924,621円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	739,352,370円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,234,359,259円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	4,037,636,250円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,136円
G	分配金額	35,539,439円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年10月16日 至　2020年11月16日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	44,224,497円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	743,970,095円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,216,357,530円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	4,004,552,122円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,138円
G	分配金額	35,160,855円
H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自　2020年11月17日 至　2020年12月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	40,949,238円

B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	0円
C	信託約款に定める収益調整金	656,978,692円	746,718,123円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,253,115,073円	3,184,015,217円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,956,139,386円	3,971,682,578円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,111円	1,140円
G	分配金額	35,584,769円	34,811,559円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	10円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	当期 自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	前期 2020年 6月15日現在	当期 2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

前期（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,608,171,770
合計	1,608,171,770

当期（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	444,468,392
合計	444,468,392

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

前期 2020年 6月15日現在		当期 2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	0.8310円	1口当たり純資産額	0.8907円

(1万口当たり純資産額)	(8,310円)	(1万口当たり純資産額)	(8,907円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	1,705,092,519	5,185,527,368	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,488,595,537	4,941,595,578	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,007,884,611	5,006,057,912	
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	3,077,232,515	5,213,447,326	
	日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	2,399,087,650	5,043,601,966	
	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,562,673,885	5,039,241,927	
合計		15,240,566,717	30,429,472,077	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」「海外株式インデックスＭＳＣＩ－Ｋ

ＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,517,113,776	446,421,652
投資証券	118,932,676,070	101,608,094,820
未収配当金	713,403,167	662,018,382
流動資産合計	121,163,193,013	102,716,534,854
資産合計	121,163,193,013	102,716,534,854
負債の部		
流動負債		
未払金	505,317,940	-
未払解約金	1,494,265	7,554,198
未払利息	623	232
流動負債合計	506,812,828	7,554,430
負債合計	506,812,828	7,554,430
純資産の部		
元本等		
元本	61,422,081,732	48,854,624,863
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	59,234,298,453	53,854,355,561
元本等合計	120,656,380,185	102,708,980,424
純資産合計	120,656,380,185	102,708,980,424
負債純資産合計	121,163,193,013	102,716,534,854

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
1．	期首	2019年12月17日	2020年 6月16日
	期首元本額	43,055,259,887円	61,422,081,732円
	期首からの追加設定元本額	19,696,083,957円	2,370,535,283円
	期首からの一部解約元本額	1,329,262,112円	14,937,992,152円
	元本の内訳　※		
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,406,719,105円	2,399,087,650円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,968,221,934円	1,971,602,859円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	181,324,988円	184,860,163円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	56,865,815,705円	44,299,074,191円
	計	61,422,081,732円	48,854,624,863円
2．	受益権の総数	61,422,081,732口	48,854,624,863口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△29,929,756,184
合計	△29,929,756,184

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,447,126,248
合計	4,447,126,248

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 6月15日現在		2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.9644円	1口当たり純資産額	2.1023円
(1万口当たり純資産額)	(19,644円)	(1万口当たり純資産額)	(21,023円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人　投資証券	1,811	206,272,900	
	サンケイリアルエステート投資法人　投資証券	2,711	261,611,500	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人　投資証券	2,913	350,433,900	
	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	3,765	2,082,045,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人　投資証券	13,557	1,190,304,600	
	森ヒルズリート投資法人　投資証券	13,015	1,792,165,500	
	産業ファンド投資法人　投資証券	15,662	2,765,909,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	10,524	3,151,938,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人　投資証券	7,228	1,287,306,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	5,552	2,281,872,000	
	ＧＬＰ投資法人　投資証券	34,621	5,369,717,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	4,835	1,369,272,000	
	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	16,765	5,306,122,500	
	星野リゾート・リート投資法人　投資証券	1,686	842,157,000	
	Ｏｎｅリート投資法人　投資証券	1,727	429,159,500	
	イオンリート投資法人　投資証券	11,238	1,399,131,000	
	ヒューリックリート投資法人　投資証券	8,920	1,293,400,000	
	日本リート投資法人　投資証券	3,599	1,286,642,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人　投資証券	71,182	997,259,820	
	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	32,588	2,499,499,600	
	トーセイ・リート投資法人　投資証券	2,451	266,668,800	
	ケネディクス商業リート投資法人　投資証券	4,074	988,352,400	

	ヘルスケア＆メディカル投資法人　投資証券	2,363	295,375,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人　投資証券	2,133	221,405,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	35,830	4,976,787,000	
	いちごホテルリート投資法人　投資証券	1,937	136,558,500	
	ラサールロジポート投資法人　投資証券	12,347	1,933,540,200	
	スターアジア不動産投資法人　投資証券	11,384	552,693,200	
	マリモ地方創生リート投資法人　投資証券	1,038	117,813,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人　投資証券	3,867	1,937,367,000	
	大江戸温泉リート投資法人　投資証券	1,788	123,193,200	
	投資法人みらい　投資証券	11,966	458,297,800	
	森トラスト・ホテルリート投資法人　投資証券	2,400	275,280,000	
	三菱地所物流リート投資法人　投資証券	2,493	984,735,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人　投資証券	3,024	470,232,000	
	ザイマックス・リート投資法人　投資証券	1,698	154,687,800	
	タカラレーベン不動産投資法人　投資証券	3,329	294,616,500	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人　投資証券	4,298	556,161,200	
	日本ビルファンド投資法人　投資証券	12,470	7,282,480,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	11,080	6,260,200,000	
	日本リテールファンド投資法人　投資証券	20,816	3,682,350,400	
	オリックス不動産投資法人　投資証券	22,076	3,529,952,400	
	日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	6,898	2,279,789,000	
	プレミア投資法人　投資証券	10,007	1,210,847,000	
	東急リアル・エステート投資法人　投資証券	7,429	1,138,122,800	
	グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	7,694	769,400,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	23,695	2,980,831,000	
	森トラスト総合リート投資法人　投資証券	7,919	1,004,129,200	
	インヴィンシブル投資法人　投資証券	46,328	1,570,519,200	
	フロンティア不動産投資法人　投資証券	3,677	1,430,353,000	
	平和不動産リート投資法人　投資証券	6,798	808,282,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	7,239	2,136,952,800	
	福岡リート投資法人　投資証券	5,730	844,602,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券	3,428	2,307,044,000	
	いちごオフィスリート投資法人　投資証券	9,192	654,470,400	
	大和証券オフィス投資法人　投資証券	2,361	1,456,737,000	
	阪急阪神リート投資法人　投資証券	5,005	619,118,500	
	スターツプロシード投資法人　投資証券	1,725	332,752,500	
	大和ハウスリート投資法人　投資証券	15,809	3,931,698,300	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	35,693	1,902,436,900	
	大和証券リビング投資法人　投資証券	14,468	1,320,928,400	
	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	10,281	1,248,113,400	
合計		670,137	101,608,094,820	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	898,076,396	768,729,851
コール・ローン	22,392,474	26,082,001
投資証券	122,097,710,179	95,979,398,255
未収入金	4,220,058	4,983,194
未収配当金	233,141,884	195,037,921
流動資産合計	123,255,540,991	96,974,231,222
資産合計	123,255,540,991	96,974,231,222
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,617,826	558,113
未払利息	9	13
流動負債合計	3,617,835	558,126
負債合計	3,617,835	558,126
純資産の部		
元本等		
元本	66,801,185,885	49,314,995,417
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	56,450,737,271	47,658,677,679
元本等合計	123,251,923,156	96,973,673,096
純資産合計	123,251,923,156	96,973,673,096
負債純資産合計	123,255,540,991	96,974,231,222

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
1．	期首	2019年12月17日	2020年 6月16日
	期首元本額	46,765,012,186円	66,801,185,885円
	期首からの追加設定元本額	27,028,887,770円	3,003,043,624円
	期首からの一部解約元本額	6,992,714,071円	20,489,234,092円
	元本の内訳　※		
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,549,155,079円	2,562,673,885円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	38,770,776円	32,470,785円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	63,859,067,842円	46,393,446,488円
	海外先進国ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	354,192,188円	326,404,259円
	計	66,801,185,885円	49,314,995,417円
2．	受益権の総数	66,801,185,885口	49,314,995,417口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△21,930,092,534
合計	△21,930,092,534

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	5,696,550,667
合計	5,696,550,667

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 6月15日現在		2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.8451円	1口当たり純資産額	1.9664円
(1万口当たり純資産額)	(18,451円)	(1万口当たり純資産額)	(19,664円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	66,929	979,171.27	
		AGREE REALTY CORPORATION	40,791	2,713,009.41	

ALEXANDER & BALDWIN INC	54,300	875,859.00	
ALEXANDER'S INC	1,591	443,554.89	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	88,707	15,331,230.81	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	38,348	1,101,738.04	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	103,940	4,447,592.60	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	81,810	619,301.70	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	202,185	6,012,981.90	
AMERICOLD REALTY TRUST	154,106	5,221,111.28	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	113,024	4,559,388.16	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	153,983	1,960,203.59	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	45,244	496,326.68	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	106,352	16,981,223.84	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	21,394	231,910.96	
BOSTON PROPERTIES INC	107,077	10,547,084.50	
BRANDYWINE REALTY TRUST	127,710	1,504,423.80	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	223,976	3,561,218.40	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	41,733	657,294.75	
BRT APARTMENTS CORP	8,653	130,573.77	
CAMDEN PROPERTY TRUST	73,601	7,102,496.50	
CARETRUST REIT INC	70,796	1,568,131.40	
CHATHAM LODGING TRUST	35,444	407,606.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	9,030	103,393.50	
CITY OFFICE REIT INC	32,091	309,678.15	
CLIPPER REALTY INC	13,369	85,962.67	
COLONY CAPITAL INC-A	362,936	1,716,687.28	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	82,564	1,169,106.24	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	16,095	757,269.75	
CORECIVIC INC	86,041	676,282.26	
COREPOINT LODGING INC	31,527	208,078.20	
CORESITE REALTY CORP	32,274	3,831,892.02	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	83,858	2,190,370.96	
COUSINS PROPERTIES INC	112,015	3,858,916.75	
CUBESMART	146,926	4,788,318.34	
CYRUSONE INC	88,458	5,898,379.44	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	145,340	1,178,707.40	

		DIGITAL REALTY TRUST INC	203,329	26,044,411.61	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	182,600	787,006.00	
		DOUGLAS EMMETT INC	124,778	3,841,914.62	
		DUKE REALTY CORPORATION	280,044	10,840,503.24	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	59,878	1,289,772.12	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	29,725	3,954,614.00	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	103,129	1,001,382.59	
		EPR PROPERTIES	55,497	1,734,836.22	
		EQUINIX INC	66,924	46,179,567.72	
		EQUITY COMMONWEALTH	92,123	2,435,732.12	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	128,218	7,818,733.64	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	258,786	14,983,709.40	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	76,649	1,562,106.62	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	49,288	11,841,934.88	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	97,689	10,734,067.32	
		FARMLAND PARTNERS INC	22,749	194,048.97	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	52,190	4,638,125.30	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	96,059	3,958,591.39	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	52,186	1,523,831.20	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	75,587	362,817.60	
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	36,996	598,595.28	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	156,606	6,599,376.84	
		GEO GROUP INC/THE	94,129	909,286.14	
		GETTY REALTY CORPORATION	26,288	757,883.04	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	24,477	449,152.95	
		GLADSTONE LAND CORP	17,276	258,103.44	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	30,081	429,556.68	
		GLOBAL NET LEASE INC	65,268	1,099,765.80	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	103,217	3,019,097.25	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	166,028	4,344,952.76	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	406,798	11,748,326.24	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	29,524	242,096.80	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	78,300	3,078,756.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	532,862	7,476,053.86	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	115,722	2,895,364.44	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	73,572	971,886.12	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	47,147	1,098,053.63	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	16,355	2,757,780.10	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	9,811	683,826.70	
INVITATION HOMES INC	423,917	12,200,331.26	
IRON MOUNTAIN INC	218,194	6,386,538.38	
JBG SMITH PROPERTIES	84,985	2,657,480.95	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	483,600	350,610.00	
KILROY REALTY CORPORATION	79,202	4,692,718.50	
KIMCO REALTY CORPORATION	326,711	4,714,439.73	
KITE REALTY GROUP TRUST	64,816	970,943.68	
LEXINGTON REALTY TRUST	208,251	2,238,698.25	
LIFE STORAGE INC	35,567	4,025,117.39	
LTC PROPERTIES INC	28,187	1,085,199.50	
MACERICH CO/THE	86,428	951,572.28	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	67,523	896,705.44	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,108,547	831,410.25	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	399,777	8,315,361.60	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	86,479	10,502,009.76	
MONMOUTH RE INVST CORP	70,770	1,143,643.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	131,186	5,234,321.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	46,765	1,592,348.25	
NATL HEALTH INVESTORS INC	33,229	2,219,032.62	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	62,130	365,324.40	
NEXPOINT RESIDENTIAL	16,878	727,948.14	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	37,268	890,705.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	171,283	6,421,399.67	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	12,420	265,042.80	
PARAMOUNT GROUP INC	124,262	1,141,967.78	
PARK HOTELS & RESORTS INC	177,778	2,967,114.82	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	96,983	1,703,991.31	
PHYSICIANS REALTY TRUST	157,962	2,824,360.56	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	94,413	1,525,714.08	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,023	229,980.73	

		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	39,280	299,313.60	
		PRIME US REIT	366,100	292,880.00	
		PROLOGIS INC	557,973	54,050,844.51	
		PS BUSINESS PARKS INC	14,931	1,956,856.86	
		PUBLIC STORAGE	114,975	25,724,506.50	
		QTS REALTY TRUST INC-CL-A	46,531	2,720,202.26	
		REALTY INCOME CORP	260,768	15,807,756.16	
		REGENCY CENTERS CORP	119,603	5,606,988.64	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	90,875	1,216,816.25	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	159,373	1,408,857.32	
		RETAIL VALUE INC	13,422	186,565.80	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	93,674	4,386,753.42	
		RLJ LODGING TRUST	124,060	1,657,441.60	
		RPT REALTY	59,054	491,329.28	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	41,512	2,623,143.28	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	154,712	2,698,177.28	
		SAFEHOLD INC	10,538	731,969.48	
		SAUL CENTERS INC	9,262	307,405.78	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	25,157	364,776.50	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	123,811	1,420,112.17	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	245,680	21,452,777.60	
		SITE CENTERS CORP	116,369	1,175,326.90	
		SL GREEN REALTY CORP	55,359	3,230,197.65	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	77,573	3,107,574.38	
		STAG INDUSTRIAL INC	112,845	3,427,102.65	
		STORE CAPITAL CORP	172,356	5,579,163.72	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	79,291	737,406.30	
		SUN COMMUNITIES INC	74,318	10,643,823.96	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	165,533	1,800,999.04	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	71,177	775,117.53	
		TAUBMAN CENTERS INC	46,224	1,982,547.36	
		TERRENO REALTY CORP	51,614	2,868,706.12	
		UDR INC	223,248	8,391,892.32	
		UMH PROPERTIES INC	28,133	436,905.49	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	9,421	655,418.97	

		URBAN EDGE PROPERTIES	80,190	1,103,414.40	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	20,492	295,084.80	
		VENTAS INC	281,713	13,477,149.92	
		VEREIT INC	813,404	6,108,664.04	
		VICI PROPERTIES INC	403,133	10,231,515.54	
		VORNADO REALTY TRUST	118,494	4,512,251.52	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	158,158	166,065.90	
		WASHINGTON REIT	61,651	1,429,070.18	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	89,650	1,984,851.00	
		WELLTOWER INC	315,148	19,929,959.52	
		WHITESTONE REIT	28,529	225,664.39	
		WP CAREY INC	131,446	9,090,805.36	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	83,253	1,189,685.37	
米ドル小計			19,335,350	669,474,563.29 (69,705,691,529)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	45,225	1,785,935.25	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	45,980	502,561.40	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	15,368	168,894.32	
		BOARDWALK EQUITIES INC	16,646	580,778.94	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	63,603	3,228,488.28	
		CHOICE PROPERTIES REIT	120,937	1,641,115.09	
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	68,031	584,386.29	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,516	558,613.24	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	41,711	648,188.94	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	55,572	716,878.80	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	20,506	432,881.66	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	83,926	1,225,319.60	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	22,971	1,783,698.15	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	103,707	1,441,527.30	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	51,538	724,624.28	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	37,040	640,792.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,229	303,057.10	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	16,436	263,962.16	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	68,033	856,535.47	
		PLAZA RETAIL REIT	45,512	159,292.00	

		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	120,960	2,151,878.40	
		SLATE GROCERY REIT	16,853	190,944.49	
		SLATE OFFICE REIT	28,339	120,157.36	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	55,375	1,309,618.75	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	54,767	731,139.45	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	20,441	130,617.99	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	33,107	598,574.56	
加ドル小計			1,305,329	23,480,461.27 (1,916,944,858)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	24,919	2,364,813.10	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	134,086	1,975,086.78	
		ALTAREA	2,589	337,605.60	
		BEFIMMO S.C.A.	20,265	778,176.00	
		CARE PROPERTY INVEST	19,442	510,352.50	
		CARMILA	35,277	405,685.50	
		COFINIMMO	20,579	2,498,290.60	
		COVIVIO	36,338	2,732,617.60	
		CROMWELL EUROPEAN REIT	1,017,000	477,990.00	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	26,466	376,346.52	
		GECINA SA	40,872	5,149,872.00	
		HAMBORNER REIT AG	57,095	504,948.18	
		HIBERNIA REIT PLC	548,264	628,310.54	
		ICADE	23,121	1,488,992.40	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	34,103	122,259.25	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	196,659	1,603,754.14	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	16,359	361,533.90	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	324,015	471,765.84	
		KLEPIERRE	153,891	2,857,755.87	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	52,844	254,443.86	
		MERCIALYS	32,673	237,532.71	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	253,728	1,967,660.64	
		MONTEA	7,773	698,792.70	
		NSI NV	12,913	428,065.95	
		RETAIL ESTATES	8,298	472,986.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	103,994	6,329,074.84	

		VASTNED RETAIL	13,141	292,387.25	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	99,299	2,752,568.28	
		WERELDHAVE NV	33,012	351,907.92	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	10,484	529,442.00	
ユーロ小計			3,359,499	39,961,018.47 (5,059,064,938)	
英ポンド	投資証券	AEW UK REIT PLC	143,760	106,957.44	
		ASSURA PLC	2,007,030	1,477,174.08	
		BIG YELLOW GROUP PLC	122,684	1,340,936.12	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	601,624	448,811.50	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	711,225	3,429,526.95	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	631,337	906,599.93	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	489,312	510,841.72	
		CUSTODIAN REIT PLC	355,300	308,400.40	
		DERWENT LONDON PLC	84,634	2,589,800.40	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	448,719	331,154.62	
		GCP STUDENT LIVING PLC	343,964	487,053.02	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	191,948	1,241,519.66	
		HAMMERSON PLC	2,976,672	747,144.67	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	250,474	270,511.92	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	567,932	3,964,165.36	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	680,583	1,538,117.58	
		LXI REIT PLC	401,677	470,765.44	
		NEWRIVER REIT PLC	221,948	181,331.51	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	433,967	318,965.74	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	993,096	1,438,003.00	
		RDI REIT PLC	190,048	162,491.04	
		REGIONAL REIT LTD	341,760	263,496.96	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	158,457	1,205,857.77	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	483,935	180,749.72	
		SEGRO PLC	901,113	8,189,314.94	
		SHAFTESBURY PLC	181,663	997,329.87	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	340,569	192,080.91	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	513,415	541,652.82	

		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	274,498	293,712.86	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,297,300	2,066,598.90	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	551,938	379,181.40	
		UNITE GROUP PLC	300,512	3,086,258.24	
		WORKSPACE GROUP PLC	98,131	720,772.19	
英ポンド小計			19,049,971	40,387,278.68 (5,611,004,627)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	276,400	829,200.00	
		ABACUS PROPERTY-ASX INTERNAL-RTS	57,583	5,758.30	
		APN INDUSTRIA REIT	104,445	321,690.60	
		ARENA REIT	247,584	742,752.00	
		AVENTUS GROUP	287,105	798,151.90	
		BWP TRUST	396,888	1,734,400.56	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	364,660	911,650.00	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	347,056	1,075,873.60	
		CENTURIA OFFICE REIT	278,365	617,970.30	
		CHARTER HALL GROUP	353,150	5,148,927.00	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	336,600	1,592,118.00	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	388,790	1,489,065.70	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	251,154	813,738.96	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	1,532,166	1,424,914.38	
		DEXUS	833,253	8,190,876.99	
		GDI PROPERTY GROUP	434,117	523,110.98	
		GOODMAN GROUP	1,259,833	22,425,027.40	
		GPT GROUP	1,480,647	7,018,266.78	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	233,041	836,617.19	
		HOME CONSORTIUM	118,865	460,007.55	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	59,432	74,290.00	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	120,714	381,456.24	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	232,180	1,165,543.60	
		IRONGATE GROUP	462,812	615,539.96	
		MIRVAC GROUP	2,988,620	8,158,932.60	
		NATIONAL STORAGE REIT	754,236	1,516,014.36	
		RURAL FUNDS GROUP	252,376	623,368.72	
		SCENTRE GROUP	3,926,562	10,955,107.98	

		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	851,438	2,213,738.80	
		STOCKLAND	1,804,537	7,994,098.91	
		VICINITY CENTRES	2,917,858	4,902,001.44	
		WAYPOINT REIT LTD	598,845	1,694,731.35	
豪ドル小計			24,551,312	97,254,942.15 (7,633,540,409)	
ニュージーランドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	967,800	2,254,974.00	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	381,888	1,176,215.04	
ニュージーランドドル小計			1,349,688	3,431,189.04 (253,050,191)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	1,558,000	6,901,940.00	
		FORTUNE REIT	1,140,000	8,276,400.00	
		LINK REIT	1,567,700	108,484,840.00	
		PROSPERITY REIT	966,000	2,376,360.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	834,000	3,227,580.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,106,000	4,191,740.00	
香港ドル小計			7,372,700	134,333,210.00 (1,804,095,010)	
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	368,625	453,408.75	
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	817,358	490,414.80	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,402,632	7,135,817.04	
		ASCOTT TRUST	1,459,092	1,561,228.44	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	3,423,892	7,395,606.72	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS(N)	32,628	45,026.64	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	743,457	1,025,970.66	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	572,400	755,568.00	
		EC WORLD REIT	258,700	182,383.50	
		ESR REIT	1,811,559	751,796.98	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	847,700	521,335.50	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	563,000	230,830.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	722,905	1,771,117.25	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	636,900	350,295.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,995,660	2,853,793.80	
		IREIT GLOBAL	405,854	261,775.83	

		KEPPEL DC REIT	955,877	2,609,544.21	
		KEPPEL REIT	1,350,800	1,485,880.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	695,200	524,876.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,854,600	155,786.40	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,654,731	3,491,482.41	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,265,160	3,542,448.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,996,414	3,853,079.02	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	1,516,700	1,440,865.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,848,835	721,045.65	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	307,500	1,180,800.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	664,300	235,826.50	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	425,900	347,108.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	749,021	400,726.23	
		SPH REIT	722,400	614,040.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	1,054,900	537,999.00	
		SUNTEC REIT	1,597,600	2,428,352.00	
シンガポールドル小計			35,722,300	49,356,227.83 (3,854,721,393)	
韓国ウォン	投資証券	LOTTE REIT CO LTD	71,374	382,564,640.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,250	66,137,500.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	34,762	246,114,960.00	
韓国ウォン小計			122,386	694,817,100.00 (66,285,551)	
イスラエルシュケル	投資証券	REIT 1 LTD	144,456	2,347,410.00	
イスラエルシュケル小計			144,456	2,347,410.00 (74,999,749)	
合計				95,979,398,255 (95,979,398,255)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券	155銘柄	100.0%	72.5%
加ドル	投資証券	27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券	30銘柄	100.0%	5.3%
英ポンド	投資証券	34銘柄	100.0%	5.8%
豪ドル	投資証券	32銘柄	100.0%	8.0%
ニュージーランドドル	投資証券	2銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券	7銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券	32銘柄	100.0%	4.0%
韓国ウォン	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%
イスラエルシュケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	374,560,095	364,051,411
国債証券	32,320,230,613	33,682,537,342
地方債証券	2,341,367,904	3,455,327,000
特殊債券	4,720,434,000	4,606,199,495
社債券	2,640,052,797	2,432,361,168
未収利息	133,063,744	134,378,394
前払費用	4,596,943	1,191,642
流動資産合計	42,534,306,096	44,676,046,452
資産合計	42,534,306,096	44,676,046,452
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,830,755	7,752,454
未払利息	153	189

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
流動負債合計	13,830,908	7,752,643
負債合計	13,830,908	7,752,643
純資産の部		
元本等		
元本	30,001,805,725	31,533,513,015
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	12,518,669,463	13,134,780,794
元本等合計	42,520,475,188	44,668,293,809
純資産合計	42,520,475,188	44,668,293,809
負債純資産合計	42,534,306,096	44,676,046,452

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
1．	期首	2019年12月17日	2020年 6月16日
	期首元本額	29,684,235,525円	30,001,805,725円
	期首からの追加設定元本額	3,954,534,697円	2,149,286,949円
	期首からの一部解約元本額	3,636,964,497円	617,579,659円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	2,946,155,317円	3,426,701,467円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	2,697,323,344円	3,099,877,835円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	1,859,754,334円	2,201,571,809円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	287,488,273円	342,649,068円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,073,710,149円	2,144,545,590円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,583,741,909円	3,488,595,537円

	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,537,869,260円	1,618,062,790円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,704,855円	4,501,988円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	24,864,342円	23,837,975円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	98,908,276円	96,758,298円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	258,806,689円	252,243,751円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,172,942,545円	4,090,395,680円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,335,275,108円	1,397,407,574円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,287,134,515円	1,362,727,703円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	689,262,911円	748,864,620円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	92,260,655円	104,739,933円
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	6,741,107,325円	6,812,939,462円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	310,495,918円	317,091,935円
	計	30,001,805,725円	31,533,513,015円
２．	受益権の総数	30,001,805,725口	31,533,513,015口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△593,415,622
地方債証券	△10,040,096
特殊債券	△17,905,000
社債券	△13,646,203
合計	△635,006,921

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	67,884,600
地方債証券	△1,726,000

特殊債券	△3,891,505
社債券	△1,453,270
合計	60,813,825

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 6月15日現在		2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.4173円	1口当たり純資産額	1.4165円
(1万口当たり純資産額)	(14,173円)	(1万口当たり純資産額)	(14,165円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第１回利付国債（４０年）	70,000,000	102,642,400	
	第２回利付国債（４０年）	95,000,000	135,153,650	
	第３回利付国債（４０年）	70,000,000	99,990,100	
	第４回利付国債（４０年）	95,000,000	136,191,050	
	第５回利付国債（４０年）	35,000,000	48,600,650	
	第６回利付国債（４０年）	70,000,000	95,889,500	
	第７回利付国債（４０年）	50,000,000	65,888,000	
	第８回利付国債（４０年）	95,000,000	117,095,100	
	第９回利付国債（４０年）	130,000,000	119,988,700	
	第１０回利付国債（４０年）	125,000,000	135,160,000	
	第１１回利付国債（４０年）	140,000,000	146,959,400	
	第１２回利付国債（４０年）	175,000,000	166,192,250	
	第１３回利付国債（４０年）	80,000,000	75,772,800	
	第３１７回利付国債（１０年）	105,000,000	106,006,682	

第３１８回利付国債（１０年）	185,000,000	186,632,925	
第３１９回利付国債（１０年）	5,000,000	5,061,950	
第３２０回利付国債（１０年）	190,000,000	192,162,200	
第３２１回利付国債（１０年）	175,000,000	177,490,250	
第３２２回利付国債（１０年）	75,000,000	75,972,750	
第３２３回利付国債（１０年）	45,000,000	45,707,850	
第３２４回利付国債（１０年）	25,000,000	25,355,500	
第３２５回利付国債（１０年）	210,000,000	213,486,000	
第３２６回利付国債（１０年）	30,000,000	30,507,900	
第３２７回利付国債（１０年）	65,000,000	66,231,750	
第３２８回利付国債（１０年）	115,000,000	116,926,250	
第３２９回利付国債（１０年）	230,000,000	235,444,100	
第３３０回利付国債（１０年）	210,000,000	215,472,600	
第３３１回利付国債（１０年）	80,000,000	81,640,800	
第３３３回利付国債（１０年）	210,000,000	215,084,100	
第３３４回利付国債（１０年）	120,000,000	123,130,800	
第３３５回利付国債（１０年）	490,000,000	501,858,000	
第３３６回利付国債（１０年）	80,000,000	82,064,800	
第３３７回利付国債（１０年）	30,000,000	30,532,200	
第３３８回利付国債（１０年）	390,000,000	399,016,800	
第３３９回利付国債（１０年）	370,000,000	379,065,000	
第３４０回利付国債（１０年）	420,000,000	430,764,600	
第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	715,176,000	
第３４２回利付国債（１０年）	130,000,000	131,547,000	
第３４３回利付国債（１０年）	245,000,000	248,057,600	
第３４４回利付国債（１０年）	50,000,000	50,652,500	
第３４５回利付国債（１０年）	610,000,000	618,125,200	
第３４６回利付国債（１０年）	490,000,000	496,796,300	
第３４７回利付国債（１０年）	160,000,000	162,256,000	
第３４８回利付国債（１０年）	90,000,000	91,318,500	
第３４９回利付国債（１０年）	490,000,000	497,443,100	
第３５０回利付国債（１０年）	480,000,000	487,372,800	
第３５１回利付国債（１０年）	435,000,000	441,581,550	
第３５２回利付国債（１０年）	390,000,000	395,791,500	
第３５３回利付国債（１０年）	200,000,000	202,902,000	
第３５４回利付国債（１０年）	125,000,000	126,763,750	
第３５５回利付国債（１０年）	150,000,000	152,052,000	
第３５６回利付国債（１０年）	200,000,000	202,640,000	
第３５７回利付国債（１０年）	820,000,000	830,004,000	
第３５８回利付国債（１０年）	510,000,000	515,910,900	
第３５９回利付国債（１０年）	400,000,000	404,188,000	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	62,485,000	

第１４回利付国債（３０年）	108,000,000	139,950,720	
第１５回利付国債（３０年）	147,000,000	193,124,190	
第１６回利付国債（３０年）	35,000,000	46,120,900	
第１８回利付国債（３０年）	110,000,000	142,714,000	
第２１回利付国債（３０年）	20,000,000	26,158,800	
第２２回利付国債（３０年）	40,000,000	53,621,200	
第２３回利付国債（３０年）	55,000,000	73,973,350	
第２４回利付国債（３０年）	68,000,000	91,687,120	
第２５回利付国債（３０年）	20,000,000	26,413,400	
第２６回利付国債（３０年）	170,000,000	227,633,400	
第２７回利付国債（３０年）	29,000,000	39,496,840	
第２８回利付国債（３０年）	94,000,000	128,670,020	
第２９回利付国債（３０年）	176,000,000	238,928,800	
第３０回利付国債（３０年）	147,000,000	197,888,460	
第３１回利付国債（３０年）	120,000,000	160,212,000	
第３２回利付国債（３０年）	50,000,000	67,958,000	
第３３回利付国債（３０年）	135,000,000	176,496,300	
第３４回利付国債（３０年）	200,000,000	270,246,000	
第３５回利付国債（３０年）	168,000,000	221,224,080	
第３６回利付国債（３０年）	135,000,000	178,366,050	
第３７回利付国債（３０年）	131,000,000	171,021,810	
第３８回利付国債（３０年）	95,000,000	122,432,200	
第３９回利付国債（３０年）	75,000,000	98,332,500	
第４０回利付国債（３０年）	90,000,000	116,286,300	
第４１回利付国債（３０年）	40,000,000	50,903,200	
第４２回利付国債（３０年）	135,000,000	171,976,500	
第４３回利付国債（３０年）	155,000,000	197,662,200	
第４４回利付国債（３０年）	150,000,000	191,481,000	
第４５回利付国債（３０年）	160,000,000	197,259,200	
第４６回利付国債（３０年）	250,000,000	308,420,000	
第４７回利付国債（３０年）	165,000,000	207,343,950	
第４８回利付国債（３０年）	85,000,000	102,990,250	
第４９回利付国債（３０年）	90,000,000	109,098,000	
第５０回利付国債（３０年）	25,000,000	26,741,750	
第５１回利付国債（３０年）	70,000,000	66,456,600	
第５２回利付国債（３０年）	90,000,000	89,590,500	
第５３回利付国債（３０年）	105,000,000	106,923,600	
第５４回利付国債（３０年）	110,000,000	117,250,100	
第５５回利付国債（３０年）	110,000,000	117,175,300	
第５６回利付国債（３０年）	50,000,000	53,226,000	
第５７回利付国債（３０年）	100,000,000	106,379,000	
第５８回利付国債（３０年）	100,000,000	106,177,000	

第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	176,092,800	
第６０回利付国債（３０年）	120,000,000	130,272,000	
第６１回利付国債（３０年）	70,000,000	72,284,800	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	117,525,600	
第６３回利付国債（３０年）	90,000,000	85,617,000	
第６４回利付国債（３０年）	100,000,000	94,861,000	
第６５回利付国債（３０年）	110,000,000	104,177,700	
第６６回利付国債（３０年）	180,000,000	170,191,800	
第６７回利付国債（３０年）	110,000,000	109,587,500	
第６８回利付国債（３０年）	110,000,000	109,446,700	
第５０回利付国債（２０年）	237,000,000	238,357,959	
第５１回利付国債（２０年）	39,000,000	39,435,526	
第５４回利付国債（２０年）	15,000,000	15,352,950	
第５５回利付国債（２０年）	66,000,000	67,774,080	
第５７回利付国債（２０年）	52,000,000	53,604,720	
第５８回利付国債（２０年）	135,000,000	139,874,850	
第５９回利付国債（２０年）	33,000,000	34,227,930	
第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	304,192,200	
第６１回利付国債（２０年）	27,000,000	27,696,870	
第６３回利付国債（２０年）	31,000,000	32,514,350	
第６４回利付国債（２０年）	54,000,000	57,053,700	
第６５回利付国債（２０年）	100,000,000	106,168,000	
第６６回利付国債（２０年）	34,000,000	35,994,100	
第６７回利付国債（２０年）	34,000,000	36,269,500	
第６８回利付国債（２０年）	78,000,000	83,972,460	
第７０回利付国債（２０年）	104,000,000	113,316,320	
第７２回利付国債（２０年）	112,000,000	121,486,400	
第７３回利付国債（２０年）	113,000,000	122,753,030	
第７４回利付国債（２０年）	118,000,000	128,661,300	
第７５回利付国債（２０年）	10,000,000	10,959,400	
第７６回利付国債（２０年）	21,000,000	22,834,770	
第７７回利付国債（２０年）	40,000,000	43,666,000	
第７９回利付国債（２０年）	160,000,000	175,497,600	
第８２回利付国債（２０年）	60,000,000	66,410,400	
第８７回利付国債（２０年）	130,000,000	145,995,200	
第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	340,359,000	
第９０回利付国債（２０年）	16,000,000	18,158,720	
第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	285,182,500	
第９２回利付国債（２０年）	60,000,000	68,064,600	
第９３回利付国債（２０年）	60,000,000	68,019,600	
第９４回利付国債（２０年）	50,000,000	56,998,000	
第９５回利付国債（２０年）	82,000,000	94,987,980	

第９６回利付国債（２０年）	98,000,000	112,236,460	
第９７回利付国債（２０年）	45,000,000	52,098,750	
第９８回利付国債（２０年）	94,000,000	108,188,360	
第９９回利付国債（２０年）	117,000,000	135,316,350	
第１００回利付国債（２０年）	30,000,000	35,057,100	
第１０１回利付国債（２０年）	66,000,000	78,090,540	
第１０２回利付国債（２０年）	81,000,000	96,285,510	
第１０３回利付国債（２０年）	11,000,000	12,992,540	
第１０４回利付国債（２０年）	33,000,000	38,478,330	
第１０５回利付国債（２０年）	77,000,000	90,144,670	
第１０６回利付国債（２０年）	2,000,000	2,357,060	
第１０７回利付国債（２０年）	130,000,000	152,787,700	
第１０８回利付国債（２０年）	134,000,000	155,328,780	
第１０９回利付国債（２０年）	27,000,000	31,417,470	
第１１０回利付国債（２０年）	98,000,000	115,662,540	
第１１１回利付国債（２０年）	25,000,000	29,832,500	
第１１２回利付国債（２０年）	80,000,000	94,780,000	
第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	344,868,000	
第１１４回利付国債（２０年）	52,000,000	62,035,480	
第１１５回利付国債（２０年）	125,000,000	150,253,750	
第１１６回利付国債（２０年）	55,000,000	66,354,750	
第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	410,629,310	
第１１８回利付国債（２０年）	10,000,000	11,913,200	
第１１９回利付国債（２０年）	30,000,000	35,168,400	
第１２０回利付国債（２０年）	170,000,000	196,052,500	
第１２１回利付国債（２０年）	22,000,000	26,080,340	
第１２２回利付国債（２０年）	17,000,000	19,986,900	
第１２３回利付国債（２０年）	195,000,000	235,756,950	
第１２４回利付国債（２０年）	190,000,000	227,811,900	
第１２５回利付国債（２０年）	50,000,000	61,157,500	
第１２６回利付国債（２０年）	105,000,000	126,281,400	
第１２８回利付国債（２０年）	65,000,000	77,734,150	
第１２９回利付国債（２０年）	85,000,000	100,761,550	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	178,288,500	
第１３１回利付国債（２０年）	12,000,000	14,134,440	
第１３２回利付国債（２０年）	75,000,000	88,599,750	
第１３３回利付国債（２０年）	30,000,000	35,768,400	
第１３４回利付国債（２０年）	50,000,000	59,761,500	
第１３５回利付国債（２０年）	30,000,000	35,521,200	
第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	258,027,000	
第１３７回利付国債（２０年）	200,000,000	237,356,000	
第１３８回利付国債（２０年）	120,000,000	139,671,600	

	第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	270,332,800	
	第１４０回利付国債（２０年）	448,000,000	532,873,600	
	第１４１回利付国債（２０年）	195,000,000	232,441,950	
	第１４２回利付国債（２０年）	125,000,000	150,487,500	
	第１４３回利付国債（２０年）	94,000,000	111,140,900	
	第１４４回利付国債（２０年）	430,000,000	503,198,900	
	第１４５回利付国債（２０年）	355,000,000	424,913,700	
	第１４６回利付国債（２０年）	135,000,000	161,910,900	
	第１４７回利付国債（２０年）	60,000,000	71,330,400	
	第１４８回利付国債（２０年）	90,000,000	106,000,200	
	第１４９回利付国債（２０年）	115,000,000	135,645,950	
	第１５０回利付国債（２０年）	90,000,000	105,097,500	
	第１５１回利付国債（２０年）	70,000,000	79,921,100	
	第１５２回利付国債（２０年）	350,000,000	399,903,000	
	第１５３回利付国債（２０年）	450,000,000	521,266,500	
	第１５４回利付国債（２０年）	160,000,000	183,203,200	
	第１５５回利付国債（２０年）	250,000,000	278,942,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	110,000,000	112,839,100	
	第１５７回利付国債（２０年）	50,000,000	49,738,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	170,000,000	176,711,600	
	第１５９回利付国債（２０年）	150,000,000	158,082,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	140,000,000	149,608,200	
	第１６１回利付国債（２０年）	120,000,000	126,258,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	70,000,000	73,586,100	
	第１６３回利付国債（２０年）	165,000,000	173,291,250	
	第１６４回利付国債（２０年）	285,000,000	294,350,850	
	第１６５回利付国債（２０年）	60,000,000	61,893,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	100,000,000	106,475,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	160,000,000	164,624,000	
	第１６８回利付国債（２０年）	100,000,000	101,031,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	160,000,000	158,608,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	140,000,000	138,644,800	
	第１７１回利付国債（２０年）	170,000,000	168,184,400	
	第１７２回利付国債（２０年）	230,000,000	231,446,700	
	第１７３回利付国債（２０年）	150,000,000	150,681,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	200,000,000	200,734,000	
国債証券 合計		30,530,000,000	33,682,537,342	
地方債証券	第７０８回東京都公募公債	100,000,000	101,330,000	
	第７０９回東京都公募公債	100,000,000	101,164,000	
	第７１２回東京都公募公債	200,000,000	202,680,000	
	第７３０回東京都公募公債	100,000,000	102,130,000	
	第７３１回東京都公募公債	100,000,000	102,035,000	

	平成２４年度第２回京都府公募公債	200,000,000	202,722,000	
	平成２５年度第１０回静岡県公募公債	200,000,000	204,316,000	
	平成２６年度第１２回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,896,000	
	平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,416,000	
	平成２４年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	101,795,000	
	平成２６年度第３回埼玉県公募公債	200,000,000	204,522,000	
	平成２４年度第９回福岡県公募公債	100,000,000	101,421,000	
	平成２６年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	101,759,000	
	第１０回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	101,941,000	
	平成２５年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	102,230,000	
	平成２６年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	102,061,000	
	平成２４年度第１回長崎県公募公債	100,000,000	101,447,000	
	平成２７年度第１回佐賀県公募公債	100,000,000	102,326,000	
	平成２７年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	102,281,000	
	第４８６回名古屋市公募公債（１０年）	200,000,000	204,454,000	
	平成２７年度第５回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,189,000	
	第５１回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,017,000	
	第５３回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,052,000	
	令和元年度第１回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	99,964,000	
	令和２年度第１回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	100,059,000	
	平成２５年度第２回福井県公募公債	200,000,000	203,832,000	
	平成２３年度第２回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	101,288,000	
地方債証券 合計		3,400,000,000	3,455,327,000	
特殊債券	第１回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,407,000	
	第２回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,227,000	
	第５回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,879,000	
	第５回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,363,000	
	第１３回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	203,566,000	
	第１４回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,150,000	
	第１６回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,489,000	
	第２２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,069,000	
	第３１回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,360,000	
	第３５回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	200,056,000	
	第６０回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,975,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	103,059,000	
	第２８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,226,000	
	第４３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,764,000	
	第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,660,000	
	第８６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,159,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,570,000	

	第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,147,000	
	第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,750,000	
	第１４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,972,495	
	第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,258,000	
	第３２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,154,000	
	第３５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,978,000	
	第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,896,000	
	第１３回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,623,000	
	第４５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,398,000	
	Ｆ６３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,004,000	
	第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,811,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,578,000	
	Ｆ２２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,748,000	
	Ｆ２９０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,927,000	
	第３５回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	101,437,000	
	第５２回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,871,000	
	第３８回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,116,000	
	第３９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,259,000	
	第１９回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,132,000	
	第３２２回信金中金債（５年）	200,000,000	200,018,000	
	第３７回国際協力機構債券	100,000,000	100,143,000	
特殊債券 合計		4,500,000,000	4,606,199,495	
社債券	第１５回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,190,000	
	第１４回森永乳業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,378,000	
	第５回不二製油グループ本社株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	200,808,000	
	第２１回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	200,000,000	200,330,000	
	第１０回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,367,000	
	第２８回東レ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,192,000	
	第１３回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,968,000	
	第１１回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,418,000	
	第２４回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,971,000	
	第２９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,469,000	
	第８７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	203,008,000	

	第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,254,000	
	第１１回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,116,430	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	202,090,000	
	第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,959,000	
	第２６回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,882,000	
	第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,400,000	
	第２９９回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,943,000	
	第３４回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	201,617,738	
社債券 合計		2,400,000,000	2,432,361,168	
合計		40,830,000,000	44,176,425,005	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	546,418,911	117,032,026
コール・ローン	537,220,656	24,996,412
国債証券	150,482,884,267	153,910,236,897
派生商品評価勘定	1,855,662	204,135
未収入金	-	221,277,609
未収利息	890,319,840	897,265,978
前払費用	61,160,217	20,320,086
流動資産合計	152,519,859,553	155,191,333,143
資産合計	152,519,859,553	155,191,333,143
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,626	382,680
未払金	1,393,901,515	-
未払解約金	50,692,821	212,848,694
未払利息	220	12
流動負債合計	1,444,605,182	213,231,386
負債合計	1,444,605,182	213,231,386
純資産の部		

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
元本等		
元本	62,363,102,520	62,161,310,314
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	88,712,151,851	92,816,791,443
元本等合計	151,075,254,371	154,978,101,757
純資産合計	151,075,254,371	154,978,101,757
負債純資産合計	152,519,859,553	155,191,333,143

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
１．	期首	2019年12月17日	2020年 6月16日
	期首元本額	66,299,765,692円	62,363,102,520円
	期首からの追加設定元本額	5,032,365,581円	2,063,425,421円
	期首からの一部解約元本額	8,969,028,753円	2,265,217,627円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（ＤＣ専用）	13,143,792,684円	13,775,382,228円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	268,009,459円	301,866,652円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	347,145,716円	392,753,635円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	437,833,523円	503,149,574円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	336,249,079円	391,697,366円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	22,394,960,745円	21,929,960,980円

	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,067,198,194円	2,007,884,611円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	16,381,232,485円	15,667,140,877円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	999,963,098円	995,434,380円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	152,128,700円	154,726,575円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	2,709,024円	2,598,118円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	2,915,674円	2,725,686円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	6,328,923円	6,186,086円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	11,786,648円	11,064,903円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	511,211,418円	785,291,324円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	804,397,457円	782,118,041円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	59,952,051円	61,569,735円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	82,731,491円	86,758,487円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	80,590,835円	85,636,516円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	54,781,504円	60,036,248円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）１年決算型	3,947,102,380円	3,878,012,214円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	270,081,432円	279,316,078円
	計	62,363,102,520円	62,161,310,314円
２．	受益権の総数	62,363,102,520口	62,161,310,314口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,049,085,267
合計	4,049,085,267

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	513,345,863
合計	513,345,863

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（2020年 6月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	977,331,171	－	979,176,207	1,845,036
	米ドル	422,505,500	－	423,558,500	1,053,000
	加ドル	19,682,480	－	19,741,150	58,670
	メキシコペソ	4,634,710	－	4,726,250	91,540
	ユーロ	401,199,560	－	401,743,720	544,160
	英ポンド	71,583,260	－	71,625,420	42,160
	スウェーデンクローナ	10,815,719	－	10,817,604	1,885
	ポーランドズロチ	6,866,926	－	6,856,300	△10,626
	豪ドル	23,245,950	－	23,302,950	57,000
	シンガポールドル	9,143,960	－	9,145,150	1,190
	マレーシアリンギット	7,653,106	－	7,659,163	6,057
合計		977,331,171	－	979,176,207	1,845,036

（2020年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	317,011,907	－	317,190,452	△178,545
	米ドル	135,265,510	－	135,343,000	△77,490

	加ドル	6,201,600	—	6,203,880	△2,280
	メキシコペソ	34,051,035	—	33,846,900	204,135
	ユーロ	102,598,485	—	102,799,200	△200,715
	英ポンド	31,027,431	—	31,118,080	△90,649
	豪ドル	7,867,846	—	7,879,392	△11,546
合計		317,011,907	—	317,190,452	△178,545

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 6月15日現在		2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2.4225円	1口当たり純資産額	2.4932円
(1万口当たり純資産額)	(24,225円)	(1万口当たり純資産額)	(24,932円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	609,480.06	
		US TREASURY N/B-1.5%-21/11/30	3,370,000.00	3,415,083.86	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,185,289.74	
		US TREASURY N/B-2.5%-22/01/15	5,000,000.00	5,129,296.50	
		US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	4,840,000.00	4,916,003.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,555,566.25	
		US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,111,562.40	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,549,414.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/02/28	2,000,000.00	2,042,500.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,056,640.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,838,250.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,057,109.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,067,734.30	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,892,327.84	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,046,406.20	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	1,200,000.00	1,234,265.52	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,508,037.98	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,073,535.10	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,577,636.50	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/06/30	2,500,000.00	2,562,402.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,103,593.60	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	4,050,586.15	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	5,700,000.00	5,863,540.98	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	4,500,000.00	4,613,730.30	
		US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,600,000.00	2,660,378.76	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,956,851.42	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	2,750,000.00	2,820,790.77	
		US TREASURY N/B-1.5%-22/09/15	1,950,000.00	1,997,150.22	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,654,003.64	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,410,000.00	2,485,688.94	
		US TREASURY N/B-0.125%-22/09/30	1,100,000.00	1,100,128.81	
		US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	3,068,906.10	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,099,081.90	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,484,750.00	

		US TREASURY N/B-0.125%-22/10/31	8,000,000.00	8,001,249.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,057,890.60	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,535,810.24	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,101,438.88	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	4,059,579.81	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,086,367.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,069,609.20	
		US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,655,697.95	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,393,751.91	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,540,722.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,193,968.75	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	928,468.72	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,016,718.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,062,812.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,245,402.54	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,509,980.25	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,201,211.66	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,823,804.44	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,753,515.62	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,969,419.92	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,554,990.15	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,383,560.49	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,506,982.25	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,547,314.35	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,063,203.10	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,678,848.43	
		US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,087,656.10	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,205,312.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,634,355.27	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	860,000.00	859,596.87	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,911,787.04	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,997,890.64	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,585,937.50	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	710,131.62	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,398,906.25	

		US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,772,283.15	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	970,312.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,303,750.00	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	8,000,000.00	8,021,562.40	
		US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,836,298.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,955,294.85	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,126,875.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,223,710.90	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,129,765.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,702,601.46	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,569,156.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,593,163.95	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,744,036.26	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,509,057.68	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,121,718.60	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,207,187.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,646,042.84	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,109,909.42	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,445,591.61	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,804,637.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,720,000.00	2,908,062.43	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	3,820,000.00	4,031,592.09	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,984,366.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,506,586.63	
		US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,386,699.19	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,571,093.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,304,843.64	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,174,347.25	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,950,093.75	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,750,000.00	4,042,968.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,503,413.94	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	4,000,000.00	4,196,250.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	2,052,519.46	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	3,300,000.00	3,497,355.18	
		US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,637,519.40	

		US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,770,000.00	3,940,533.31	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,324,306.33	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,273,161.59	
		US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,140,000.00	1,180,211.67	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,839,140.24	
		US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,584,044.12	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,446,898.30	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,157,222.49	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,184,749.76	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,281,216.72	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	2,015,186.72	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,000,000.00	1,109,882.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,608,665.61	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,989,453.14	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,410,422.46	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,339,023.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,294,109.14	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,579,292.96	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,614,847.59	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,483,350.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,225,859.20	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	2,061,376.93	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,317,851.54	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	2,000,000.00	2,127,578.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,985,361.67	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,271,097.18	
		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,209,765.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	5,180,000.00	5,517,306.57	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	3,120,000.00	3,407,868.67	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,158,750.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	2,960,000.00	3,196,684.26	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,236,406.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,727,767.90	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,613,556.61	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,489,071.56	

		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	3,062,715.90	
		US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,150,546.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,120,546.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	5,309,343.36	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	1,037,265.60	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,217,420.68	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	997,500.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,941,878.98	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,594,812.49	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,500,000.00	3,486,601.58	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,974,843.76	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	3,285,484.25	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	460,000.00	457,394.53	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	5,000,000.00	4,962,500.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,937,415.48	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,357,154.61	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,594,062.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,733,294.34	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	680,976.55	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,886,847.42	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,446,673.38	
		US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,348,049.55	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,360,585.90	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,970,000.00	5,712,587.58	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,390,310.79	
		US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,850,000.00	4,124,161.96	
		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	4,220,000.00	4,567,819.99	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,597,009.15	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,585,569.51	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	6,590,000.00	6,453,051.56	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	2,560,000.00	2,499,999.99	
		US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	3,250,000.00	3,245,175.76	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	951,740.59	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	1,179,968.72	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,180,722.60	

		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	1,000,786.30	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	220,000.00	333,892.96	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	1,091,968.72	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	2,161,915.92	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	2,182,695.20	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,139,501.92	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	1,065,528.10	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,427,544.90	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,525,984.37	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	2,074,162.46	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,525,691.75	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,409,316.35	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,340,445.62	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,370,474.97	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	658,281.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	995,812.48	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,487,578.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,635,234.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,602,458.80	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	2,020,000.00	2,865,007.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	3,020,458.17	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	2,480,000.00	3,525,184.34	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	3,295,218.72	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,846,482.39	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,988,023.38	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,949,171.71	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	4,166,374.72	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,400,000.00	4,342,304.56	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	5,091,632.52	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,357,702.88	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,998,632.75	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,463,933.54	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,565,468.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,675,875.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,522,106.11	

		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,518,046.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,578,732.56	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,624,091.62	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	3,234,468.72	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	5,413,921.67	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	4,158,578.12	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	4,370,308.47	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,887,929.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	3,388,812.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,655,820.08	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	4,033,433.27	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,450,000.00	1,319,613.27	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	2,413,992.98	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	1,500,000.00	1,498,828.12	
米ドル小計			576,760,000.00	635,695,764.26 (66,188,642,974)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/02/01	690,000.00	700,439.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,210,000.00	1,214,803.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/05/01	960,000.00	977,337.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,016,573.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/08/01	810,000.00	810,567.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,691,000.00	1,713,693.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/11/01	1,440,000.00	1,440,648.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/02/01	260,000.00	260,044.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,283,239.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,051,069.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,538,619.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	839,248.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,204,257.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	1,145,000.00	1,194,372.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	860,000.00	891,682.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	1,028,052.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,173,681.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	100,000.00	98,955.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,170,000.00	1,234,993.50	

		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	545,442.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	860,000.00	886,410.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	917,000.00	1,013,266.66	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	820,000.00	1,164,514.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	763,722.88	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	2,305,042.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,237,631.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	750,000.00	1,205,580.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	885,000.00	1,352,572.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,110,000.00	1,657,685.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	995,000.00	1,348,055.85	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	1,468,000.00	1,742,369.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	501,250.45	
加ドル小計			33,208,000.00	37,395,822.46 (3,052,994,945)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-21/12/09	15,500,000.00	15,927,742.65	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	20,700,000.00	21,346,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%-23/03/09	15,300,000.00	16,057,828.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	17,900,000.00	19,625,671.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	16,100,000.00	17,956,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	18,100,000.00	21,592,734.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	17,350,000.00	18,022,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,800,000.00	23,491,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	20,370,000.00	24,631,785.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	11,500,000.00	13,375,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,800,000.00	7,906,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	5,600,000.00	7,737,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,150,000.00	14,773,640.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	13,700,000.00	15,438,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	11,870,000.00	13,674,610.93	

メキシコペソ小計			223,740,000.00	251,558,545.74 (1,295,526,510)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	930,000.00	987,148.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,050,000.00	1,145,091.15	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,010,000.00	1,087,848.78	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	550,000.00	565,153.60	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,050,000.00	1,175,916.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	890,000.00	933,364.36	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,145,000.00	1,225,338.92	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	770,000.00	985,164.95	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,129,392.93	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	860,000.00	941,970.90	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	50,000.00	52,100.50	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,375,000.00	1,999,085.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,066,636.69	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,095,000.00	1,227,887.01	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	960,000.00	1,008,892.89	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,030,000.00	1,180,235.80	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	989,373.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	910,000.00	1,085,513.52	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	893,000.00	1,285,819.80	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,445,000.00	2,533,998.24	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	531,150.55	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	945,000.00	1,264,086.33	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	350,824.48	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,150,000.00	2,109,612.90	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	640,000.00	1,184,275.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	1,034,659.01	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	628,429.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	567,506.02	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	660,141.83	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	1,490,000.00	1,598,932.41	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%-22/04/30	1,430,000.00	1,450,477.74	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%-22/10/31	1,420,000.00	1,448,178.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,608,464.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-23/04/30	1,213,000.00	1,230,449.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-23/07/30	1,290,000.00	1,321,810.11	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,540,000.00	1,763,497.42	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,330,000.00	1,556,300.83	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,340,000.00	1,540,224.27	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,090,000.00	1,122,879.85	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,720,000.00	1,943,031.71	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,030,000.00	1,052,114.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,450,000.00	1,586,149.78	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,630,000.00	2,024,028.21	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,745,000.00	1,972,387.46	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,535,000.00	1,734,540.79	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,490,000.00	2,026,492.38	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	2,040,000.00	2,247,631.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,475,000.00	1,651,601.45	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,260,000.00	1,352,515.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,425,000.00	1,595,867.47	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,820,000.00	2,041,545.32	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,550,000.00	1,743,365.60	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,155,000.00	1,645,136.95	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,900,000.00	2,860,085.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,710,000.00	1,940,191.65	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,470,000.00	1,562,995.43	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,800,000.00	1,894,420.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,660,000.00	1,979,213.02	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,600,000.00	1,797,522.56	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,700,000.00	2,812,327.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,450,000.00	1,841,536.68	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,415,000.00	1,725,852.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,500,000.00	2,405,682.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,410,000.00	2,572,037.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	610,000.00	682,436.28	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,620,000.00	2,927,323.63	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	940,000.00	1,872,940.31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,320,000.00	1,999,498.64	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	1,463,264.09	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	900,000.00	943,542.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	1,564,848.32	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-22/04/08	1,000,000.00	1,010,243.00	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-22/10/07	1,000,000.00	1,014,542.20	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,783,631.50	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-23/10/13	2,800,000.00	2,866,509.52	

		BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,335,783.80	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/10/18	1,000,000.00	1,031,763.00	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/04/11	3,000,000.00	3,106,917.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	2,000,000.00	2,058,764.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	2,370,000.00	2,464,458.72	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	1,600,000.00	1,664,081.28	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	1,900,000.00	1,996,607.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	1,720,000.00	1,817,601.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	1,850,000.00	1,990,994.23	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	963,477.68	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,230,000.00	1,331,989.14	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,950,000.00	2,107,363.05	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,830,000.00	1,954,714.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,770,000.00	1,869,378.42	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,540,000.00	2,759,811.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	2,685,000.00	2,870,898.66	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,560,000.00	2,678,906.88	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,525,000.00	2,690,768.77	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	1,130,000.00	1,686,482.06	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	2,340,000.00	2,543,420.88	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,150,000.00	1,210,326.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,150,000.00	1,686,822.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-	1,845,000.00	2,014,942.95	

		28/02/15			
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	1,170,000.00	1,674,162.36	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,798,870.56	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	2,160,000.00	2,333,687.76	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,450,000.00	1,537,688.75	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	1,280,000.00	2,114,708.48	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,110,000.00	1,178,240.58	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	260,000.00	276,159.52	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	420,000.00	447,278.16	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,821,527.76	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,265,000.00	2,210,959.41	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	170,000.00	181,108.31	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,730,000.00	3,019,915.68	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,235,000.00	2,349,639.37	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,330,000.00	2,730,689.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	1,733,464.43	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	3,055,000.00	5,176,670.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	2,692,000.00	4,691,778.04	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	2,912,724.24	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,180,000.00	1,257,163.74	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/09/16	3,000,000.00	3,041,055.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-21/12/15	1,060,000.00	1,088,395.81	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01	1,520,000.00	1,621,157.52	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%-22/04/01	1,390,000.00	1,420,058.05	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-22/04/15	970,000.00	993,415.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%-22/07/15	1,100,000.00	1,126,152.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-22/08/01	1,270,000.00	1,298,643.58	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01	1,700,000.00	1,874,122.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-22/09/15	1,310,000.00	1,354,575.23	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	2,000,000.00	2,223,692.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%-23/01/15	500,000.00	505,247.85	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-23/03/01	910,000.00	937,709.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-23/03/15	1,200,000.00	1,237,420.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	1,365,000.00	1,526,027.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-23/06/15	1,000,000.00	1,025,796.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	1,700,000.00	1,933,199.88	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-23/10/01	1,310,000.00	1,414,518.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%-23/10/15	1,160,000.00	1,194,153.88	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	860,000.00	1,093,204.48	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	1,650,000.00	1,906,088.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-24/05/15	1,075,000.00	1,153,448.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%-24/07/01	1,360,000.00	1,457,014.24	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	1,450,000.00	1,665,380.10	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-24/11/15	1,350,000.00	1,439,115.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	1,480,000.00	1,639,322.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-25/02/01	1,560,000.00	1,595,945.52	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	1,540,000.00	1,877,591.71	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-25/05/15	1,175,000.00	1,257,902.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	1,400,000.00	1,503,185.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01	800,000.00	871,984.96	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,300,000.00	1,465,852.96	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,480,000.00	1,633,698.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	290,000.00	297,949.24	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,730,000.00	2,138,539.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	1,230,000.00	1,338,086.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	1,220,000.00	1,362,067.78	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	1,280,000.00	1,821,126.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,640,000.00	1,756,572.34	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,000,000.00	1,045,567.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,313,647.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	1,395,000.00	1,568,119.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	420,000.00	441,226.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	2,060,000.00	2,943,347.57	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	2,025,000.00	2,279,364.30	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,780,383.22	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,785,000.00	2,134,931.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	1,590,000.00	1,944,905.49	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	2,050,000.00	2,921,491.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,800,000.00	2,301,267.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	1,700,000.00	1,843,896.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	1,100,000.00	1,150,988.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,145,000.00	1,271,957.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	140,000.00	144,989.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	2,230,000.00	3,452,809.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,685,000.00	1,872,363.57	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,740,000.00	2,759,570.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,140,000.00	1,373,932.56	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,580,000.00	2,433,247.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	1,150,000.00	1,533,305.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01	700,000.00	753,452.28	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	900,000.00	1,073,482.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	2,260,000.00	3,270,909.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	1,200,000.00	1,567,970.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,850,000.00	3,075,251.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	310,000.00	414,872.19	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,720,000.00	2,888,090.18	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	830,000.00	920,266.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	1,145,000.00	1,958,389.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	1,120,000.00	1,589,749.84	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	1,270,000.00	1,650,523.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,365,000.00	2,013,450.07	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	785,000.00	1,243,427.98	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	1,180,000.00	1,477,918.14	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	600,000.00	639,512.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	680,000.00	913,252.24	
		FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	365,000.00	380,387.30	
		FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	579,363.40	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	255,279.50	
		FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	568,524.84	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	600,000.00	617,200.80	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	518,599.19	
		FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	344,929.76	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	570,121.68	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	371,883.81	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	478,445.46	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	293,023.98	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	501,702.68	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	382,422.48	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	434,709.52	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	495,000.00	520,636.39	
		FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	50,000.00	53,609.80	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	570,126.80	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	360,397.44	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	3,962,217.22	

FRANCE (GOVT OF)-0.0%-22/05/25	2,310,000.00	2,335,167.45	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,905,647.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	2,980,000.00	3,030,999.72	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,171,714.94	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,355,164.76	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,501,461.30	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,090,000.00	2,141,623.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,994,000.00	3,307,726.29	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,608,000.00	3,967,656.26	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	1,665,000.00	1,716,099.51	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,753,028.00	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	3,972,089.68	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,521,474.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,862,420.40	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,771,826.56	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,000,000.00	2,129,732.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,700,000.00	2,845,303.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,590,000.00	2,865,544.92	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,230,000.00	3,990,303.24	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,154,480.14	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,760,000.00	3,045,588.24	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,158,532.26	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	1,870,000.00	2,029,396.93	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,400,000.00	2,497,039.20	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	3,175,000.00	4,072,801.10	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	515,000.00	534,511.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,295,000.00	3,947,663.71	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,540,000.00	4,408,543.38	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	4,090,000.00	4,897,821.62	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,885,000.00	4,972,153.25	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,825,000.00	3,418,490.12	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,320,000.00	4,017,822.40	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,710,000.00	3,603,595.40	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,787,453.64	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,530,000.00	2,664,170.64	

		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,660,000.00	2,439,987.52	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,790,000.00	2,408,713.50	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,230,000.00	1,385,301.03	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,453,480.96	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,050,000.00	2,442,469.05	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,280,596.35	
		IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	489,075.36	
		IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	65,000.00	65,881.60	
		IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	540,000.00	596,857.24	
		IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	590,000.00	669,654.72	
		IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	840,000.00	1,059,216.98	
		IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	875,000.00	952,702.36	
		IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	513,235.31	
		IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	679,146.96	
		IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	770,000.00	870,168.37	
		IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	675,000.00	854,400.48	
		IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	770,000.00	903,672.77	
		IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	422,607.97	
		IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	460,000.00	493,765.84	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	501,266.22	
		IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	562,000.00	808,232.43	
		IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	384,000.00	514,970.88	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	950,000.00	957,616.15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,270,000.00	1,330,956.19	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	388,727.13	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	760,000.00	892,521.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,050,000.00	1,119,253.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	1,140,000.00	1,167,452.34	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,250,000.00	1,375,843.75	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,335,223.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,278,434.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	695,000.00	724,319.27	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,343,114.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	925,000.00	1,339,453.65	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	1,065,319.42	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	765,000.00	821,997.09	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	730,000.00	999,388.25	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,985,368.05	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	973,000.00	1,125,535.26	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,205,000.00	2,268,919.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,213,000.00	2,190,824.77	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	355,000.00	371,546.97	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	267,865.73	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	889,999.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	615,000.00	651,335.61	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-22/09/20	355,000.00	359,654.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,015,833.56	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	437,430.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	580,986.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	970,000.00	1,039,739.12	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	569,779.65	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	935,240.89	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	670,000.00	733,911.97	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	909,300.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	760,000.00	824,944.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	736,357.19	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	996,859.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	620,000.00	681,486.64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	592,192.91	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	620,000.00	647,314.22	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	780,576.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,125,000.00	1,938,785.62	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	110,000.00	111,718.31	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	599,000.00	1,063,249.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	603,000.00	843,600.61	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	305,000.00	369,637.73	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	725,612.15	
ユーロ小計			410,970,000.00	506,758,105.16 (64,155,576,113)	
英ポンド	**国債証券**	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	575,000.00	844,538.84	

		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,155,383.46	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,670,000.00	1,723,526.17	
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,570,000.00	1,576,110.44	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,410,000.00	1,500,412.30	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,580,000.00	1,638,121.88	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	967,429.40	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,586,272.52	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	1,828,000.00	1,884,671.65	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	1,110,000.00	1,117,660.77	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,150,000.00	1,249,332.40	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,370,000.00	1,479,523.28	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,177,138.87	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	775,000.00	776,937.50	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,250,000.00	1,400,751.75	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	900,000.00	1,319,857.20	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	1,471,000.00	1,561,622.13	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,000,000.00	1,012,806.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,555,318.60	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,975,423.55	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,462,365.15	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	300,000.00	303,234.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	2,119,171.34	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,696,402.18	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,345,000.00	2,300,405.95	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,200,000.00	1,967,760.00	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,135,000.00	1,895,676.09	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	445,000.00	491,191.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,499,055.23	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,552,647.29	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,795,499.66	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,375,000.00	2,508,907.50	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,520,000.00	1,790,592.83	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	620,000.00	776,321.84	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,045,000.00	1,998,277.21	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	285,000.00	274,514.22	

		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,212,000.00	2,243,575.86	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	803,585.13	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,370,000.00	2,872,229.66	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,441,039.65	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,036,000.00	2,218,627.56	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	370,000.00	348,572.26	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,160,000.00	2,518,307.22	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,735,000.00	1,751,779.53	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,661,185.50	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	971,455.65	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,242,000.00	2,124,960.28	
英ポンド小計			54,478,000.00	73,890,178.50 (10,265,562,499)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	7,550,000.00	7,984,327.34	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,613,921.62	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,220,000.00	5,892,724.36	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,900,000.00	5,286,095.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	4,241,171.09	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,758,794.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	5,385,000.00	8,525,873.40	
スウェーデンクローナ小計			35,815,000.00	41,302,907.31 (512,569,079)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,670,000.00	5,908,788.64	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,709,472.88	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,720,000.00	2,865,362.24	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,650,000.00	2,778,005.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	3,027,394.56	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	2,986,534.24	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	2,986,212.35	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	3,087,750.25	
ノルウェークローネ小計			26,680,000.00	28,349,520.76 (338,493,277)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.25%-22/11/15	4,400,000.00	4,477,715.44	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	5,340,000.00	5,682,683.82	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,960,000.00	6,675,011.66	

		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,360,000.00	4,695,205.52	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,750,000.00	1,912,330.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,780,000.00	22,709,403.89	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	900,000.00	1,000,422.00	
デンマーククローネ小計			34,490,000.00	47,152,772.33 (802,068,657)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,695,000.00	2,778,827.97	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-22/07/25	2,200,000.00	2,200,238.69	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,720,000.00	1,895,448.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,210,628.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,970,000.00	2,192,078.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,290,000.00	2,470,268.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,430,000.00	2,615,263.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	800,000.00	810,888.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,890,000.00	3,255,845.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,300,000.00	3,626,139.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,340,000.00	2,581,183.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,536,624.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	655,000.00	907,306.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	3,255,000.00	3,680,103.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	750,000.00	745,650.00	
ポーランドズロチ小計			31,655,000.00	34,506,492.26 (984,470,224)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,175,000.00	1,198,279.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,650,000.00	1,798,486.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,860,000.00	1,937,510.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,470,000.00	2,782,188.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,330,000.00	2,535,898.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	2,095,000.00	2,097,925.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,310,000.00	2,607,868.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,550,000.00	1,543,146.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,400,000.00	2,891,563.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,860,000.00	1,865,018.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,170,000.00	2,744,589.74	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,040,000.00	2,339,599.90	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,200,000.00	2,453,876.92	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	2,210,000.00	2,554,803.31	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,210,000.00	2,651,220.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	2,320,000.00	2,698,517.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	2,390,000.00	2,735,029.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	2,000,000.00	2,006,838.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,348,000.00	1,414,733.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,770,000.00	1,762,208.33	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,609,030.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,440,096.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	630,307.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	850,000.00	1,135,644.11	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	837,276.74	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	931,120.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	1,060,000.00	1,308,320.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,120,000.00	1,068,321.06	
豪ドル小計			47,985,000.00	53,579,422.12 (4,205,448,842)	
シンガポールドル	**国債証券**	SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	450,000.00	458,238.73	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	525,000.00	549,997.87	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	460,000.00	473,570.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	577,645.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	190,000.00	199,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	591,030.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	410,000.00	444,317.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	74,000.00	73,902.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	400,000.00	432,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	560,000.00	654,920.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	365,000.00	412,450.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	583,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	485,000.00	573,003.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	565,372.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	421,000.00	488,549.45	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	159,220.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	317,000.00	407,345.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	490,000.00	649,495.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	309,000.00	366,348.85	
シンガポールドル小計			7,619,000.00	8,660,506.42 (676,385,551)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	655,000.00	666,997.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	830,000.00	851,771.56	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	786,551.58	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	656,239.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	838,120.04	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	475,000.00	497,515.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	888,847.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	342,228.03	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,059,380.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	843,960.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	750,000.00	812,625.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,194,600.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,520,000.00	1,648,136.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	100,000.00	99,050.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	799,556.45	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,170,400.04	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	659,914.56	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,040,000.00	1,206,919.94	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	691,683.78	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	910,000.00	942,105.16	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	661,339.53	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	818,598.38	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	906,315.33	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	540,000.00	557,942.36	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	872,712.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,330,000.00	1,375,818.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	1,007,633.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,070,000.00	1,182,210.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	488,442.82	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	1,007,475.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	700,000.00	752,150.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	1,031,379.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,149,354.56	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	1,042,477.05	
マレーシアリンギット小計			27,305,000.00	29,510,449.07 (756,943,018)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-22/01/31	1,300,000.00	1,379,730.95	
		ISRAEL FIXED BOND-0.75%-22/07/31	1,080,000.00	1,091,539.69	
		ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,022,186.30	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,390,000.00	1,519,537.57	
		ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	500,000.00	499,268.50	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,200,000.00	1,246,780.32	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,320,000.00	1,471,193.32	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	750,000.00	755,672.25	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,400,000.00	1,497,114.92	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,200,000.00	1,602,927.96	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,500,000.00	1,638,312.30	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,398,581.37	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	985,000.00	996,479.28	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	770,000.00	766,737.51	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,400,000.00	2,362,824.10	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,390,000.00	1,895,251.64	
イスラエルシュケル小計			18,435,000.00	21,144,137.98 (675,555,208)	
合計				153,910,236,897 (153,910,236,897)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券　223銘柄	100.0%	43.2%
加ドル	国債証券　32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　313銘柄	100.0%	41.7%

英ポンド	国債証券	47銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7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%
豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	2.7%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券	16銘柄	100.0%	0.4%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	61,180,742	150,832,372
株式	31,167,364,370	35,971,615,820
派生商品評価勘定	-	822,250
未収入金	-	50,423,950
未収配当金	257,024,263	9,670,870
前払金	10,590,000	-
流動資産合計	31,496,159,375	36,183,365,262
資産合計	31,496,159,375	36,183,365,262
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,167,100	-
前受金	-	1,275,000
未払金	-	22,719,400
未払解約金	10,813,428	92,295,954
未払利息	25	78
流動負債合計	28,980,553	116,290,432
負債合計	28,980,553	116,290,432
純資産の部		
元本等		

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
元本	21,851,680,688	21,288,735,361
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	9,615,498,134	14,778,339,469
元本等合計	31,467,178,822	36,067,074,830
純資産合計	31,467,178,822	36,067,074,830
負債純資産合計	31,496,159,375	36,183,365,262

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
1．	期首	2019年12月17日	2020年 6月16日
	期首元本額	20,979,830,566円	21,851,680,688円
	期首からの追加設定元本額	4,242,931,061円	864,828,821円
	期首からの一部解約元本額	3,371,080,939円	1,427,774,148円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	670,142,336円	687,295,762円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	1,687,460,130円	1,728,745,773円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	3,210,115,045円	3,334,160,799円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	3,296,050,845円	3,448,560,834円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,410,120,999円	1,310,924,013円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,301,301,090円	3,077,232,515円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	749,065,066円	683,484,810円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	52,008,041円	46,064,306円

	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	42,727,323円	36,161,329円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	60,701,067円	55,712,416円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	58,029,296円	48,733,955円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,918,327,587円	3,584,783,014円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	291,188,168円	274,696,183円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	801,618,904円	765,283,581円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,174,177,211円	1,131,042,939円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	1,128,647,580円	1,075,853,132円
	計	21,851,680,688円	21,288,735,361円
２．	受益権の総数	21,851,680,688口	21,288,735,361口
３．	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	369,580,000円	411,530,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△1,737,420,475
合計	△1,737,420,475

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,305,374,272
合計	3,305,374,272

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2020年 6月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	352,775,000	－	334,620,000	△18,155,000
合計		352,775,000	－	334,620,000	△18,155,000

（2020年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	88,050,000	－	88,875,000	825,000
合計		88,050,000	－	88,875,000	825,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 6月15日現在		2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.4400円	1口当たり純資産額	1.6942円
(1万口当たり純資産額)	(14,400円)	(1万口当たり純資産額)	(16,942円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	2,881.00	2,016,700	
日本水産	19,700	428.00	8,431,600	
マルハニチロ	2,800	2,161.00	6,050,800	
雪国まいたけ	1,200	1,675.00	2,010,000	
カネコ種苗	600	1,551.00	930,600	
サカタのタネ	2,400	3,525.00	8,460,000	
ホクト	1,500	2,111.00	3,166,500	
ホクリヨウ	300	710.00	213,000	
住石ホールディングス	3,900	115.00	448,500	
日鉄鉱業	400	5,620.00	2,248,000	
三井松島ホールディングス	700	719.00	503,300	
国際石油開発帝石	72,900	579.00	42,209,100	
石油資源開発	2,600	1,871.00	4,864,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	900	1,492.00	1,342,800	
ヒノキヤグループ	500	2,192.00	1,096,000	
ショーボンドホールディングス	3,100	5,150.00	15,965,000	
ミライト・ホールディングス	5,900	1,674.00	9,876,600	
サンヨーホームズ	200	718.00	143,600	
日本アクア	900	637.00	573,300	
ファーストコーポレーション	700	717.00	501,900	
ベステラ	400	1,624.00	649,600	
キャンディル	400	520.00	208,000	
スペースバリューホールディングス	2,500	642.00	1,605,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	700.00	280,000	
第一カッター興業	300	2,590.00	777,000	
安藤・間	11,900	720.00	8,568,000	
東急建設	6,000	509.00	3,054,000	
コムシスホールディングス	7,000	3,170.00	22,190,000	
ビーアールホールディングス	2,200	699.00	1,537,800	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,067.00	2,687,100	
東建コーポレーション	600	8,090.00	4,854,000	
ソネック	300	894.00	268,200	
ヤマウラ	900	936.00	842,400	
大成建設	15,200	3,715.00	56,468,000	
大林組	45,700	928.00	42,409,600	
清水建設	46,400	814.00	37,769,600	

飛島建設	1,300	1,098.00	1,427,400	
長谷工コーポレーション	17,700	1,172.00	20,744,400	
松井建設	1,900	797.00	1,514,300	
錢高組	200	4,660.00	932,000	
鹿島建設	35,900	1,380.00	49,542,000	
不動テトラ	1,300	1,735.00	2,255,500	
大末建設	600	884.00	530,400	
鉄建建設	1,000	1,833.00	1,833,000	
西松建設	3,500	2,062.00	7,217,000	
三井住友建設	11,100	429.00	4,761,900	
大豊建設	1,100	3,515.00	3,866,500	
前田建設工業	11,500	958.00	11,017,000	
ナカノフドー建設	1,400	415.00	581,000	
奥村組	2,200	2,495.00	5,489,000	
東鉄工業	2,000	2,782.00	5,564,000	
イチケン	400	1,808.00	723,200	
富士ピー・エス	800	628.00	502,400	
淺沼組	500	3,970.00	1,985,000	
戸田建設	19,100	653.00	12,472,300	
熊谷組	2,100	2,543.00	5,340,300	
北野建設	300	2,537.00	761,100	
植木組	200	2,819.00	563,800	
矢作建設工業	2,100	858.00	1,801,800	
ピーエス三菱	1,600	606.00	969,600	
日本ハウスホールディングス	3,300	286.00	943,800	
大東建託	5,000	9,640.00	48,200,000	
新日本建設	2,000	851.00	1,702,000	
ＮＩＰＰＯ	3,800	2,775.00	10,545,000	
東亜道路工業	300	3,905.00	1,171,500	
前田道路	4,100	1,736.00	7,117,600	
日本道路	400	7,600.00	3,040,000	
東亜建設工業	1,500	1,947.00	2,920,500	
日本国土開発	4,600	557.00	2,562,200	
若築建設	900	1,178.00	1,060,200	
東洋建設	5,400	427.00	2,305,800	
五洋建設	18,200	847.00	15,415,400	
福田組	500	5,450.00	2,725,000	
住友林業	11,600	1,972.00	22,875,200	
日本基礎技術	1,600	505.00	808,000	
巴コーポレーション	2,200	423.00	930,600	
大和ハウス工業	45,200	3,143.00	142,063,600	
ライト工業	2,600	1,770.00	4,602,000	

積水ハウス	49,600	1,984.00	98,406,400	
日特建設	1,300	789.00	1,025,700	
北陸電気工事	800	1,291.00	1,032,800	
ユアテック	2,700	786.00	2,122,200	
日本リーテック	1,000	2,379.00	2,379,000	
四電工	300	2,827.00	848,100	
中電工	1,900	2,154.00	4,092,600	
関電工	6,600	807.00	5,326,200	
きんでん	10,900	1,641.00	17,886,900	
東京エネシス	1,600	859.00	1,374,400	
トーエネック	500	4,075.00	2,037,500	
住友電設	1,300	2,614.00	3,398,200	
日本電設工業	2,500	2,123.00	5,307,500	
協和エクシオ	6,900	2,882.00	19,885,800	
新日本空調	1,200	2,190.00	2,628,000	
九電工	3,200	3,165.00	10,128,000	
三機工業	3,300	1,183.00	3,903,900	
日揮ホールディングス	14,100	978.00	13,789,800	
中外炉工業	500	1,740.00	870,000	
ヤマト	1,500	750.00	1,125,000	
太平電業	1,100	2,416.00	2,657,600	
高砂熱学工業	3,500	1,487.00	5,204,500	
三晃金属工業	200	2,761.00	552,200	
朝日工業社	300	3,145.00	943,500	
明星工業	3,100	781.00	2,421,100	
大氣社	2,200	2,774.00	6,102,800	
ダイダン	1,100	2,856.00	3,141,600	
日比谷総合設備	1,500	1,879.00	2,818,500	
フィル・カンパニー	300	2,078.00	623,400	
ＯＳＪＢホールディングス	7,400	274.00	2,027,600	
東洋エンジニアリング	2,100	423.00	888,300	
レイズネクスト	2,500	1,181.00	2,952,500	
日本製粉	4,300	1,621.00	6,970,300	
日清製粉グループ本社	16,500	1,659.00	27,373,500	
日東富士製粉	100	6,540.00	654,000	
昭和産業	1,300	3,085.00	4,010,500	
鳥越製粉	1,300	1,025.00	1,332,500	
中部飼料	1,800	1,420.00	2,556,000	
フィード・ワン	2,000	894.00	1,788,000	
東洋精糖	300	1,227.00	368,100	
日本甜菜製糖	800	1,640.00	1,312,000	
三井製糖	1,300	1,795.00	2,333,500	

塩水港精糖	1,700	225.00	382,500	
日新製糖	700	1,843.00	1,290,100	
森永製菓	3,400	3,840.00	13,056,000	
中村屋	400	4,015.00	1,606,000	
江崎グリコ	4,000	4,565.00	18,260,000	
名糖産業	700	1,464.00	1,024,800	
井村屋グループ	900	2,635.00	2,371,500	
不二家	1,000	2,471.00	2,471,000	
山崎製パン	11,000	1,730.00	19,030,000	
第一屋製パン	300	1,004.00	301,200	
モロゾフ	200	6,120.00	1,224,000	
亀田製菓	800	4,840.00	3,872,000	
寿スピリッツ	1,400	5,230.00	7,322,000	
カルビー	6,700	3,075.00	20,602,500	
森永乳業	2,700	4,995.00	13,486,500	
六甲バター	1,000	1,942.00	1,942,000	
ヤクルト本社	10,100	5,160.00	52,116,000	
明治ホールディングス	9,700	7,280.00	70,616,000	
雪印メグミルク	3,500	2,212.00	7,742,000	
プリマハム	2,300	3,160.00	7,268,000	
日本ハム	5,600	4,715.00	26,404,000	
林兼産業	500	589.00	294,500	
丸大食品	1,600	1,686.00	2,697,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,200	3,340.00	4,008,000	
柿安本店	500	2,551.00	1,275,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,400	683.00	6,420,200	
サッポロホールディングス	5,000	2,055.00	10,275,000	
アサヒグループホールディングス	31,900	4,292.00	136,914,800	
キリンホールディングス	62,000	2,389.50	148,149,000	
宝ホールディングス	10,800	1,245.00	13,446,000	
オエノンホールディングス	4,200	402.00	1,688,400	
養命酒製造	500	1,896.00	948,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	11,200	1,613.00	18,065,600	
サントリー食品インターナショナル	9,800	3,795.00	37,191,000	
ダイドーグループホールディングス	700	5,710.00	3,997,000	
伊藤園	4,400	6,650.00	29,260,000	
キーコーヒー	1,500	2,142.00	3,213,000	
ユニカフェ	500	1,240.00	620,000	
ジャパンフーズ	200	1,239.00	247,800	
日清オイリオグループ	1,900	3,005.00	5,709,500	
不二製油グループ本社	3,600	2,889.00	10,400,400	
Ｊ－オイルミルズ	800	3,535.00	2,828,000	

キッコーマン	10,500	6,530.00	68,565,000	
味の素	32,300	2,356.50	76,114,950	
キユーピー	8,100	2,209.00	17,892,900	
ハウス食品グループ本社	5,500	3,840.00	21,120,000	
カゴメ	6,000	3,735.00	22,410,000	
焼津水産化学工業	700	1,008.00	705,600	
アリアケジャパン	1,300	7,090.00	9,217,000	
ピエトロ	200	1,709.00	341,800	
エバラ食品工業	400	2,433.00	973,200	
やまみ	100	2,158.00	215,800	
ニチレイ	7,000	2,801.00	19,607,000	
東洋水産	7,500	5,110.00	38,325,000	
イートアンドホールディングス	500	1,871.00	935,500	
大冷	200	1,954.00	390,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	830.00	664,000	
日清食品ホールディングス	6,200	8,560.00	53,072,000	
永谷園ホールディングス	700	2,286.00	1,600,200	
一正蒲鉾	600	1,189.00	713,400	
フジッコ	1,600	2,036.00	3,257,600	
ロック・フィールド	1,600	1,615.00	2,584,000	
日本たばこ産業	78,400	2,200.00	172,480,000	
ケンコーマヨネーズ	800	1,876.00	1,500,800	
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,421.00	1,421,000	
なとり	800	1,940.00	1,552,000	
イフジ産業	300	831.00	249,300	
ピックルスコーポレーション	300	3,145.00	943,500	
北の達人コーポレーション	5,200	482.00	2,506,400	
ユーグレナ	6,300	821.00	5,172,300	
ミヨシ油脂	500	1,272.00	636,000	
理研ビタミン	1,400	1,382.00	1,934,800	
片倉工業	1,900	1,474.00	2,800,600	
グンゼ	1,000	3,505.00	3,505,000	
東洋紡	5,600	1,368.00	7,660,800	
ユニチカ	4,200	414.00	1,738,800	
富士紡ホールディングス	700	3,835.00	2,684,500	
倉敷紡績	1,400	1,896.00	2,654,400	
シキボウ	800	1,032.00	825,600	
日本毛織	4,700	1,032.00	4,850,400	
ダイトウボウ	2,300	108.00	248,400	
トーア紡コーポレーション	600	475.00	285,000	
ダイドーリミテッド	2,000	192.00	384,000	
帝国繊維	1,600	2,574.00	4,118,400	

帝人	11,600	1,943.00	22,538,800	
東レ	103,200	619.00	63,880,800	
サカイオーベックス	400	2,101.00	840,400	
住江織物	300	2,209.00	662,700	
日本フエルト	900	451.00	405,900	
イチカワ	200	1,304.00	260,800	
日東製網	200	1,492.00	298,400	
アツギ	1,200	540.00	648,000	
ダイニック	600	880.00	528,000	
セーレン	3,500	1,606.00	5,621,000	
ソトー	600	899.00	539,400	
東海染工	200	1,140.00	228,000	
小松マテーレ	2,400	1,000.00	2,400,000	
ワコールホールディングス	3,600	2,083.00	7,498,800	
ホギメディカル	1,600	3,390.00	5,424,000	
クラウディアホールディングス	400	291.00	116,400	
ＴＳＩホールディングス	4,400	219.00	963,600	
マツオカコーポレーション	400	2,400.00	960,000	
ワールド	2,000	1,260.00	2,520,000	
三陽商会	800	575.00	460,000	
ナイガイ	600	353.00	211,800	
オンワードホールディングス	8,500	210.00	1,785,000	
ルックホールディングス	500	1,089.00	544,500	
ゴールドウイン	2,600	7,170.00	18,642,000	
デサント	2,800	1,873.00	5,244,400	
キング	700	579.00	405,300	
ヤマトインターナショナル	1,300	343.00	445,900	
特種東海製紙	900	5,260.00	4,734,000	
王子ホールディングス	59,500	551.00	32,784,500	
日本製紙	6,300	1,200.00	7,560,000	
三菱製紙	1,500	324.00	486,000	
北越コーポレーション	8,400	387.00	3,250,800	
中越パルプ工業	600	1,319.00	791,400	
巴川製紙所	500	802.00	401,000	
大王製紙	6,800	1,843.00	12,532,400	
阿波製紙	300	496.00	148,800	
レンゴー	13,400	827.00	11,081,800	
トーモク	900	1,711.00	1,539,900	
ザ・パック	1,100	3,015.00	3,316,500	
クラレ	22,500	1,136.00	25,560,000	
旭化成	94,600	1,031.50	97,579,900	
共和レザー	800	688.00	550,400	

昭和電工	10,800	2,218.00	23,954,400	
住友化学	104,800	411.00	43,072,800	
住友精化	600	3,990.00	2,394,000	
日産化学	7,900	6,130.00	48,427,000	
ラサ工業	500	2,286.00	1,143,000	
クレハ	1,200	6,790.00	8,148,000	
多木化学	600	6,490.00	3,894,000	
テイカ	1,000	1,608.00	1,608,000	
石原産業	2,600	641.00	1,666,600	
片倉コープアグリ	400	1,226.00	490,400	
日本曹達	2,100	2,946.00	6,186,600	
東ソー	22,000	1,732.00	38,104,000	
トクヤマ	4,100	2,354.00	9,651,400	
セントラル硝子	2,900	2,317.00	6,719,300	
東亞合成	9,000	1,283.00	11,547,000	
大阪ソーダ	1,500	2,653.00	3,979,500	
関東電化工業	3,400	799.00	2,716,600	
デンカ	5,200	3,880.00	20,176,000	
信越化学工業	24,500	17,160.00	420,420,000	
日本カーバイド工業	500	1,309.00	654,500	
堺化学工業	900	2,028.00	1,825,200	
第一稀元素化学工業	1,600	823.00	1,316,800	
エア・ウォーター	13,300	1,845.00	24,538,500	
日本酸素ホールディングス	13,700	1,982.00	27,153,400	
日本化学工業	400	2,570.00	1,028,000	
東邦アセチレン	200	1,770.00	354,000	
日本パーカライジング	7,200	1,098.00	7,905,600	
高圧ガス工業	2,300	820.00	1,886,000	
四国化成工業	2,100	1,209.00	2,538,900	
戸田工業	300	2,620.00	786,000	
ステラ　ケミファ	800	3,370.00	2,696,000	
保土谷化学工業	500	4,610.00	2,305,000	
日本触媒	2,200	5,600.00	12,320,000	
大日精化工業	1,300	2,355.00	3,061,500	
カネカ	3,700	3,475.00	12,857,500	
三菱瓦斯化学	13,300	2,300.00	30,590,000	
三井化学	13,200	2,854.00	37,672,800	
ＪＳＲ	13,300	2,724.00	36,229,200	
東京応化工業	2,400	6,860.00	16,464,000	
大阪有機化学工業	1,300	2,986.00	3,881,800	
三菱ケミカルホールディングス	95,400	654.50	62,439,300	
ＫＨネオケム	2,400	2,799.00	6,717,600	

ダイセル	17,800	742.00	13,207,600	
住友ベークライト	2,200	3,555.00	7,821,000	
積水化学工業	30,200	1,936.00	58,467,200	
日本ゼオン	12,900	1,401.00	18,072,900	
アイカ工業	4,300	3,640.00	15,652,000	
宇部興産	7,200	1,906.00	13,723,200	
積水樹脂	2,600	2,184.00	5,678,400	
タキロンシーアイ	3,200	708.00	2,265,600	
旭有機材	800	1,561.00	1,248,800	
ニチバン	800	1,658.00	1,326,400	
リケンテクノス	3,500	464.00	1,624,000	
大倉工業	700	1,900.00	1,330,000	
積水化成品工業	1,900	543.00	1,031,700	
群栄化学工業	300	2,434.00	730,200	
タイガースポリマー	800	414.00	331,200	
ミライアル	500	1,187.00	593,500	
ダイキアクシス	500	1,166.00	583,000	
ダイキョーニシカワ	3,100	827.00	2,563,700	
竹本容器	500	1,013.00	506,500	
森六ホールディングス	800	2,268.00	1,814,400	
日本化薬	8,800	967.00	8,509,600	
カーリットホールディングス	1,500	745.00	1,117,500	
日本精化	1,100	1,462.00	1,608,200	
扶桑化学工業	1,400	3,835.00	5,369,000	
トリケミカル研究所	300	14,910.00	4,473,000	
ＡＤＥＫＡ	6,600	1,820.00	12,012,000	
日油	5,400	5,100.00	27,540,000	
新日本理化	2,500	301.00	752,500	
ハリマ化成グループ	1,200	1,139.00	1,366,800	
花王	34,900	7,762.00	270,893,800	
第一工業製薬	500	4,405.00	2,202,500	
石原ケミカル	400	2,264.00	905,600	
日華化学	500	981.00	490,500	
ニイタカ	300	3,170.00	951,000	
三洋化成工業	900	4,950.00	4,455,000	
有機合成薬品工業	1,200	329.00	394,800	
大日本塗料	1,600	980.00	1,568,000	
日本ペイントホールディングス	11,800	11,250.00	132,750,000	
関西ペイント	16,000	3,010.00	48,160,000	
神東塗料	1,200	196.00	235,200	
中国塗料	4,100	1,023.00	4,194,300	
日本特殊塗料	1,100	1,292.00	1,421,200	

藤倉化成	2,000	561.00	1,122,000	
太陽ホールディングス	1,000	6,300.00	6,300,000	
ＤＩＣ	6,000	2,652.00	15,912,000	
サカタインクス	3,100	1,218.00	3,775,800	
東洋インキＳＣホールディングス	3,000	2,038.00	6,114,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,100	908.00	998,800	
富士フイルムホールディングス	27,900	5,740.00	160,146,000	
資生堂	28,900	7,345.00	212,270,500	
ライオン	18,900	2,455.00	46,399,500	
高砂香料工業	900	2,593.00	2,333,700	
マンダム	3,300	1,681.00	5,547,300	
ミルボン	1,900	6,300.00	11,970,000	
ファンケル	5,900	4,425.00	26,107,500	
コーセー	2,700	17,580.00	47,466,000	
コタ	900	1,399.00	1,259,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,200	2,072.00	12,846,400	
ノエビアホールディングス	1,200	4,390.00	5,268,000	
アジュバンコスメジャパン	300	1,012.00	303,600	
エステー	1,000	2,029.00	2,029,000	
アグロ　カネショウ	600	1,666.00	999,600	
コニシ	2,400	1,683.00	4,039,200	
長谷川香料	2,500	2,114.00	5,285,000	
星光ＰＭＣ	900	750.00	675,000	
小林製薬	4,100	12,790.00	52,439,000	
荒川化学工業	1,300	1,178.00	1,531,400	
メック	1,000	2,311.00	2,311,000	
日本高純度化学	400	2,683.00	1,073,200	
タカラバイオ	3,800	2,902.00	11,027,600	
ＪＣＵ	1,800	3,925.00	7,065,000	
新田ゼラチン	1,000	698.00	698,000	
ＯＡＴアグリオ	300	1,505.00	451,500	
デクセリアルズ	3,800	1,332.00	5,061,600	
アース製薬	1,100	5,980.00	6,578,000	
北興化学工業	1,400	1,115.00	1,561,000	
大成ラミック	500	2,944.00	1,472,000	
クミアイ化学工業	6,000	993.00	5,958,000	
日本農薬	2,600	532.00	1,383,200	
アキレス	1,000	1,470.00	1,470,000	
有沢製作所	2,400	1,009.00	2,421,600	
日東電工	10,100	8,830.00	89,183,000	
レック	1,600	1,395.00	2,232,000	
三光合成	1,700	378.00	642,600	

きもと	2,500	196.00	490,000	
藤森工業	1,300	4,775.00	6,207,500	
前澤化成工業	900	988.00	889,200	
未来工業	800	1,805.00	1,444,000	
ウェーブロックホールディングス	500	804.00	402,000	
ＪＳＰ	900	1,714.00	1,542,600	
エフピコ	3,100	4,210.00	13,051,000	
天馬	1,000	2,035.00	2,035,000	
信越ポリマー	2,600	976.00	2,537,600	
東リ	3,700	251.00	928,700	
ニフコ	5,400	3,815.00	20,601,000	
バルカー	1,200	2,079.00	2,494,800	
ユニ・チャーム	30,900	4,825.00	149,092,500	
ショーエイコーポレーション	200	1,035.00	207,000	
協和キリン	14,700	2,734.00	40,189,800	
武田薬品工業	121,200	3,856.00	467,347,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	126,300	1,526.50	192,796,950	
大日本住友製薬	10,800	1,391.00	15,022,800	
塩野義製薬	18,300	5,492.00	100,503,600	
わかもと製薬	1,700	267.00	453,900	
あすか製薬	1,700	1,742.00	2,961,400	
日本新薬	3,800	7,250.00	27,550,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,475.00	742,500	
中外製薬	45,600	4,993.00	227,680,800	
科研製薬	2,500	3,910.00	9,775,000	
エーザイ	17,400	7,576.00	131,822,400	
ロート製薬	7,500	3,145.00	23,587,500	
小野薬品工業	33,500	3,183.00	106,630,500	
久光製薬	3,800	6,240.00	23,712,000	
持田製薬	2,000	3,995.00	7,990,000	
参天製薬	27,200	1,714.00	46,620,800	
扶桑薬品工業	500	2,862.00	1,431,000	
日本ケミファ	200	2,392.00	478,400	
ツムラ	4,500	3,300.00	14,850,000	
日医工	4,100	1,007.00	4,128,700	
キッセイ薬品工業	2,600	2,250.00	5,850,000	
生化学工業	2,800	1,048.00	2,934,400	
栄研化学	2,500	2,021.00	5,052,500	
日水製薬	600	991.00	594,600	
鳥居薬品	900	3,340.00	3,006,000	
ＪＣＲファーマ	4,100	2,553.00	10,467,300	
東和薬品	1,900	1,874.00	3,560,600	

富士製薬工業	1,000	1,272.00	1,272,000	
沢井製薬	3,000	4,870.00	14,610,000	
ゼリア新薬工業	2,600	1,913.00	4,973,800	
第一三共	125,000	3,419.00	427,375,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	1,932.00	6,182,400	
大幸薬品	1,800	1,622.00	2,919,600	
ダイト	900	3,845.00	3,460,500	
大塚ホールディングス	30,300	4,424.00	134,047,200	
大正製薬ホールディングス	3,100	6,740.00	20,894,000	
ペプチドリーム	7,400	5,430.00	40,182,000	
日本コークス工業	12,400	72.00	892,800	
ニチレキ	1,700	1,631.00	2,772,700	
ユシロ化学工業	800	1,200.00	960,000	
ビーピー・カストロール	500	1,283.00	641,500	
富士石油	3,900	184.00	717,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	500	1,026.00	513,000	
出光興産	16,200	2,229.00	36,109,800	
ＥＮＥＯＳホールディングス	219,300	358.70	78,662,910	
コスモエネルギーホールディングス	4,200	1,793.00	7,530,600	
横浜ゴム	8,400	1,608.00	13,507,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	7,700	1,661.00	12,789,700	
ブリヂストン	38,800	3,590.00	139,292,000	
住友ゴム工業	13,100	927.00	12,143,700	
藤倉コンポジット	1,300	412.00	535,600	
オカモト	900	4,000.00	3,600,000	
フコク	700	690.00	483,000	
ニッタ	1,600	2,368.00	3,788,800	
住友理工	2,800	578.00	1,618,400	
三ツ星ベルト	1,900	1,712.00	3,252,800	
バンドー化学	2,500	634.00	1,585,000	
日東紡績	2,200	4,420.00	9,724,000	
ＡＧＣ	13,300	3,550.00	47,215,000	
日本板硝子	6,900	460.00	3,174,000	
石塚硝子	300	1,974.00	592,200	
日本山村硝子	600	902.00	541,200	
日本電気硝子	5,400	2,360.00	12,744,000	
オハラ	600	1,650.00	990,000	
住友大阪セメント	2,700	3,145.00	8,491,500	
太平洋セメント	9,200	2,746.00	25,263,200	
日本ヒューム	1,400	804.00	1,125,600	
日本コンクリート工業	3,000	333.00	999,000	
三谷セキサン	700	4,070.00	2,849,000	

アジアパイルホールディングス	2,000	478.00	956,000	
東海カーボン	14,200	1,204.00	17,096,800	
日本カーボン	800	4,035.00	3,228,000	
東洋炭素	800	1,876.00	1,500,800	
ノリタケカンパニーリミテド	800	3,005.00	2,404,000	
ＴＯＴＯ	10,400	5,870.00	61,048,000	
日本碍子	17,400	1,675.00	29,145,000	
日本特殊陶業	11,000	1,859.00	20,449,000	
ダントーホールディングス	1,000	489.00	489,000	
ＭＡＲＵＷＡ	600	11,390.00	6,834,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,389.00	955,600	
黒崎播磨	300	3,855.00	1,156,500	
ヨータイ	1,100	830.00	913,000	
イソライト工業	800	492.00	393,600	
東京窯業	1,900	368.00	699,200	
ニッカトー	600	807.00	484,200	
フジミインコーポレーテッド	1,300	3,850.00	5,005,000	
クニミネ工業	600	1,098.00	658,800	
エーアンドエーマテリアル	200	1,036.00	207,200	
ニチアス	4,000	2,471.00	9,884,000	
ニチハ	2,000	3,150.00	6,300,000	
日本製鉄	64,500	1,300.00	83,850,000	
神戸製鋼所	26,300	539.00	14,175,700	
合同製鐵	800	1,968.00	1,574,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	38,900	1,022.00	39,755,800	
東京製鐵	7,000	655.00	4,585,000	
共英製鋼	1,600	1,487.00	2,379,200	
大和工業	3,100	2,734.00	8,475,400	
東京鐵鋼	600	2,177.00	1,306,200	
大阪製鐵	800	1,292.00	1,033,600	
淀川製鋼所	2,000	2,027.00	4,054,000	
丸一鋼管	4,700	2,275.00	10,692,500	
モリ工業	400	2,767.00	1,106,800	
大同特殊鋼	2,400	4,535.00	10,884,000	
日本高周波鋼業	600	341.00	204,600	
日本冶金工業	1,200	1,810.00	2,172,000	
山陽特殊製鋼	1,000	1,310.00	1,310,000	
愛知製鋼	800	2,949.00	2,359,200	
日立金属	15,500	1,520.00	23,560,000	
日本金属	400	1,373.00	549,200	
大平洋金属	1,000	2,139.00	2,139,000	
新日本電工	9,400	310.00	2,914,000	

栗本鐵工所	700	1,703.00	1,192,100	
虹技	200	1,175.00	235,000	
日本鋳鉄管	200	1,318.00	263,600	
三菱製鋼	1,100	746.00	820,600	
日亜鋼業	2,200	303.00	666,600	
日本精線	200	3,810.00	762,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	693.00	485,100	
シンニッタン	2,500	189.00	472,500	
新家工業	400	1,242.00	496,800	
大紀アルミニウム工業所	2,400	767.00	1,840,800	
日本軽金属ホールディングス	3,600	1,953.00	7,030,800	
三井金属鉱業	3,900	3,560.00	13,884,000	
東邦亜鉛	700	2,351.00	1,645,700	
三菱マテリアル	9,500	2,120.00	20,140,000	
住友金属鉱山	18,400	4,316.00	79,414,400	
ＤＯＷＡホールディングス	3,700	3,665.00	13,560,500	
古河機械金属	2,600	1,257.00	3,268,200	
エス・サイエンス	6,900	42.00	289,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	980.00	1,470,000	
東邦チタニウム	2,600	823.00	2,139,800	
ＵＡＣＪ	2,200	1,894.00	4,166,800	
ＣＫサンエツ	300	3,825.00	1,147,500	
古河電気工業	4,500	2,899.00	13,045,500	
住友電気工業	53,900	1,279.50	68,965,050	
フジクラ	17,400	474.00	8,247,600	
昭和電線ホールディングス	1,700	1,822.00	3,097,400	
タツタ電線	2,900	743.00	2,154,700	
カナレ電気	300	1,821.00	546,300	
平河ヒューテック	700	1,173.00	821,100	
リョービ	1,800	1,351.00	2,431,800	
アーレスティ	2,000	379.00	758,000	
アサヒホールディングス	2,500	3,320.00	8,300,000	
稲葉製作所	800	1,387.00	1,109,600	
宮地エンジニアリンググループ	400	2,360.00	944,000	
トーカロ	4,000	1,387.00	5,548,000	
アルファＣｏ	500	979.00	489,500	
ＳＵＭＣＯ	18,400	2,273.00	41,823,200	
川田テクノロジーズ	300	4,335.00	1,300,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	500	4,920.00	2,460,000	
ジェイテックコーポレーション	100	3,790.00	379,000	
信和	900	694.00	624,600	
東洋製罐グループホールディングス	9,200	1,130.00	10,396,000	

ホッカンホールディングス	800	1,442.00	1,153,600	
コロナ	800	974.00	779,200	
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,134.00	5,761,800	
駒井ハルテック	300	1,704.00	511,200	
高田機工	100	2,552.00	255,200	
三和ホールディングス	13,600	1,193.00	16,224,800	
文化シヤッター	4,200	948.00	3,981,600	
三協立山	1,800	775.00	1,395,000	
アルインコ	1,000	923.00	923,000	
東洋シヤッター	300	743.00	222,900	
ＬＩＸＩＬ	21,200	2,259.00	47,890,800	
日本フイルコン	1,000	544.00	544,000	
ノーリツ	3,000	1,670.00	5,010,000	
長府製作所	1,500	2,100.00	3,150,000	
リンナイ	2,800	11,980.00	33,544,000	
ダイニチ工業	800	907.00	725,600	
日東精工	1,800	444.00	799,200	
三洋工業	200	1,864.00	372,800	
岡部	3,000	790.00	2,370,000	
ジーテクト	1,800	1,540.00	2,772,000	
東プレ	2,700	1,545.00	4,171,500	
高周波熱錬	2,700	481.00	1,298,700	
東京製綱	1,100	861.00	947,100	
サンコール	1,100	449.00	493,900	
モリテック　スチール	1,200	514.00	616,800	
パイオラックス	2,100	1,691.00	3,551,100	
エイチワン	1,300	892.00	1,159,600	
日本発條	15,400	710.00	10,934,000	
中央発條	200	3,030.00	606,000	
アドバネクス	200	1,290.00	258,000	
立川ブラインド工業	600	1,390.00	834,000	
三益半導体工業	1,100	2,767.00	3,043,700	
日本ドライケミカル	300	1,545.00	463,500	
日本製鋼所	4,300	2,873.00	12,353,900	
三浦工業	6,200	5,560.00	34,472,000	
タクマ	4,800	1,825.00	8,760,000	
ツガミ	2,900	1,622.00	4,703,800	
オークマ	1,700	5,960.00	10,132,000	
芝浦機械	1,600	2,260.00	3,616,000	
アマダ	17,800	1,080.00	19,224,000	
アイダエンジニアリング	3,800	979.00	3,720,200	
滝澤鉄工所	400	1,003.00	401,200	

ＦＵＪＩ	6,200	2,663.00	16,510,600	
牧野フライス製作所	1,700	4,035.00	6,859,500	
オーエスジー	7,100	1,869.00	13,269,900	
ダイジェット工業	100	1,425.00	142,500	
旭ダイヤモンド工業	3,800	449.00	1,706,200	
ＤＭＧ森精機	9,100	1,660.00	15,106,000	
ソディック	3,100	870.00	2,697,000	
ディスコ	2,000	34,400.00	68,800,000	
日東工器	800	1,828.00	1,462,400	
日進工具	600	2,667.00	1,600,200	
パンチ工業	1,300	467.00	607,100	
冨士ダイス	700	662.00	463,400	
豊和工業	800	886.00	708,800	
ＯＫＫ	400	463.00	185,200	
東洋機械金属	1,100	437.00	480,700	
津田駒工業	200	921.00	184,200	
島精機製作所	2,200	1,776.00	3,907,200	
オプトラン	1,800	2,303.00	4,145,400	
ＮＣホールディングス	400	559.00	223,600	
イワキポンプ	900	837.00	753,300	
フリュー	1,400	1,105.00	1,547,000	
ヤマシンフィルタ	3,300	1,100.00	3,630,000	
日阪製作所	1,700	845.00	1,436,500	
やまびこ	2,800	1,353.00	3,788,400	
平田機工	700	8,360.00	5,852,000	
ペガサスミシン製造	1,400	348.00	487,200	
マルマエ	500	1,306.00	653,000	
タツモ	600	1,512.00	907,200	
ナブテスコ	8,500	4,365.00	37,102,500	
三井海洋開発	1,500	1,889.00	2,833,500	
レオン自動機	1,400	1,133.00	1,586,200	
ＳＭＣ	4,600	64,770.00	297,942,000	
ホソカワミクロン	500	6,700.00	3,350,000	
ユニオンツール	500	3,100.00	1,550,000	
オイレス工業	1,900	1,663.00	3,159,700	
日精エー・エス・ビー機械	400	5,860.00	2,344,000	
サトーホールディングス	2,000	2,224.00	4,448,000	
技研製作所	1,300	4,320.00	5,616,000	
日本エアーテック	500	1,650.00	825,000	
カワタ	400	1,029.00	411,600	
日精樹脂工業	1,200	889.00	1,066,800	
オカダアイヨン	400	1,082.00	432,800	

ワイエイシイホールディングス	600	1,143.00	685,800	
小松製作所	66,000	2,781.00	183,546,000	
住友重機械工業	8,300	2,469.00	20,492,700	
日立建機	5,800	2,892.00	16,773,600	
日工	1,900	688.00	1,307,200	
巴工業	600	2,019.00	1,211,400	
井関農機	1,500	1,409.00	2,113,500	
ＴＯＷＡ	1,500	1,951.00	2,926,500	
丸山製作所	300	1,521.00	456,300	
北川鉄工所	600	1,420.00	852,000	
ローツェ	600	5,680.00	3,408,000	
タカキタ	500	738.00	369,000	
クボタ	76,500	2,190.50	167,573,250	
荏原実業	400	3,980.00	1,592,000	
三菱化工機	500	2,839.00	1,419,500	
月島機械	2,700	1,354.00	3,655,800	
帝国電機製作所	1,200	1,287.00	1,544,400	
新東工業	3,400	785.00	2,669,000	
澁谷工業	1,300	3,600.00	4,680,000	
アイチ　コーポレーション	2,500	945.00	2,362,500	
小森コーポレーション	3,600	745.00	2,682,000	
鶴見製作所	1,100	1,806.00	1,986,600	
住友精密工業	200	2,081.00	416,200	
酒井重工業	300	2,378.00	713,400	
荏原製作所	6,000	3,420.00	20,520,000	
石井鐵工所	200	2,841.00	568,200	
酉島製作所	1,500	876.00	1,314,000	
北越工業	1,500	1,064.00	1,596,000	
ダイキン工業	18,600	22,550.00	419,430,000	
オルガノ	500	6,180.00	3,090,000	
トーヨーカネツ	600	2,139.00	1,283,400	
栗田工業	7,900	3,985.00	31,481,500	
椿本チエイン	2,100	2,819.00	5,919,900	
大同工業	700	735.00	514,500	
木村化工機	1,200	614.00	736,800	
アネスト岩田	2,300	1,049.00	2,412,700	
ダイフク	7,400	12,300.00	91,020,000	
サムコ	400	3,045.00	1,218,000	
加藤製作所	800	1,030.00	824,000	
油研工業	300	1,536.00	460,800	
タダノ	7,000	893.00	6,251,000	
フジテック	5,300	2,233.00	11,834,900	

ＣＫＤ	4,000	2,243.00	8,972,000	
キトー	1,100	1,609.00	1,769,900	
平和	4,000	1,461.00	5,844,000	
理想科学工業	1,300	1,339.00	1,740,700	
ＳＡＮＫＹＯ	3,200	2,675.00	8,560,000	
日本金銭機械	1,600	533.00	852,800	
マースグループホールディングス	900	1,590.00	1,431,000	
フクシマガリレイ	900	4,540.00	4,086,000	
オーイズミ	500	392.00	196,000	
ダイコク電機	700	866.00	606,200	
竹内製作所	2,400	2,436.00	5,846,400	
アマノ	3,800	2,672.00	10,153,600	
ＪＵＫＩ	2,000	538.00	1,076,000	
サンデンホールディングス	1,800	371.00	667,800	
蛇の目ミシン工業	1,300	818.00	1,063,400	
マックス	2,200	1,414.00	3,110,800	
グローリー	3,700	2,108.00	7,799,600	
新晃工業	1,400	1,727.00	2,417,800	
大和冷機工業	2,300	1,126.00	2,589,800	
セガサミーホールディングス	14,400	1,558.00	22,435,200	
日本ピストンリング	500	1,048.00	524,000	
リケン	700	2,278.00	1,594,600	
ＴＰＲ	1,900	1,506.00	2,861,400	
ツバキ・ナカシマ	2,700	963.00	2,600,100	
ホシザキ	4,600	9,950.00	45,770,000	
大豊工業	1,200	826.00	991,200	
日本精工	27,400	917.00	25,125,800	
ＮＴＮ	33,500	257.00	8,609,500	
ジェイテクト	13,900	817.00	11,356,300	
不二越	1,300	4,430.00	5,759,000	
日本トムソン	4,200	380.00	1,596,000	
ＴＨＫ	9,100	3,320.00	30,212,000	
ユーシン精機	1,100	901.00	991,100	
前澤給装工業	500	2,348.00	1,174,000	
イーグル工業	1,800	1,010.00	1,818,000	
前澤工業	1,000	445.00	445,000	
日本ピラー工業	1,500	1,585.00	2,377,500	
キッツ	5,400	646.00	3,488,400	
マキタ	19,000	5,270.00	100,130,000	
日立造船	11,400	443.00	5,050,200	
三菱重工業	24,300	2,983.00	72,486,900	
ＩＨＩ	10,500	2,036.00	21,378,000	

スター精密	2,200	1,662.00	3,656,400	
日清紡ホールディングス	8,900	802.00	7,137,800	
イビデン	8,900	5,020.00	44,678,000	
コニカミノルタ	32,000	398.00	12,736,000	
ブラザー工業	17,800	2,096.00	37,308,800	
ミネベアミツミ	27,100	2,172.00	58,861,200	
日立製作所	70,000	4,168.00	291,760,000	
三菱電機	145,700	1,535.50	223,722,350	
富士電機	8,800	3,650.00	32,120,000	
東洋電機製造	500	1,176.00	588,000	
安川電機	15,700	4,755.00	74,653,500	
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,504.00	2,857,600	
明電舎	2,700	2,158.00	5,826,600	
オリジン	400	1,339.00	535,600	
山洋電気	700	5,330.00	3,731,000	
デンヨー	1,300	2,104.00	2,735,200	
東芝テック	1,800	3,860.00	6,948,000	
芝浦メカトロニクス	300	4,430.00	1,329,000	
マブチモーター	4,000	4,515.00	18,060,000	
日本電産	35,100	12,620.00	442,962,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	458.00	458,000	
トレックス・セミコンダクター	900	1,382.00	1,243,800	
東光高岳	800	1,767.00	1,413,600	
ダイヘン	1,600	4,980.00	7,968,000	
ヤーマン	2,400	2,085.00	5,004,000	
ＪＶＣケンウッド	12,100	151.00	1,827,100	
ミマキエンジニアリング	1,300	531.00	690,300	
Ｉ－ＰＥＸ	700	2,076.00	1,453,200	
日新電機	3,400	1,151.00	3,913,400	
大崎電気工業	3,000	575.00	1,725,000	
オムロン	13,100	9,040.00	118,424,000	
日東工業	2,200	2,006.00	4,413,200	
ＩＤＥＣ	2,100	1,880.00	3,948,000	
正興電機製作所	400	2,143.00	857,200	
不二電機工業	200	1,299.00	259,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	4,900	2,765.00	13,548,500	
サクサホールディングス	300	1,420.00	426,000	
メルコホールディングス	500	3,355.00	1,677,500	
テクノメディカ	300	1,482.00	444,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	1,221.00	488,400	
日本電気	17,700	5,380.00	95,226,000	
富士通	14,100	13,600.00	191,760,000	

沖電気工業	5,900	934.00	5,510,600	
岩崎通信機	600	853.00	511,800	
電気興業	700	2,782.00	1,947,400	
サンケン電気	1,600	4,145.00	6,632,000	
ナカヨ	300	1,506.00	451,800	
アイホン	800	1,637.00	1,309,600	
ルネサスエレクトロニクス	62,500	1,057.00	66,062,500	
セイコーエプソン	18,100	1,631.00	29,521,100	
ワコム	9,800	948.00	9,290,400	
アルバック	2,700	4,425.00	11,947,500	
アクセル	600	772.00	463,200	
ＥＩＺＯ	1,100	3,770.00	4,147,000	
日本信号	3,800	975.00	3,705,000	
京三製作所	3,500	441.00	1,543,500	
能美防災	1,900	2,358.00	4,480,200	
ホーチキ	1,100	1,301.00	1,431,100	
星和電機	800	715.00	572,000	
エレコム	1,700	4,930.00	8,381,000	
パナソニック	166,500	1,161.00	193,306,500	
シャープ	16,900	1,458.00	24,640,200	
アンリツ	9,400	2,348.00	22,071,200	
富士通ゼネラル	4,000	2,824.00	11,296,000	
ソニー	91,300	9,730.00	888,349,000	
ＴＤＫ	7,000	14,210.00	99,470,000	
帝国通信工業	700	1,164.00	814,800	
タムラ製作所	5,000	588.00	2,940,000	
アルプスアルパイン	12,900	1,288.00	16,615,200	
池上通信機	500	945.00	472,500	
鈴木	700	1,132.00	792,400	
日本トリム	200	4,050.00	810,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	1,905.00	1,714,500	
フォスター電機	1,600	1,238.00	1,980,800	
ＳＭＫ	400	3,075.00	1,230,000	
ヨコオ	1,000	2,669.00	2,669,000	
ホシデン	4,000	977.00	3,908,000	
ヒロセ電機	2,200	15,150.00	33,330,000	
日本航空電子工業	3,400	1,603.00	5,450,200	
ＴＯＡ	1,600	890.00	1,424,000	
マクセルホールディングス	3,200	1,322.00	4,230,400	
古野電気	1,900	1,194.00	2,268,600	
ユニデンホールディングス	400	2,277.00	910,800	
スミダコーポレーション	1,300	1,096.00	1,424,800	

アイコム	800	2,709.00	2,167,200	
リオン	600	3,320.00	1,992,000	
本多通信工業	1,300	499.00	648,700	
船井電機	1,500	448.00	672,000	
横河電機	13,400	1,936.00	25,942,400	
新電元工業	500	2,596.00	1,298,000	
アズビル	9,200	5,190.00	47,748,000	
東亜ディーケーケー	700	900.00	630,000	
日本光電工業	6,000	3,455.00	20,730,000	
チノー	500	1,428.00	714,000	
共和電業	1,600	403.00	644,800	
日本電子材料	600	1,738.00	1,042,800	
堀場製作所	2,900	5,840.00	16,936,000	
アドバンテスト	10,800	7,420.00	80,136,000	
小野測器	600	534.00	320,400	
エスペック	1,300	1,993.00	2,590,900	
キーエンス	13,200	51,700.00	682,440,000	
日置電機	700	4,175.00	2,922,500	
シスメックス	10,400	11,580.00	120,432,000	
日本マイクロニクス	2,600	1,205.00	3,133,000	
メガチップス	1,400	3,070.00	4,298,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	900	3,965.00	3,568,500	
澤藤電機	200	2,283.00	456,600	
原田工業	700	872.00	610,400	
コーセル	2,000	1,249.00	2,498,000	
イリソ電子工業	1,200	4,785.00	5,742,000	
オプテックスグループ	2,400	1,981.00	4,754,400	
千代田インテグレ	600	1,654.00	992,400	
アイ・オー・データ機器	500	1,092.00	546,000	
レーザーテック	6,400	11,330.00	72,512,000	
スタンレー電気	10,200	3,430.00	34,986,000	
岩崎電気	600	1,437.00	862,200	
ウシオ電機	8,100	1,303.00	10,554,300	
岡谷電機産業	1,300	409.00	531,700	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,500	302.00	453,000	
エノモト	400	1,427.00	570,800	
日本セラミック	1,500	2,980.00	4,470,000	
遠藤照明	800	543.00	434,400	
古河電池	1,000	1,488.00	1,488,000	
双信電機	700	454.00	317,800	
山一電機	1,000	1,600.00	1,600,000	
図研	1,000	2,908.00	2,908,000	

日本電子	2,900	4,590.00	13,311,000	
カシオ計算機	12,900	1,915.00	24,703,500	
ファナック	13,700	26,150.00	358,255,000	
日本シイエムケイ	3,500	419.00	1,466,500	
エンプラス	800	4,250.00	3,400,000	
大真空	500	2,535.00	1,267,500	
ローム	6,100	9,600.00	58,560,000	
浜松ホトニクス	10,500	5,970.00	62,685,000	
三井ハイテック	1,600	4,005.00	6,408,000	
新光電気工業	4,900	2,319.00	11,363,100	
京セラ	20,500	6,300.00	129,150,000	
太陽誘電	6,500	4,620.00	30,030,000	
村田製作所	42,800	8,898.00	380,834,400	
双葉電子工業	2,400	943.00	2,263,200	
北陸電気工業	600	932.00	559,200	
ニチコン	5,000	1,249.00	6,245,000	
日本ケミコン	1,200	1,949.00	2,338,800	
ＫＯＡ	2,200	1,520.00	3,344,000	
市光工業	2,300	644.00	1,481,200	
小糸製作所	8,700	7,100.00	61,770,000	
ミツバ	2,700	508.00	1,371,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,500	7,020.00	17,550,000	
キヤノン電子	1,400	1,517.00	2,123,800	
キヤノン	72,400	2,050.50	148,456,200	代用有価証券 10,000株
リコー	37,100	709.00	26,303,900	
象印マホービン	4,000	1,869.00	7,476,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,469.00	293,800	
東京エレクトロン	9,200	36,450.00	335,340,000	
トヨタ紡織	4,200	1,764.00	7,408,800	
芦森工業	300	1,018.00	305,400	
ユニプレス	2,800	1,048.00	2,934,400	
豊田自動織機	11,800	8,120.00	95,816,000	
モリタホールディングス	2,500	1,718.00	4,295,000	
三櫻工業	1,900	915.00	1,738,500	
デンソー	32,100	5,800.00	186,180,000	
東海理化電機製作所	3,800	1,752.00	6,657,600	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	5,300	373.00	1,976,900	
川崎重工業	11,300	2,104.00	23,775,200	
名村造船所	4,900	171.00	837,900	
サノヤスホールディングス	1,700	174.00	295,800	
日本車輌製造	500	2,460.00	1,230,000	
三菱ロジスネクスト	1,900	1,248.00	2,371,200	

近畿車輛	200	1,309.00	261,800	
日産自動車	171,700	566.80	97,319,560	
いすゞ自動車	42,200	1,054.00	44,478,800	
トヨタ自動車	162,500	7,905.00	1,284,562,500	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,200	1,039.00	18,909,800	
三菱自動車工業	53,700	208.00	11,169,600	
エフテック	1,100	665.00	731,500	
レシップホールディングス	600	550.00	330,000	
GMB	300	680.00	204,000	
ファルテック	300	712.00	213,600	
武蔵精密工業	3,200	1,626.00	5,203,200	
日産車体	2,800	937.00	2,623,600	
新明和工業	3,900	937.00	3,654,300	
極東開発工業	2,700	1,466.00	3,958,200	
トピー工業	1,200	1,231.00	1,477,200	
ティラド	500	1,366.00	683,000	
タチエス	2,400	1,256.00	3,014,400	
ＮＯＫ	7,800	1,179.00	9,196,200	
フタバ産業	4,100	546.00	2,238,600	
ＫＹＢ	1,600	2,620.00	4,192,000	
大同メタル工業	2,800	491.00	1,374,800	
プレス工業	7,300	327.00	2,387,100	
ミクニ	1,900	296.00	562,400	
太平洋工業	3,100	1,101.00	3,413,100	
河西工業	2,000	412.00	824,000	
アイシン精機	12,000	3,130.00	37,560,000	
マツダ	42,800	679.00	29,061,200	
今仙電機製作所	1,300	821.00	1,067,300	
本田技研工業	114,700	3,061.00	351,096,700	
スズキ	28,900	5,263.00	152,100,700	
ＳＵＢＡＲＵ	45,200	2,175.00	98,310,000	
安永	700	1,383.00	968,100	
ヤマハ発動機	20,600	2,127.00	43,816,200	
ＴＢＫ	1,700	465.00	790,500	
エクセディ	2,000	1,345.00	2,690,000	
豊田合成	4,700	3,030.00	14,241,000	
愛三工業	2,300	524.00	1,205,200	
盟和産業	200	879.00	175,800	
日本プラスト	1,200	548.00	657,600	
ヨロズ	1,400	1,198.00	1,677,200	
エフ・シー・シー	2,400	2,034.00	4,881,600	
シマノ	5,500	24,185.00	133,017,500	

テイ・エス　テック	3,400	3,260.00	11,084,000	
ジャムコ	700	671.00	469,700	
テルモ	41,200	3,990.00	164,388,000	
クリエートメディック	500	1,000.00	500,000	
日機装	4,700	1,056.00	4,963,200	
日本エム・ディ・エム	900	2,371.00	2,133,900	
島津製作所	17,400	3,755.00	65,337,000	
ＪＭＳ	1,200	945.00	1,134,000	
長野計器	1,100	919.00	1,010,900	
ブイ・テクノロジー	700	5,740.00	4,018,000	
東京計器	900	1,009.00	908,100	
愛知時計電機	200	4,410.00	882,000	
インターアクション	800	1,970.00	1,576,000	
オーバル	1,200	332.00	398,400	
東京精密	2,600	4,955.00	12,883,000	
マニー	5,800	2,627.00	15,236,600	
ニコン	22,200	686.00	15,229,200	
トプコン	7,300	1,291.00	9,424,300	
オリンパス	80,600	2,156.50	173,813,900	
理研計器	1,300	2,972.00	3,863,600	
タムロン	1,200	1,772.00	2,126,400	
ＨＯＹＡ	28,900	13,235.00	382,491,500	
シード	700	608.00	425,600	
ノーリツ鋼機	1,000	2,515.00	2,515,000	
エー・アンド・デイ	1,300	1,041.00	1,353,300	
朝日インテック	16,500	3,545.00	58,492,500	
シチズン時計	16,900	296.00	5,002,400	
リズム	400	652.00	260,800	
大研医器	1,000	534.00	534,000	
メニコン	2,100	6,320.00	13,272,000	
シンシア	200	395.00	79,000	
松風	600	1,738.00	1,042,800	
セイコーホールディングス	2,100	1,389.00	2,916,900	
ニプロ	10,000	1,243.00	12,430,000	
中本パックス	400	1,596.00	638,400	
スノーピーク	900	1,815.00	1,633,500	
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,470.00	6,705,000	
トランザクション	800	937.00	749,600	
粧美堂	500	393.00	196,500	
ニホンフラッシュ	1,400	1,322.00	1,850,800	
前田工繊	1,600	2,602.00	4,163,200	
永大産業	1,800	292.00	525,600	

アートネイチャー	1,600	644.00	1,030,400	
バンダイナムコホールディングス	15,100	9,501.00	143,465,100	
アイフィスジャパン	300	809.00	242,700	
共立印刷	1,900	124.00	235,600	
ＳＨＯＥＩ	1,300	3,610.00	4,693,000	
フランスベッドホールディングス	2,000	901.00	1,802,000	
パイロットコーポレーション	2,600	2,970.00	7,722,000	
萩原工業	800	1,520.00	1,216,000	
トッパン・フォームズ	3,200	1,049.00	3,356,800	
フジシールインターナショナル	3,300	2,043.00	6,741,900	
タカラトミー	6,500	941.00	6,116,500	
廣済堂	1,100	685.00	753,500	
エステールホールディングス	300	622.00	186,600	
タカノ	700	603.00	422,100	
プロネクサス	1,300	1,045.00	1,358,500	
ホクシン	1,300	109.00	141,700	
ウッドワン	500	1,150.00	575,000	
大建工業	1,000	1,885.00	1,885,000	
凸版印刷	20,500	1,508.00	30,914,000	
大日本印刷	19,100	1,905.00	36,385,500	
共同印刷	500	3,185.00	1,592,500	
ＮＩＳＳＨＡ	3,000	1,496.00	4,488,000	
光村印刷	200	1,802.00	360,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	700	1,957.00	1,369,900	
アシックス	12,900	2,058.00	26,548,200	
ツツミ	500	2,095.00	1,047,500	
小松ウオール工業	500	1,740.00	870,000	
ヤマハ	8,700	6,070.00	52,809,000	
河合楽器製作所	400	2,939.00	1,175,600	
クリナップ	1,500	490.00	735,000	
ピジョン	9,300	4,565.00	42,454,500	
オリバー	300	2,313.00	693,900	
兼松サステック	100	1,619.00	161,900	
キングジム	1,200	912.00	1,094,400	
リンテック	3,500	2,260.00	7,910,000	
イトーキ	3,000	359.00	1,077,000	
任天堂	8,900	61,620.00	548,418,000	
三菱鉛筆	2,400	1,469.00	3,525,600	
タカラスタンダード	3,000	1,493.00	4,479,000	
コクヨ	7,000	1,462.00	10,234,000	
ナカバヤシ	1,600	623.00	996,800	
グローブライド	700	4,300.00	3,010,000	

オカムラ	5,100	949.00	4,839,900	
美津濃	1,400	1,992.00	2,788,800	
東京電力ホールディングス	116,200	272.00	31,606,400	
中部電力	44,500	1,224.50	54,490,250	
関西電力	55,200	943.60	52,086,720	
中国電力	21,000	1,233.00	25,893,000	
北陸電力	13,300	671.00	8,924,300	
東北電力	36,400	840.00	30,576,000	
四国電力	13,100	681.00	8,921,100	
九州電力	30,000	867.00	26,010,000	
北海道電力	13,600	380.00	5,168,000	
沖縄電力	2,800	1,372.00	3,841,600	
電源開発	11,600	1,365.00	15,834,000	
エフオン	800	1,145.00	916,000	
イーレックス	2,100	1,937.00	4,067,700	
レノバ	2,400	3,125.00	7,500,000	
東京瓦斯	28,000	2,265.50	63,434,000	
大阪瓦斯	28,300	2,034.00	57,562,200	
東邦瓦斯	7,200	6,450.00	46,440,000	
北海道瓦斯	800	1,519.00	1,215,200	
広島ガス	3,000	367.00	1,101,000	
西部瓦斯	1,600	3,315.00	5,304,000	
静岡ガス	4,100	1,016.00	4,165,600	
メタウォーター	1,400	2,303.00	3,224,200	
ＳＢＳホールディングス	1,100	2,527.00	2,779,700	
東武鉄道	15,200	3,115.00	47,348,000	
相鉄ホールディングス	4,700	2,636.00	12,389,200	
東急	36,800	1,292.00	47,545,600	
京浜急行電鉄	18,700	1,789.00	33,454,300	
小田急電鉄	21,700	3,300.00	71,610,000	
京王電鉄	7,600	7,790.00	59,204,000	
京成電鉄	10,100	3,725.00	37,622,500	
富士急行	2,000	4,570.00	9,140,000	
東日本旅客鉄道	25,600	6,965.00	178,304,000	
西日本旅客鉄道	13,000	5,417.00	70,421,000	
東海旅客鉄道	12,100	14,465.00	175,026,500	
西武ホールディングス	19,000	1,064.00	20,216,000	
鴻池運輸	2,400	1,010.00	2,424,000	
西日本鉄道	4,000	3,020.00	12,080,000	
ハマキョウレックス	1,100	2,868.00	3,154,800	
サカイ引越センター	800	5,350.00	4,280,000	
近鉄グループホールディングス	13,800	4,660.00	64,308,000	

阪急阪神ホールディングス	18,400	3,460.00	63,664,000	
南海電気鉄道	6,500	2,662.00	17,303,000	
京阪ホールディングス	6,100	4,975.00	30,347,500	
神戸電鉄	300	3,690.00	1,107,000	
名古屋鉄道	11,400	2,768.00	31,555,200	
山陽電気鉄道	1,000	1,987.00	1,987,000	
日本通運	4,800	7,010.00	33,648,000	
ヤマトホールディングス	22,900	2,578.00	59,036,200	
山九	3,800	4,015.00	15,257,000	
丸運	900	260.00	234,000	
丸全昭和運輸	1,100	3,410.00	3,751,000	
センコーグループホールディングス	7,600	1,023.00	7,774,800	
トナミホールディングス	300	6,030.00	1,809,000	
ニッコンホールディングス	4,900	2,084.00	10,211,600	
日本石油輸送	200	2,634.00	526,800	
福山通運	1,800	4,445.00	8,001,000	
セイノーホールディングス	10,400	1,438.00	14,955,200	
エスライン	500	910.00	455,000	
神奈川中央交通	300	4,050.00	1,215,000	
日立物流	2,500	3,035.00	7,587,500	
丸和運輸機関	1,500	4,355.00	6,532,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,400	1,861.00	2,605,400	
九州旅客鉄道	12,100	2,284.00	27,636,400	
ＳＧホールディングス	29,000	2,861.00	82,969,000	
日本郵船	11,500	2,290.00	26,335,000	
商船三井	8,700	3,025.00	26,317,500	
川崎汽船	4,200	1,949.00	8,185,800	
ＮＳユナイテッド海運	800	1,398.00	1,118,400	
明治海運	1,500	409.00	613,500	
飯野海運	6,600	427.00	2,818,200	
共栄タンカー	200	847.00	169,400	
乾汽船	800	948.00	758,400	
日本航空	31,000	1,944.00	60,264,000	
ＡＮＡホールディングス	34,400	2,275.50	78,277,200	
パスコ	300	1,406.00	421,800	
トランコム	400	8,710.00	3,484,000	
日新	1,200	1,221.00	1,465,200	
三菱倉庫	4,400	2,940.00	12,936,000	
三井倉庫ホールディングス	1,500	2,276.00	3,414,000	
住友倉庫	4,900	1,359.00	6,659,100	
澁澤倉庫	800	2,368.00	1,894,400	
東陽倉庫	2,500	327.00	817,500	

日本トランスシティ	3,100	586.00	1,816,600	
ケイヒン	300	1,365.00	409,500	
中央倉庫	800	1,162.00	929,600	
川西倉庫	200	1,114.00	222,800	
安田倉庫	1,100	986.00	1,084,600	
ファイズホールディングス	300	1,039.00	311,700	
東洋埠頭	400	1,445.00	578,000	
宇徳	1,200	487.00	584,400	
上組	7,700	1,884.00	14,506,800	
サンリツ	300	699.00	209,700	
キムラユニティー	400	1,057.00	422,800	
キユーソー流通システム	400	1,688.00	675,200	
近鉄エクスプレス	2,900	2,269.00	6,580,100	
東海運	800	322.00	257,600	
エーアイテイー	900	1,009.00	908,100	
内外トランスライン	500	1,378.00	689,000	
日本コンセプト	400	1,757.00	702,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	4,100	1,776.00	7,281,600	
クロスキャット	400	1,219.00	487,600	
システナ	5,100	2,127.00	10,847,700	
デジタルアーツ	700	8,520.00	5,964,000	
日鉄ソリューションズ	2,100	2,955.00	6,205,500	
キューブシステム	800	1,278.00	1,022,400	
エイジア	300	2,047.00	614,100	
コア	600	1,448.00	868,800	
ラクーンホールディングス	700	1,761.00	1,232,700	
ソリトンシステムズ	700	1,895.00	1,326,500	
ソフトクリエイトホールディングス	600	2,834.00	1,700,400	
ＴＩＳ	14,300	2,067.00	29,558,100	
ＪＮＳホールディングス	600	586.00	351,600	
電算システム	500	3,260.00	1,630,000	
グリー	8,800	606.00	5,332,800	
コーエーテクモホールディングス	2,900	6,370.00	18,473,000	
三菱総合研究所	600	4,155.00	2,493,000	
ボルテージ	400	562.00	224,800	
電算	200	2,478.00	495,600	
ＡＧＳ	800	863.00	690,400	
ファインデックス	1,200	1,268.00	1,521,600	
ブレインパッド	400	4,355.00	1,742,000	
ＫＬａｂ	2,700	1,001.00	2,702,700	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,700	1,065.00	1,810,500	
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,699.00	539,800	

ネクソン	36,100	3,090.00	111,549,000	
アイスタイル	4,200	404.00	1,696,800	
エムアップホールディングス	400	2,647.00	1,058,800	
エイチーム	1,000	1,165.00	1,165,000	
エニグモ	1,400	1,370.00	1,918,000	
テクノスジャパン	1,100	710.00	781,000	
コロプラ	4,700	975.00	4,582,500	
ブロードリーフ	7,100	724.00	5,140,400	
クロス・マーケティンググループ	700	381.00	266,700	
デジタルハーツホールディングス	800	1,240.00	992,000	
システム情報	1,100	1,106.00	1,216,600	
メディアドゥ	500	6,990.00	3,495,000	
じげん	3,600	363.00	1,306,800	
ブイキューブ	800	3,200.00	2,560,000	
エンカレッジ・テクノロジ	300	836.00	250,800	
サイバーリンクス	200	6,110.00	1,222,000	
フィックスターズ	1,500	958.00	1,437,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,250.00	750,000	
オプティム	800	2,869.00	2,295,200	
セレス	500	2,677.00	1,338,500	
ＳＨＩＦＴ	600	13,670.00	8,202,000	
ティーガイア	1,300	1,850.00	2,405,000	
セック	200	3,005.00	601,000	
日本アジアグループ	1,600	747.00	1,195,200	
テクマトリックス	2,000	2,042.00	4,084,000	
プロシップ	400	1,440.00	576,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,500	2,670.00	9,345,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,000	13,890.00	41,670,000	
ザッパラス	700	488.00	341,600	
システムリサーチ	400	1,652.00	660,800	
インターネットイニシアティブ	2,100	4,165.00	8,746,500	
さくらインターネット	1,600	701.00	1,121,600	
ヴィンクス	400	1,203.00	481,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	9,420.00	2,826,000	
ＳＲＡホールディングス	800	2,517.00	2,013,600	
システムインテグレータ	500	654.00	327,000	
朝日ネット	1,000	869.00	869,000	
ｅＢＡＳＥ	1,700	1,065.00	1,810,500	
アバント	1,400	1,154.00	1,615,600	
アドソル日進	500	3,115.00	1,557,500	
フリービット	800	1,010.00	808,000	
コムチュア	1,600	2,998.00	4,796,800	

サイバーコム	300	1,755.00	526,500	
アステリア	900	1,049.00	944,100	
アイル	800	1,603.00	1,282,400	
マークラインズ	600	2,770.00	1,662,000	
メディカル・データ・ビジョン	1,600	2,606.00	4,169,600	
ｇｕｍｉ	1,900	840.00	1,596,000	
ショーケース	300	1,072.00	321,600	
モバイルファクトリー	400	988.00	395,200	
テラスカイ	500	4,225.00	2,112,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,551.00	930,600	
ＰＣＩホールディングス	600	1,378.00	826,800	
パイプドＨＤ	200	1,649.00	329,800	
アイビーシー	200	1,165.00	233,000	
ネオジャパン	300	2,649.00	794,700	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	300	3,155.00	946,500	
ランドコンピュータ	200	1,136.00	227,200	
ダブルスタンダード	200	4,110.00	822,000	
オープンドア	700	1,321.00	924,700	
マイネット	500	886.00	443,000	
アカツキ	500	4,400.00	2,200,000	
ベネフィットジャパン	100	1,713.00	171,300	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	300	3,210.00	963,000	
ＬＩＮＥ	3,300	5,360.00	17,688,000	
カナミックネットワーク	1,300	768.00	998,400	
ノムラシステムコーポレーション	700	369.00	258,300	
チェンジ	1,000	7,710.00	7,710,000	
シンクロ・フード	700	308.00	215,600	
オークネット	800	1,420.00	1,136,000	
セグエグループ	400	1,377.00	550,800	
エイトレッド	300	2,614.00	784,200	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,600	424.00	678,400	
マクロミル	3,000	699.00	2,097,000	
ビーグリー	300	1,848.00	554,400	
オロ	500	4,350.00	2,175,000	
ユーザーローカル	200	3,945.00	789,000	
テモナ	300	1,142.00	342,600	
サインポスト	300	897.00	269,100	
ソルクシーズ	600	1,007.00	604,200	
フェイス	600	775.00	465,000	
プロトコーポレーション	1,300	1,026.00	1,333,800	
ハイマックス	400	1,137.00	454,800	
野村総合研究所	20,300	3,380.00	68,614,000	

サイバネットシステム	1,000	996.00	996,000	
ＣＥホールディングス	800	565.00	452,000	
日本システム技術	300	1,512.00	453,600	
インテージホールディングス	1,900	1,143.00	2,171,700	
東邦システムサイエンス	400	921.00	368,400	
ソースネクスト	7,000	301.00	2,107,000	
インフォコム	1,600	3,285.00	5,256,000	
ＨＥＲＯＺ	200	2,822.00	564,400	
ラクスル	1,200	4,635.00	5,562,000	
ＦＩＧ	1,700	281.00	477,700	
システムサポート	300	1,687.00	506,100	
イーソル	800	1,328.00	1,062,400	
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,535.00	2,456,000	
ＥｄｕＬａｂ	100	6,970.00	697,000	
東海ソフト	100	1,128.00	112,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,471.00	441,300	
東名	100	1,188.00	118,800	
ヴィッツ	100	2,613.00	261,300	
トビラシステムズ	100	1,414.00	141,400	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	100	1,386.00	138,600	
フォーカスシステムズ	900	919.00	827,100	
クレスコ	900	1,340.00	1,206,000	
フジ・メディア・ホールディングス	13,800	1,131.00	15,607,800	
オービック	5,000	21,060.00	105,300,000	
ジャストシステム	2,300	7,140.00	16,422,000	
ＴＤＣソフト	1,300	1,006.00	1,307,800	
Ｚホールディングス	196,300	613.40	120,410,420	
トレンドマイクロ	7,600	5,740.00	43,624,000	
ＩＤホールディングス	600	1,275.00	765,000	
日本オラクル	2,900	11,340.00	32,886,000	
アルファシステムズ	400	3,490.00	1,396,000	
フューチャー	1,700	1,779.00	3,024,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	900	1,490.00	1,341,000	
ＳＢテクノロジー	500	3,770.00	1,885,000	
トーセ	400	859.00	343,600	
オービックビジネスコンサルタント	1,500	6,800.00	10,200,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,500	3,785.00	24,602,500	
アイティフォー	1,700	945.00	1,606,500	
東計電算	200	4,550.00	910,000	
エックスネット	200	980.00	196,000	
大塚商会	7,700	5,100.00	39,270,000	
サイボウズ	1,700	2,604.00	4,426,800	

ソフトブレーン	500	866.00	433,000	
電通国際情報サービス	900	6,660.00	5,994,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,400	783.00	1,096,200	
デジタルガレージ	2,600	4,210.00	10,946,000	
ＥＭシステムズ	2,000	859.00	1,718,000	
ウェザーニューズ	500	5,600.00	2,800,000	
ＣＩＪ	1,000	943.00	943,000	
ビジネスエンジニアリング	200	3,345.00	669,000	
日本エンタープライズ	1,600	222.00	355,200	
ＷＯＷＯＷ	700	2,851.00	1,995,700	
スカラ	1,000	840.00	840,000	
インテリジェント　ウェイブ	900	700.00	630,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,300	360.00	468,000	
ネットワンシステムズ	5,400	3,870.00	20,898,000	
システムソフト	3,300	92.00	303,600	
アルゴグラフィックス	1,200	3,105.00	3,726,000	
マーベラス	2,300	864.00	1,987,200	
エイベックス	2,500	1,025.00	2,562,500	
日本ユニシス	4,500	3,875.00	17,437,500	
兼松エレクトロニクス	800	4,095.00	3,276,000	
都築電気	500	1,608.00	804,000	
ＴＢＳホールディングス	8,700	1,948.00	16,947,600	
日本テレビホールディングス	12,000	1,160.00	13,920,000	
朝日放送グループホールディングス	1,500	692.00	1,038,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,728.00	6,739,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	9,400	513.00	4,822,200	
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,304.00	2,764,800	
日本ＢＳ放送	500	1,092.00	546,000	
ビジョン	1,800	1,104.00	1,987,200	
スマートバリュー	400	1,006.00	402,400	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,385.00	831,000	
コネクシオ	800	1,380.00	1,104,000	
クロップス	300	772.00	231,600	
日本電信電話	191,100	2,650.00	506,415,000	
ＫＤＤＩ	104,200	2,960.50	308,484,100	
ソフトバンク	129,900	1,341.50	174,260,850	
光通信	1,500	25,070.00	37,605,000	
エムティーアイ	1,400	816.00	1,142,400	
ＧＭＯインターネット	5,100	2,925.00	14,917,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	395.00	197,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	3,900	3,575.00	13,942,500	
学研ホールディングス	1,900	1,751.00	3,326,900	

ゼンリン	2,900	1,279.00	3,709,100	
昭文社ホールディングス	700	481.00	336,700	
インプレスホールディングス	1,300	173.00	224,900	
アイネット	800	1,535.00	1,228,000	
松竹	900	14,300.00	12,870,000	
東宝	8,400	4,385.00	36,834,000	
東映	500	16,250.00	8,125,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	38,100	1,362.00	51,892,200	
ピー・シー・エー	200	4,430.00	886,000	
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,520.00	760,000	
ＤＴＳ	3,200	2,238.00	7,161,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,100	6,420.00	39,162,000	
シーイーシー	1,600	1,543.00	2,468,800	
カプコン	6,700	6,590.00	44,153,000	
アイ・エス・ビー	300	2,857.00	857,100	
ジャステック	900	1,337.00	1,203,300	
ＳＣＳＫ	3,300	5,760.00	19,008,000	
日本システムウエア	500	2,135.00	1,067,500	
アイネス	1,500	1,428.00	2,142,000	
ＴＫＣ	1,200	6,900.00	8,280,000	
富士ソフト	1,500	5,020.00	7,530,000	
ＮＳＤ	4,600	2,021.00	9,296,600	
コナミホールディングス	5,200	6,000.00	31,200,000	
福井コンピュータホールディングス	600	3,605.00	2,163,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,000	1,483.00	1,483,000	
ミロク情報サービス	1,300	2,027.00	2,635,100	
ソフトバンクグループ	113,400	7,999.00	907,086,600	
ホウスイ	200	1,016.00	203,200	
高千穂交易	600	1,172.00	703,200	
カワニシホールディングス	200	1,448.00	289,600	
伊藤忠食品	400	5,480.00	2,192,000	
エレマテック	1,400	1,058.00	1,481,200	
ＪＡＬＵＸ	400	1,349.00	539,600	
あらた	1,100	5,060.00	5,566,000	
トーメンデバイス	200	3,370.00	674,000	
東京エレクトロン　デバイス	500	3,160.00	1,580,000	
フィールズ	1,300	391.00	508,300	
双日	79,400	236.00	18,738,400	
アルフレッサ　ホールディングス	16,000	2,064.00	33,024,000	
横浜冷凍	3,800	873.00	3,317,400	
神栄	300	1,044.00	313,200	
ラサ商事	800	909.00	727,200	

アルコニックス	1,600	1,465.00	2,344,000	
神戸物産	9,900	3,205.00	31,729,500	
ハイパー	300	608.00	182,400	
あい　ホールディングス	2,100	2,185.00	4,588,500	
ディーブイエックス	600	1,040.00	624,000	
ダイワボウホールディングス	1,200	8,420.00	10,104,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,400	2,011.00	6,837,400	
ラクト・ジャパン	600	2,977.00	1,786,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	865.00	2,422,000	
八洲電機	1,200	980.00	1,176,000	
メディアスホールディングス	900	797.00	717,300	
レスターホールディングス	1,500	2,214.00	3,321,000	
ジューテックホールディングス	400	997.00	398,800	
大光	700	673.00	471,100	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,308.00	654,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,600	1,013.00	7,698,800	
黒谷	500	726.00	363,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	772.00	231,600	
三洋貿易	1,500	996.00	1,494,000	
ビューティガレージ	300	2,630.00	789,000	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,228.00	1,350,800	
ミタチ産業	500	607.00	303,500	
シップヘルスケアホールディングス	2,300	5,520.00	12,696,000	
明治電機工業	500	1,477.00	738,500	
デリカフーズホールディングス	600	680.00	408,000	
スターティアホールディングス	400	804.00	321,600	
コメダホールディングス	3,200	1,839.00	5,884,800	
ピーバンドットコム	200	938.00	187,600	
アセンテック	300	1,870.00	561,000	
富士興産	500	981.00	490,500	
協栄産業	200	1,330.00	266,000	
小野建	1,300	1,204.00	1,565,200	
南陽	400	1,675.00	670,000	
佐鳥電機	1,000	807.00	807,000	
エコートレーディング	400	667.00	266,800	
伯東	900	1,083.00	974,700	
コンドーテック	1,200	1,059.00	1,270,800	
中山福	1,000	586.00	586,000	
ナガイレーベン	1,900	2,756.00	5,236,400	
三菱食品	1,600	2,874.00	4,598,400	
松田産業	1,100	1,831.00	2,014,100	
第一興商	2,100	3,695.00	7,759,500	

メディパルホールディングス	15,500	2,029.00	31,449,500	
ＳＰＫ	700	1,294.00	905,800	
萩原電気ホールディングス	600	2,452.00	1,471,200	
アズワン	900	15,070.00	13,563,000	
スズデン	500	1,245.00	622,500	
シモジマ	900	1,417.00	1,275,300	
ドウシシャ	1,400	1,921.00	2,689,400	
小津産業	400	1,884.00	753,600	
高速	900	1,622.00	1,459,800	
たけびし	500	1,558.00	779,000	
リックス	400	1,665.00	666,000	
丸文	1,400	533.00	746,200	
ハピネット	1,200	1,535.00	1,842,000	
橋本総業ホールディングス	300	2,780.00	834,000	
日本ライフライン	4,300	1,585.00	6,815,500	
タカショー	1,000	881.00	881,000	
マルカ	500	2,022.00	1,011,000	
ＩＤＯＭ	4,100	539.00	2,209,900	
進和	900	2,201.00	1,980,900	
エスケイジャパン	400	487.00	194,800	
ダイトロン	600	1,654.00	992,400	
シークス	1,800	1,584.00	2,851,200	
田中商事	500	695.00	347,500	
オーハシテクニカ	800	1,445.00	1,156,000	
白銅	600	1,483.00	889,800	
ダイコー通産	100	1,368.00	136,800	
伊藤忠商事	97,300	2,906.50	282,802,450	
丸紅	149,400	670.30	100,142,820	
高島	300	1,660.00	498,000	
長瀬産業	8,100	1,487.00	12,044,700	
蝶理	900	1,617.00	1,455,300	
豊田通商	16,000	3,895.00	62,320,000	
三共生興	2,300	485.00	1,115,500	
兼松	5,400	1,277.00	6,895,800	
ツカモトコーポレーション	300	1,527.00	458,100	
三井物産	124,200	1,881.50	233,682,300	
日本紙パルプ商事	800	3,610.00	2,888,000	
カメイ	2,000	1,212.00	2,424,000	
東都水産	200	4,550.00	910,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,837.00	567,400	
スターゼン	600	4,130.00	2,478,000	
山善	5,600	1,064.00	5,958,400	

椿本興業	300	3,980.00	1,194,000	
住友商事	90,600	1,332.50	120,724,500	
内田洋行	600	4,435.00	2,661,000	
三菱商事	94,100	2,528.50	237,931,850	
第一実業	700	4,085.00	2,859,500	
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	2,330.00	8,388,000	
西華産業	800	1,334.00	1,067,200	
佐藤商事	1,200	997.00	1,196,400	
菱洋エレクトロ	1,500	2,798.00	4,197,000	
東京産業	1,400	586.00	820,400	
ユアサ商事	1,400	3,485.00	4,879,000	
神鋼商事	400	1,867.00	746,800	
トルク	1,000	260.00	260,000	
阪和興業	2,700	2,788.00	7,527,600	
正栄食品工業	900	3,725.00	3,352,500	
カナデン	1,200	1,331.00	1,597,200	
菱電商事	1,100	1,512.00	1,663,200	
フルサト工業	800	1,322.00	1,057,600	
岩谷産業	3,700	6,180.00	22,866,000	
ナイス	700	1,622.00	1,135,400	
昭光通商	500	606.00	303,000	
ニチモウ	300	1,960.00	588,000	
極東貿易	400	1,311.00	524,400	
イワキ	2,000	530.00	1,060,000	
三愛石油	3,600	1,219.00	4,388,400	
稲畑産業	3,200	1,453.00	4,649,600	
ＧＳＩクレオス	400	1,756.00	702,400	
明和産業	1,500	479.00	718,500	
クワザワホールディングス	600	583.00	349,800	
ヤマエ久野	1,100	1,222.00	1,344,200	
ワキタ	3,100	1,121.00	3,475,100	
東邦ホールディングス	4,600	1,885.00	8,671,000	
サンゲツ	3,900	1,536.00	5,990,400	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,407.00	3,095,400	
シナネンホールディングス	600	2,967.00	1,780,200	
伊藤忠エネクス	3,200	1,018.00	3,257,600	
サンリオ	4,100	1,498.00	6,141,800	
サンワテクノス	1,100	1,018.00	1,119,800	
リョーサン	1,600	1,894.00	3,030,400	
新光商事	2,200	740.00	1,628,000	
トーホー	700	2,055.00	1,438,500	
三信電気	800	2,162.00	1,729,600	

東陽テクニカ	1,600	1,125.00	1,800,000	
モスフードサービス	1,900	2,894.00	5,498,600	
加賀電子	1,400	2,295.00	3,213,000	
ソーダニッカ	1,600	530.00	848,000	
立花エレテック	1,100	1,668.00	1,834,800	
フォーバル	700	866.00	606,200	
ＰＡＬＴＡＣ	2,300	5,740.00	13,202,000	
三谷産業	2,000	508.00	1,016,000	
太平洋興発	700	640.00	448,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	300	2,156.00	646,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,439.00	287,800	
コーア商事ホールディングス	300	1,498.00	449,400	
国際紙パルプ商事	3,600	251.00	903,600	
ヤマタネ	800	1,373.00	1,098,400	
丸紅建材リース	200	1,690.00	338,000	
日鉄物産	1,000	3,830.00	3,830,000	
泉州電業	400	3,125.00	1,250,000	
トラスコ中山	3,300	2,857.00	9,428,100	
オートバックスセブン	5,400	1,379.00	7,446,600	
モリト	1,100	642.00	706,200	
加藤産業	2,100	3,420.00	7,182,000	
北恵	400	867.00	346,800	
イノテック	800	1,012.00	809,600	
イエローハット	2,700	1,561.00	4,214,700	
ＪＫホールディングス	1,400	867.00	1,213,800	
日伝	1,300	2,271.00	2,952,300	
北沢産業	1,200	269.00	322,800	
杉本商事	800	2,474.00	1,979,200	
因幡電機産業	4,100	2,501.00	10,254,100	
東テク	500	2,841.00	1,420,500	
ミスミグループ本社	18,000	3,420.00	61,560,000	
アルテック	1,100	301.00	331,100	
タキヒヨー	500	1,962.00	981,000	
蔵王産業	300	1,349.00	404,700	
スズケン	6,100	3,940.00	24,034,000	
ジェコス	1,100	963.00	1,059,300	
グローセル	1,600	443.00	708,800	
ローソン	3,600	4,735.00	17,046,000	
サンエー	1,200	4,215.00	5,058,000	
カワチ薬品	1,100	2,998.00	3,297,800	
エービーシー・マート	2,200	5,440.00	11,968,000	
ハードオフコーポレーション	600	708.00	424,800	

アスクル	1,500	4,290.00	6,435,000	
ゲオホールディングス	2,600	1,241.00	3,226,600	
アダストリア	2,000	1,932.00	3,864,000	
ジーフット	1,000	417.00	417,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	419.00	125,700	
くら寿司	800	6,540.00	5,232,000	
キャンドゥ	700	1,890.00	1,323,000	
パルグループホールディングス	1,500	1,199.00	1,798,500	
エディオン	6,600	1,005.00	6,633,000	
サーラコーポレーション	2,900	564.00	1,635,600	
ワッツ	700	840.00	588,000	
ハローズ	600	3,640.00	2,184,000	
フジオフードグループ本社	1,200	1,365.00	1,638,000	
あみやき亭	300	2,862.00	858,600	
ひらまつ	2,800	179.00	501,200	
大黒天物産	400	6,070.00	2,428,000	
ハニーズホールディングス	1,300	978.00	1,271,400	
ファーマライズホールディングス	400	786.00	314,400	
アルペン	1,100	2,431.00	2,674,100	
ハブ	400	561.00	224,400	
クオールホールディングス	2,200	1,145.00	2,519,000	
ジンズホールディングス	800	6,760.00	5,408,000	
ビックカメラ	8,500	1,137.00	9,664,500	
ＤＣＭホールディングス	8,800	1,185.00	10,428,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	10,200	5,380.00	54,876,000	
東京一番フーズ	400	596.00	238,400	
きちりホールディングス	400	671.00	268,400	
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,131.00	2,557,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	17,200	894.00	15,376,800	
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,514.00	3,179,400	
マツモトキヨシホールディングス	5,900	4,610.00	27,199,000	
ブロンコビリー	800	2,429.00	1,943,200	
ＺＯＺＯ	9,900	2,637.00	26,106,300	
トレジャー・ファクトリー	400	711.00	284,400	
物語コーポレーション	400	12,850.00	5,140,000	
ココカラファイン	1,500	7,600.00	11,400,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,200	618.00	15,573,600	
Ｈａｍｅｅ	500	1,989.00	994,500	
ウエルシアホールディングス	8,600	3,935.00	33,841,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,400	3,800.00	9,120,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,800	367.00	660,600	
ミサワ	300	701.00	210,300	

ティーライフ	200	1,141.00	228,200	
チムニー	500	1,239.00	619,500	
シュッピン	1,000	866.00	866,000	
オイシックス・ラ・大地	1,400	3,015.00	4,221,000	
ネクステージ	2,500	1,325.00	3,312,500	
ジョイフル本田	4,200	1,469.00	6,169,800	
鳥貴族	400	1,471.00	588,400	
キリン堂ホールディングス	200	3,495.00	699,000	
ホットランド	1,100	1,311.00	1,442,100	
すかいらーくホールディングス	16,100	1,634.00	26,307,400	
ＳＦＰホールディングス	800	1,273.00	1,018,400	
綿半ホールディングス	1,100	1,349.00	1,483,900	
ヨシックス	300	1,884.00	565,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,200	1,134.00	4,762,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	919.00	735,200	
ＢＥＥＮＯＳ	700	2,587.00	1,810,900	
あさひ	1,100	1,711.00	1,882,100	
日本調剤	900	1,504.00	1,353,600	
コスモス薬品	1,300	17,050.00	22,165,000	
トーエル	700	799.00	559,300	
オンリー	300	458.00	137,400	
セブン&アイ・ホールディングス	56,200	3,594.00	201,982,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,800	610.00	4,758,000	
ツルハホールディングス	3,100	16,050.00	49,755,000	
サンマルクホールディングス	1,100	1,408.00	1,548,800	
フェリシモ	400	1,365.00	546,000	
トリドールホールディングス	3,600	1,385.00	4,986,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,300	517.00	672,100	
ウイルプラスホールディングス	200	713.00	142,600	
ＪＭホールディングス	1,100	2,348.00	2,582,800	
サツドラホールディングス	200	2,033.00	406,600	
アレンザホールディングス	700	1,305.00	913,500	
串カツ田中ホールディングス	400	1,554.00	621,600	
バロックジャパンリミテッド	1,000	676.00	676,000	
クスリのアオキホールディングス	1,300	8,930.00	11,609,000	
スシローグローバルホールディングス	7,900	3,550.00	28,045,000	
メディカルシステムネットワーク	1,400	652.00	912,800	
はるやまホールディングス	700	691.00	483,700	
ノジマ	2,600	2,664.00	6,926,400	
カッパ・クリエイト	2,100	1,480.00	3,108,000	
ライトオン	1,100	606.00	666,600	

ジーンズメイト	500	313.00	156,500	
良品計画	19,100	2,035.00	38,868,500	
三城ホールディングス	1,700	299.00	508,300	
アドヴァン	2,200	1,268.00	2,789,600	
アルビス	600	2,510.00	1,506,000	
コナカ	1,900	290.00	551,000	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,653.00	330,600	
Ｇ－７ホールディングス	900	2,305.00	2,074,500	
イオン北海道	1,900	937.00	1,780,300	
コジマ	2,500	729.00	1,822,500	
ヒマラヤ	500	993.00	496,500	
コーナン商事	2,000	3,205.00	6,410,000	
エコス	500	2,162.00	1,081,000	
マルシェ	400	505.00	202,000	
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	31,600	2,386.00	75,397,600	
西松屋チェーン	3,200	1,519.00	4,860,800	
ゼンショーホールディングス	6,900	2,682.00	18,505,800	
幸楽苑ホールディングス	900	1,710.00	1,539,000	
ハークスレイ	300	898.00	269,400	
サイゼリヤ	2,100	1,880.00	3,948,000	
ＶＴホールディングス	6,200	389.00	2,411,800	
魚力	400	1,825.00	730,000	
フジ・コーポレーション	400	2,218.00	887,200	
ユナイテッドアローズ	1,600	1,652.00	2,643,200	
ハイデイ日高	2,100	1,723.00	3,618,300	
京都きもの友禅	1,000	224.00	224,000	
コロワイド	4,800	1,612.00	7,737,600	
ピーシーデポコーポレーション	1,900	591.00	1,122,900	
壱番屋	1,000	5,080.00	5,080,000	
ＰＬＡＮＴ	400	736.00	294,400	
スギホールディングス	2,900	7,170.00	20,793,000	
薬王堂ホールディングス	600	2,448.00	1,468,800	
スクロール	2,200	726.00	1,597,200	
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,959.00	2,938,500	
木曽路	1,900	2,408.00	4,575,200	
ＳＲＳホールディングス	1,700	848.00	1,441,600	
千趣会	2,700	350.00	945,000	
タカキュー	1,300	135.00	175,500	
リテールパートナーズ	1,900	1,438.00	2,732,200	
ケーヨー	3,100	746.00	2,312,600	
上新電機	1,700	2,775.00	4,717,500	
日本瓦斯	2,300	5,630.00	12,949,000	

ロイヤルホールディングス	2,500	1,935.00	4,837,500	
東天紅	100	922.00	92,200	
いなげや	1,800	1,904.00	3,427,200	
島忠	2,700	5,480.00	14,796,000	
チヨダ	1,500	932.00	1,398,000	
ライフコーポレーション	1,100	3,555.00	3,910,500	
リンガーハット	1,800	2,339.00	4,210,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,000	840.00	1,680,000	
ＡＯＫＩホールディングス	2,900	502.00	1,455,800	
オークワ	2,300	1,337.00	3,075,100	
コメリ	2,200	2,853.00	6,276,600	
青山商事	3,000	523.00	1,569,000	
しまむら	1,700	10,450.00	17,765,000	
はせがわ	800	297.00	237,600	
高島屋	10,500	861.00	9,040,500	
松屋	3,000	777.00	2,331,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	6,800	695.00	4,726,000	
近鉄百貨店	600	3,335.00	2,001,000	
丸井グループ	13,200	1,928.00	25,449,600	
アクシアル　リテイリング	1,200	4,865.00	5,838,000	
イオン	55,200	3,050.00	168,360,000	
イズミ	2,900	3,815.00	11,063,500	
平和堂	2,900	2,153.00	6,243,700	
フジ	1,700	1,966.00	3,342,200	
ヤオコー	1,600	6,980.00	11,168,000	
ゼビオホールディングス	1,800	835.00	1,503,000	
ケーズホールディングス	13,900	1,319.00	18,334,100	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	800	958.00	766,400	
日産東京販売ホールディングス	2,200	258.00	567,600	
シルバーライフ	200	2,320.00	464,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	600	4,065.00	2,439,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	744.00	223,200	
ブックオフグループホールディングス	900	835.00	751,500	
ギフト	200	1,766.00	353,200	
アインホールディングス	1,800	6,420.00	11,556,000	
元気寿司	400	2,365.00	946,000	
ヤマダホールディングス	43,800	529.00	23,170,200	
アークランドサカモト	2,300	1,765.00	4,059,500	
ニトリホールディングス	6,200	21,430.00	132,866,000	
愛眼	1,200	255.00	306,000	
ケーユーホールディングス	800	827.00	661,600	
吉野家ホールディングス	4,700	1,921.00	9,028,700	

松屋フーズホールディングス	700	3,385.00	2,369,500	
サガミホールディングス	2,000	1,261.00	2,522,000	
関西スーパーマーケット	1,200	1,265.00	1,518,000	
王将フードサービス	1,100	5,930.00	6,523,000	
プレナス	1,600	1,742.00	2,787,200	
ミニストップ	1,100	1,416.00	1,557,600	
アークス	2,900	2,235.00	6,481,500	
バローホールディングス	3,200	2,624.00	8,396,800	
藤久	300	841.00	252,300	
ベルク	700	6,200.00	4,340,000	
大庄	800	1,011.00	808,800	
ファーストリテイリング	1,900	84,380.00	160,322,000	
サンドラッグ	5,400	4,245.00	22,923,000	
サックスバー　ホールディングス	1,300	546.00	709,800	
ヤマザワ	400	1,734.00	693,600	
やまや	300	2,142.00	642,600	
ベルーナ	3,100	934.00	2,895,400	
島根銀行	400	643.00	257,200	
じもとホールディングス	1,000	874.00	874,000	
めぶきフィナンシャルグループ	74,600	202.00	15,069,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	1,163.00	2,326,000	
九州フィナンシャルグループ	31,400	461.00	14,475,400	
ゆうちょ銀行	40,700	858.00	34,920,600	
富山第一銀行	3,400	288.00	979,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	82,000	372.00	30,504,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,500	713.00	6,773,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,400	514.00	4,317,600	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,262.00	1,640,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,350.00	5,875,000	
ひろぎんホールディングス	21,200	613.00	12,995,600	
新生銀行	10,500	1,234.00	12,957,000	
あおぞら銀行	8,600	1,894.00	16,288,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	982,700	445.60	437,891,120	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	156,100	371.20	57,944,320	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,200	3,145.00	85,544,000	
三井住友フィナンシャルグループ	99,400	3,123.00	310,426,200	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	47,900	587.00	28,117,300	
群馬銀行	27,600	327.00	9,025,200	
武蔵野銀行	2,100	1,564.00	3,284,400	
千葉興業銀行	4,000	264.00	1,056,000	
筑波銀行	6,000	195.00	1,170,000	

七十七銀行	4,800	1,441.00	6,916,800	
青森銀行	1,100	2,471.00	2,718,100	
秋田銀行	900	1,381.00	1,242,900	
山形銀行	1,600	1,053.00	1,684,800	
岩手銀行	1,000	2,083.00	2,083,000	
東邦銀行	13,000	219.00	2,847,000	
東北銀行	700	1,105.00	773,500	
みちのく銀行	900	1,114.00	1,002,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,100	1,882.00	22,772,200	
静岡銀行	35,000	765.00	26,775,000	
十六銀行	1,800	1,938.00	3,488,400	
スルガ銀行	14,600	333.00	4,861,800	
八十二銀行	34,600	353.00	12,213,800	
山梨中央銀行	1,700	769.00	1,307,300	
大垣共立銀行	2,800	2,247.00	6,291,600	
福井銀行	1,200	1,865.00	2,238,000	
北國銀行	1,400	2,775.00	3,885,000	
清水銀行	600	1,765.00	1,059,000	
富山銀行	300	3,345.00	1,003,500	
滋賀銀行	2,900	2,315.00	6,713,500	
南都銀行	2,400	1,831.00	4,394,400	
百五銀行	12,800	308.00	3,942,400	
京都銀行	5,100	5,370.00	27,387,000	
紀陽銀行	5,100	1,532.00	7,813,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,600	1,036.00	9,945,600	
山陰合同銀行	8,500	529.00	4,496,500	
中国銀行	12,400	856.00	10,614,400	
鳥取銀行	500	1,126.00	563,000	
伊予銀行	20,500	673.00	13,796,500	
百十四銀行	1,500	1,565.00	2,347,500	
四国銀行	2,200	704.00	1,548,800	
阿波銀行	2,300	2,455.00	5,646,500	
大分銀行	800	2,184.00	1,747,200	
宮崎銀行	1,000	2,245.00	2,245,000	
佐賀銀行	900	1,351.00	1,215,900	
沖縄銀行	1,300	2,914.00	3,788,200	
琉球銀行	3,300	825.00	2,722,500	
セブン銀行	48,000	220.00	10,560,000	
みずほフィナンシャルグループ	195,200	1,324.00	258,444,800	
高知銀行	500	793.00	396,500	
山口フィナンシャルグループ	17,900	624.00	11,169,600	
長野銀行	500	1,450.00	725,000	

名古屋銀行	1,100	2,626.00	2,888,600	
北洋銀行	21,500	233.00	5,009,500	
愛知銀行	500	3,125.00	1,562,500	
中京銀行	600	1,997.00	1,198,200	
大光銀行	500	1,223.00	611,500	
愛媛銀行	2,000	1,026.00	2,052,000	
トマト銀行	600	1,076.00	645,600	
京葉銀行	6,200	442.00	2,740,400	
栃木銀行	6,900	182.00	1,255,800	
北日本銀行	400	1,983.00	793,200	
東和銀行	2,500	621.00	1,552,500	
福島銀行	1,400	206.00	288,400	
大東銀行	800	628.00	502,400	
トモニホールディングス	11,100	332.00	3,685,200	
フィデアホールディングス	13,900	111.00	1,542,900	
池田泉州ホールディングス	16,700	149.00	2,488,300	
ＦＰＧ	4,500	506.00	2,277,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	700	1,463.00	1,024,100	
マーキュリアインベストメント	600	662.00	397,200	
ＳＢＩホールディングス	16,500	2,770.00	45,705,000	
ジャフコ　グループ	2,200	4,770.00	10,494,000	
大和証券グループ本社	115,300	469.20	54,098,760	
野村ホールディングス	252,800	537.50	135,880,000	
岡三証券グループ	12,200	377.00	4,599,400	
丸三証券	4,400	476.00	2,094,400	
東洋証券	5,500	139.00	764,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,500	309.00	5,098,500	
光世証券	400	665.00	266,000	
水戸証券	4,200	237.00	995,400	
いちよし証券	2,700	478.00	1,290,600	
松井証券	8,200	812.00	6,658,400	
マネックスグループ	10,600	341.00	3,614,600	
極東証券	1,900	701.00	1,331,900	
岩井コスモホールディングス	1,400	1,278.00	1,789,200	
藍澤證券	2,700	740.00	1,998,000	
マネーパートナーズグループ	1,600	203.00	324,800	
スパークス・グループ	6,600	258.00	1,702,800	
かんぽ生命保険	5,100	1,886.00	9,618,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	27,000	4,050.00	109,350,000	
アニコム　ホールディングス	4,700	1,052.00	4,944,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	37,600	3,093.00	116,296,800	
第一生命ホールディングス	81,300	1,605.00	130,486,500	

東京海上ホールディングス	50,800	5,208.00	264,566,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	42,900	1,180.00	50,622,000	
アドバンスクリエイト	300	1,947.00	584,100	
全国保証	4,100	4,640.00	19,024,000	
ジェイリース	400	625.00	250,000	
イントラスト	500	882.00	441,000	
日本モーゲージサービス	600	1,143.00	685,800	
Ｃａｓａ	500	1,028.00	514,000	
アルヒ	2,300	1,812.00	4,167,600	
プレミアグループ	800	2,183.00	1,746,400	
クレディセゾン	10,100	1,237.00	12,493,700	
芙蓉総合リース	1,500	6,550.00	9,825,000	
みずほリース	2,200	2,966.00	6,525,200	
東京センチュリー	2,900	7,310.00	21,199,000	
日本証券金融	6,300	523.00	3,294,900	
アイフル	21,800	262.00	5,711,600	
リコーリース	1,100	3,050.00	3,355,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,230.00	10,824,000	
アコム	28,900	461.00	13,322,900	
ジャックス	1,600	1,838.00	2,940,800	
オリエントコーポレーション	38,800	114.00	4,423,200	
日立キャピタル	3,400	2,403.00	8,170,200	
オリックス	89,100	1,565.00	139,441,500	
三菱ＵＦＪリース	36,500	478.00	17,447,000	
九州リースサービス	800	614.00	491,200	
日本取引所グループ	41,200	2,464.50	101,537,400	
イー・ギャランティ	1,600	2,082.00	3,331,200	
アサックス	700	703.00	492,100	
ＮＥＣキャピタルソリューション	600	1,853.00	1,111,800	
いちご	18,400	316.00	5,814,400	
日本駐車場開発	14,600	147.00	2,146,200	
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,404.00	1,123,200	
ＡＤワークスグループ	3,200	164.00	524,800	
ヒューリック	30,500	1,119.00	34,129,500	
三栄建築設計	600	1,624.00	974,400	
野村不動産ホールディングス	8,700	2,251.00	19,583,700	
三重交通グループホールディングス	3,000	477.00	1,431,000	
サムティ	2,100	1,720.00	3,612,000	
ディア・ライフ	2,100	419.00	879,900	
コーセーアールイー	500	655.00	327,500	
日本商業開発	900	1,761.00	1,584,900	
プレサンスコーポレーション	2,400	1,743.00	4,183,200	

ＴＨＥグローバル社	1,000	305.00	305,000	
ハウスコム	300	1,348.00	404,400	
日本管理センター	800	1,255.00	1,004,000	
サンセイランディック	500	744.00	372,000	
エストラスト	300	716.00	214,800	
フージャースホールディングス	3,000	734.00	2,202,000	
オープンハウス	4,500	3,795.00	17,077,500	
東急不動産ホールディングス	39,200	525.00	20,580,000	
飯田グループホールディングス	12,000	2,098.00	25,176,000	
イーグランド	300	796.00	238,800	
ムゲンエステート	1,000	503.00	503,000	
ビーロット	800	713.00	570,400	
ファーストブラザーズ	300	928.00	278,400	
ハウスドゥ	700	1,209.00	846,300	
シーアールイー	400	1,288.00	515,200	
プロパティエージェント	300	1,511.00	453,300	
ケイアイスター不動産	500	2,643.00	1,321,500	
アグレ都市デザイン	400	633.00	253,200	
グッドコムアセット	700	1,250.00	875,000	
ジェイ・エス・ビー	300	3,085.00	925,500	
テンポイノベーション	400	822.00	328,800	
グローバル・リンク・マネジメント	300	925.00	277,500	
パーク２４	7,700	1,706.00	13,136,200	
パラカ	400	1,596.00	638,400	
三井不動産	69,900	2,265.50	158,358,450	
三菱地所	100,700	1,738.00	175,016,600	
平和不動産	2,700	3,495.00	9,436,500	
東京建物	14,200	1,468.00	20,845,600	
ダイビル	3,700	1,344.00	4,972,800	
京阪神ビルディング	2,300	1,924.00	4,425,200	
住友不動産	32,300	3,461.00	111,790,300	
テーオーシー	2,900	692.00	2,006,800	
東京楽天地	200	4,335.00	867,000	
スターツコーポレーション	2,000	3,010.00	6,020,000	
フジ住宅	1,800	650.00	1,170,000	
空港施設	1,600	481.00	769,600	
明和地所	1,000	550.00	550,000	
ゴールドクレスト	1,200	1,582.00	1,898,400	
エスリード	600	1,348.00	808,800	
日神グループホールディングス	2,200	418.00	919,600	
日本エスコン	2,700	907.00	2,448,900	
タカラレーベン	6,900	309.00	2,132,100	

ＡＶＡＮＴＩＡ	900	855.00	769,500	
イオンモール	7,200	1,660.00	11,952,000	
毎日コムネット	500	696.00	348,000	
ファースト住建	700	1,055.00	738,500	
カチタス	3,600	3,125.00	11,250,000	
トーセイ	2,100	1,204.00	2,528,400	
サンフロンティア不動産	2,100	897.00	1,883,700	
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	1,026.00	1,333,800	
インテリックス	600	530.00	318,000	
ランドビジネス	700	336.00	235,200	
グランディハウス	1,300	387.00	503,100	
日本空港ビルデング	4,600	6,720.00	30,912,000	
明豊ファシリティワークス	700	689.00	482,300	
日本工営	900	2,758.00	2,482,200	
ＬＩＦＵＬＬ	4,900	401.00	1,964,900	
ミクシィ	2,600	2,641.00	6,866,600	
ジェイエイシーリクルートメント	900	1,901.00	1,710,900	
日本M&Aセンター	10,700	6,750.00	72,225,000	
メンバーズ	400	2,040.00	816,000	
中広	200	338.00	67,600	
ＵＴグループ	2,200	3,330.00	7,326,000	
アイティメディア	600	2,318.00	1,390,800	
タケエイ	1,600	1,288.00	2,060,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	600	1,055.00	633,000	
ビーネックスグループ	1,800	1,145.00	2,061,000	
コシダカホールディングス	3,300	472.00	1,557,600	
アルトナー	300	959.00	287,700	
パソナグループ	1,500	2,147.00	3,220,500	
ＣＤＳ	400	1,397.00	558,800	
リンクアンドモチベーション	2,600	576.00	1,497,600	
ＧＣＡ	1,800	739.00	1,330,200	
エス・エム・エス	4,300	3,640.00	15,652,000	
サニーサイドアップグループ	500	655.00	327,500	
パーソルホールディングス	13,900	2,003.00	27,841,700	
リニカル	700	727.00	508,900	
クックパッド	4,400	321.00	1,412,400	
エスクリ	500	313.00	156,500	
アイ・ケイ・ケイ	700	633.00	443,100	
学情	500	1,434.00	717,000	
スタジオアリス	700	2,037.00	1,425,900	
シミックホールディングス	700	1,358.00	950,600	
エプコ	300	1,009.00	302,700	

ＮＪＳ	300	2,188.00	656,400	
綜合警備保障	5,500	5,360.00	29,480,000	
カカクコム	10,300	2,884.00	29,705,200	
アイロムグループ	500	1,734.00	867,000	
セントケア・ホールディング	900	879.00	791,100	
サイネックス	300	680.00	204,000	
ルネサンス	800	936.00	748,800	
ディップ	1,900	2,777.00	5,276,300	
デジタルホールディングス	1,000	1,984.00	1,984,000	
新日本科学	1,500	664.00	996,000	
ツクイホールディングス	3,300	563.00	1,857,900	
キャリアデザインセンター	300	942.00	282,600	
ベネフィット・ワン	5,100	3,050.00	15,555,000	
エムスリー	30,700	9,179.00	281,795,300	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	260.00	286,000	
ブラス	200	465.00	93,000	
アウトソーシング	8,000	1,498.00	11,984,000	
ウェルネット	1,400	486.00	680,400	
ワールドホールディングス	500	2,137.00	1,068,500	
ディー・エヌ・エー	5,900	1,904.00	11,233,600	
博報堂ＤＹホールディングス	19,400	1,412.00	27,392,800	
ぐるなび	2,400	525.00	1,260,000	
タカミヤ	1,500	520.00	780,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	929.00	1,021,900	
ファンコミュニケーションズ	3,800	432.00	1,641,600	
ライク	500	2,044.00	1,022,000	
ビジネス・ブレークスルー	600	456.00	273,600	
エスプール	3,600	746.00	2,685,600	
ＷＤＢホールディングス	600	2,785.00	1,671,000	
手間いらず	100	5,440.00	544,000	
ティア	800	416.00	332,800	
ＣＤＧ	100	1,565.00	156,500	
バリューコマース	900	3,600.00	3,240,000	
インフォマート	14,100	931.00	13,127,100	
ＪＰホールディングス	4,400	294.00	1,293,600	
エコナックホールディングス	2,400	92.00	220,800	
ＥＰＳホールディングス	1,900	1,015.00	1,928,500	
レッグス	400	1,906.00	762,400	
プレステージ・インターナショナル	5,200	913.00	4,747,600	
アミューズ	800	2,580.00	2,064,000	
ドリームインキュベータ	400	1,427.00	570,800	
クイック	900	1,184.00	1,065,600	

ＴＡＣ	900	237.00	213,300	
ケネディクス	12,000	748.00	8,976,000	
電通グループ	15,700	3,295.00	51,731,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	575.00	287,500	
ぴあ	400	2,795.00	1,118,000	
イオンファンタジー	500	2,379.00	1,189,500	
シーティーエス	1,600	1,017.00	1,627,200	
ネクシィーズグループ	400	880.00	352,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	3,900	2,931.00	11,430,900	
アルプス技研	1,200	2,335.00	2,802,000	
ダイオーズ	300	971.00	291,300	
日本空調サービス	1,500	787.00	1,180,500	
オリエンタルランド	14,800	17,615.00	260,702,000	
ダスキン	3,500	2,938.00	10,283,000	
明光ネットワークジャパン	1,800	568.00	1,022,400	
ファルコホールディングス	800	1,654.00	1,323,200	
秀英予備校	300	422.00	126,600	
ラウンドワン	3,900	946.00	3,689,400	
リゾートトラスト	6,400	1,586.00	10,150,400	
ビー・エム・エル	1,800	3,575.00	6,435,000	
ワタベウェディング	200	284.00	56,800	
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,337.00	3,208,800	
リソー教育	6,500	309.00	2,008,500	
早稲田アカデミー	600	977.00	586,200	
ユー・エス・エス	15,600	2,092.00	32,635,200	
東京個別指導学院	500	629.00	314,500	
サイバーエージェント	8,600	6,800.00	58,480,000	
楽天	64,900	1,020.00	66,198,000	
クリーク・アンド・リバー社	700	1,081.00	756,700	
モーニングスター	1,500	457.00	685,500	
テー・オー・ダブリュー	2,300	283.00	650,900	
山田コンサルティンググループ	900	977.00	879,300	
セントラルスポーツ	500	2,298.00	1,149,000	
フルキャストホールディングス	1,200	1,755.00	2,106,000	
エン・ジャパン	2,500	3,385.00	8,462,500	
リソルホールディングス	200	3,815.00	763,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,800	8,260.00	23,128,000	
アトラ	400	360.00	144,000	
インターワークス	300	331.00	99,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	15,290.00	9,174,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,000	2,135.00	2,135,000	
ファーストロジック	300	800.00	240,000	

三機サービス	300	990.00	297,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	900	735.00	661,500	
デザインワン・ジャパン	500	218.00	109,000	
イー・ガーディアン	600	3,045.00	1,827,000	
リブセンス	800	243.00	194,400	
ジャパンマテリアル	4,300	1,390.00	5,977,000	
ベクトル	1,700	931.00	1,582,700	
ウチヤマホールディングス	700	307.00	214,900	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,231.00	1,477,200	
キャリアリンク	500	2,046.00	1,023,000	
ＩＢＪ	1,100	794.00	873,400	
アサンテ	500	1,497.00	748,500	
Ｎ・フィールド	1,000	857.00	857,000	
バリューＨＲ	500	1,808.00	904,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,100	6,250.00	6,875,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,970.00	985,000	
ＥＲＩホールディングス	400	689.00	275,600	
アビスト	200	3,080.00	616,000	
シグマクシス	1,000	1,768.00	1,768,000	
ウィルグループ	900	1,059.00	953,100	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,100	316.00	663,600	
メドピア	700	6,360.00	4,452,000	
リクルートホールディングス	99,700	4,100.00	408,770,000	
エラン	900	3,065.00	2,758,500	
土木管理総合試験所	700	365.00	255,500	
ネットマーケティング	500	621.00	310,500	
日本郵政	114,100	772.90	88,187,890	
ベルシステム２４ホールディングス	2,300	1,724.00	3,965,200	
鎌倉新書	1,100	1,050.00	1,155,000	
ＳＭＮ	300	767.00	230,100	
一蔵	200	360.00	72,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	500	3,355.00	1,677,500	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	300	1,021.00	306,300	
エアトリ	700	1,271.00	889,700	
ハイアス・アンド・カンパニー	900	210.00	189,000	
アトラエ	400	2,697.00	1,078,800	
ストライク	500	6,050.00	3,025,000	
ソラスト	3,800	1,449.00	5,506,200	
セラク	400	2,207.00	882,800	
インソース	600	3,350.00	2,010,000	
ベイカレント・コンサルティング	800	15,250.00	12,200,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	2,293.00	687,900	

アイモバイル	500	1,318.00	659,000	
キャリアインデックス	600	777.00	466,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	500	890.00	445,000	
船場	300	908.00	272,400	
グレイステクノロジー	600	6,720.00	4,032,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,600	4,750.00	7,600,000	
フルテック	200	1,496.00	299,200	
グリーンズ	400	490.00	196,000	
ツナググループ・ホールディングス	300	334.00	100,200	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	400	575.00	230,000	
ソウルドアウト	300	1,533.00	459,900	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	603.00	180,900	
エル・ティー・エス	100	4,380.00	438,000	
ミダック	200	3,305.00	661,000	
日総工産	900	750.00	675,000	
キュービーネットホールディングス	600	1,486.00	891,600	
ＲＰＡホールディングス	1,100	648.00	712,800	
スプリックス	400	798.00	319,200	
マネジメントソリューションズ	700	1,675.00	1,172,500	
プロレド・パートナーズ	200	4,385.00	877,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	100	799.00	79,900	
フロンティア・マネジメント	100	5,130.00	513,000	
ピアラ	100	2,236.00	223,600	
コプロ・ホールディングス	100	3,095.00	309,500	
ギークス	100	1,147.00	114,700	
カーブスホールディングス	3,800	774.00	2,941,200	
フォーラムエンジニアリング	700	872.00	610,400	
ダイレクトマーケティングミックス	500	2,821.00	1,410,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	679.00	475,300	
リログループ	7,600	2,670.00	20,292,000	
東祥	900	1,588.00	1,429,200	
エイチ・アイ・エス	2,000	1,683.00	3,366,000	
ラックランド	400	2,372.00	948,800	
共立メンテナンス	2,300	3,805.00	8,751,500	
イチネンホールディングス	1,600	1,314.00	2,102,400	
建設技術研究所	900	2,116.00	1,904,400	
スペース	900	797.00	717,300	
長大	600	1,410.00	846,000	
燦ホールディングス	600	1,262.00	757,200	
スバル興業	100	8,410.00	841,000	
東京テアトル	500	1,300.00	650,000	
タナベ経営	300	1,334.00	400,200	

ナガワ	400	9,090.00	3,636,000	
よみうりランド	300	6,030.00	1,809,000	
東京都競馬	900	4,705.00	4,234,500	
常磐興産	600	1,489.00	893,400	
カナモト	2,400	2,306.00	5,534,400	
東京ドーム	5,600	1,301.00	7,285,600	
西尾レントオール	1,300	2,181.00	2,835,300	
トランス・コスモス	1,300	2,741.00	3,563,300	
乃村工藝社	5,900	881.00	5,197,900	
藤田観光	600	1,493.00	895,800	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	900	953.00	857,700	
日本管財	1,500	2,046.00	3,069,000	
トーカイ	1,400	2,060.00	2,884,000	
白洋舎	200	2,454.00	490,800	
セコム	14,800	9,762.00	144,477,600	
セントラル警備保障	700	3,660.00	2,562,000	
丹青社	2,700	867.00	2,340,900	
メイテック	1,700	5,160.00	8,772,000	
応用地質	1,600	1,265.00	2,024,000	
船井総研ホールディングス	2,900	2,575.00	7,467,500	
進学会ホールディングス	300	445.00	133,500	
オオバ	1,000	750.00	750,000	
いであ	300	1,873.00	561,900	
学究社	400	1,263.00	505,200	
ベネッセホールディングス	4,600	2,119.00	9,747,400	
イオンディライト	1,700	2,569.00	4,367,300	
ナック	800	930.00	744,000	
ダイセキ	2,300	3,020.00	6,946,000	
ステップ	500	1,636.00	818,000	
合　　計	15,256,100		35,971,615,820	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	753,488,934	1,575,608,964
コール・ローン	934,256,262	590,411,800
株式	221,493,732,724	218,512,410,943
投資証券	5,943,134,870	4,951,575,716
派生商品評価勘定	216,638,290	9,065,253
未収入金	1,668,501	1,076,421
未収配当金	281,728,041	218,140,492
その他未収収益	38,477	-
差入委託証拠金	977,852,570	472,606,405
流動資産合計	230,602,538,669	226,330,895,994
資産合計	230,602,538,669	226,330,895,994
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	710,720	12,377,080
未払金	779,500	123,540
未払解約金	59,029,578	98,573,123
未払利息	383	307
流動負債合計	60,520,181	111,074,050
負債合計	60,520,181	111,074,050
純資産の部		
元本等		
元本	90,076,685,860	74,383,931,913
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	140,465,332,628	151,835,890,031
元本等合計	230,542,018,488	226,219,821,944
純資産合計	230,542,018,488	226,219,821,944
負債純資産合計	230,602,538,669	226,330,895,994

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	（1）デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 （2）為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
１．	期首	2019年12月17日	2020年 6月16日
	期首元本額	79,674,652,979円	90,076,685,860円
	期首からの追加設定元本額	21,859,759,588円	2,414,346,180円
	期首からの一部解約元本額	11,457,726,707円	18,107,100,127円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（ＤＣ専用）	20,639,023,932円	21,495,448,352円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	128,229,444円	127,112,999円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	321,710,681円	321,179,996円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	617,668,439円	618,527,054円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	626,202,499円	638,142,048円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	1,845,422,371円	1,705,092,519円
	日興五大陸株式ファンド	4,682,532,756円	4,530,819,848円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	65,700,296円	57,589,856円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	145,287,200円	128,451,692円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	6,691,801,519円	6,687,584,441円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	45,917,133,859円	30,245,618,400円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,841,692円	4,300,671円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,119,797円	3,305,620円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	5,650,684円	5,162,231円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	5,621,598円	4,512,043円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,724,377,685円	3,298,365,222円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	27,909,475円	25,455,562円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	75,736,874円	71,133,429円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	113,294,962円	104,507,296円

	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	107,681,596円	99,255,361円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,326,738,501円	4,212,367,273円
	計	90,076,685,860円	74,383,931,913円
２．	受益権の総数	90,076,685,860口	74,383,931,913口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月15日現在	2020年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2020年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△5,108,016,604
投資証券	△892,773,237
合計	△6,000,789,841

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	13,688,527,036
投資証券	109,795,130
合計	13,798,322,166

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2020年 6月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引 買建	2,766,667,420	－	2,970,011,100	203,343,680
合計		2,766,667,420	－	2,970,011,100	203,343,680

（2020年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,747,176,203	－	2,739,520,476	△7,655,727
合計		2,747,176,203	－	2,739,520,476	△7,655,727

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（2020年 6月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,041,758,390	－	1,054,343,000	12,584,610
	米ドル	727,011,390	－	728,456,000	1,444,610
	ユーロ	314,747,000	－	325,887,000	11,140,000
	売建	8,246,880	－	8,247,600	△720
	ニュージーランドドル	8,246,880	－	8,247,600	△720
合計		1,050,005,270	－	1,062,590,600	12,583,890

（2020年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	939,913,100	－	944,418,000	4,504,900
	米ドル	668,404,860	－	665,850,000	△2,554,860
	ユーロ	271,508,240	－	278,568,000	7,059,760
	売建	209,787,600	－	209,948,600	△161,000
	米ドル	176,868,000	－	176,987,000	△119,000
	豪ドル	32,919,600	－	32,961,600	△42,000
合計		1,149,700,700	－	1,154,366,600	4,343,900

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 6月15日現在		2020年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2.5594円	1口当たり純資産額	3.0412円
(1万口当たり純資産額)	(25,594円)	(1万口当たり純資産額)	(30,412円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES CO	25,945	21.68	562,487.60	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,070	17.25	397,957.50	
	CHENIERE ENERGY INC	8,760	59.18	518,416.80	
	CHEVRON CORP	89,331	89.44	7,989,764.64	
	CONCHO RESOURCES INC	9,525	61.59	586,644.75	
	CONOCOPHILLIPS	49,460	42.32	2,093,147.20	
	EOG RESOURCES INC	28,142	52.08	1,465,635.36	
	EXXON MOBIL CORP	196,261	42.22	8,286,139.42	
	HALLIBURTON CO	44,847	18.96	850,299.12	
	HESS CORP	10,910	53.90	588,049.00	
	KINDER MORGAN INC	90,950	14.31	1,301,494.50	
	MARATHON PETROLEUM CORP	29,832	40.76	1,215,952.32	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	37,921	19.17	726,945.57	
	ONEOK INC	22,780	40.14	914,389.20	
	PHILLIPS 66	21,765	67.19	1,462,390.35	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,810	113.11	883,389.10	
	SCHLUMBERGER LTD	68,001	22.18	1,508,262.18	
	VALERO ENERGY CORP	18,972	56.39	1,069,831.08	
	WILLIAMS COS INC	56,454	21.51	1,214,325.54	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,315	265.40	2,737,601.00	
	ALBEMARLE CORP	4,890	134.57	658,047.30	
	AMCOR PLC	67,580	11.27	761,626.60	
	AVERY DENNISON CORP	3,200	148.77	476,064.00	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,010	28.71	287,387.10	
	BALL CORP	15,700	90.30	1,417,710.00	
	CELANESE CORP	5,120	128.99	660,428.80	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,140	38.82	471,274.80	
	CORTEVA INC	37,162	38.76	1,440,399.12	

CROWN HOLDINGS INC	5,715	95.19	544,010.85	
DOW INC	36,435	53.06	1,933,241.10	
DUPONT DE NEMOURS INC	35,792	65.76	2,353,681.92	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,545	100.19	555,553.55	
ECOLAB INC	12,230	217.00	2,653,910.00	
FMC CORP	5,140	114.52	588,632.80	
FREEPORT-MCMORAN INC	65,378	23.80	1,555,996.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	15,950	48.01	765,759.50	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,715	109.25	405,863.75	
LINDE PLC	24,360	247.60	6,031,536.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,030	87.10	1,134,913.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,895	259.70	751,831.50	
MOSAIC CO/THE	14,870	22.68	337,251.60	
NEWMONT CORP	37,312	57.56	2,147,678.72	
NUCOR CORP	12,939	55.66	720,184.74	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,220	131.68	687,369.60	
PPG INDUSTRIES INC	11,144	141.76	1,579,773.44	
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	86.44	483,199.60	
SEALED AIR CORP	7,116	43.70	310,969.20	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,737	718.85	2,686,342.45	
STEEL DYNAMICS INC	12,240	37.94	464,385.60	
VULCAN MATERIALS CO	6,303	135.44	853,678.32	
WESTROCK CO	13,449	43.02	578,575.98	
3M CO	26,926	173.08	4,660,352.08	
ALLEGION PLC	3,850	109.69	422,306.50	
AMETEK INC	10,633	116.30	1,236,617.90	
BOEING CO/THE	24,852	228.62	5,681,664.24	
CARRIER GLOBAL CORP	38,348	36.62	1,404,303.76	
CATERPILLAR INC	25,296	178.05	4,503,952.80	
CUMMINS INC	7,205	216.41	1,559,234.05	
DEERE & CO	13,890	252.72	3,510,280.80	
DOVER CORP	6,280	120.13	754,416.40	
EATON CORP PLC	18,936	113.84	2,155,674.24	
EMERSON ELECTRIC CO	26,660	80.41	2,143,730.60	
FASTENAL CO	28,226	49.22	1,389,283.72	

FORTIVE CORP	13,254	68.26	904,718.04	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,000	83.07	581,490.00	
GENERAC HOLDINGS INC	2,830	218.06	617,109.80	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,412	153.34	1,749,916.08	
GENERAL ELECTRIC CO	405,383	10.83	4,390,297.89	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	55.86	499,947.00	
HEICO CORP	2,000	132.33	264,660.00	
HEICO CORP-CLASS A	4,130	120.55	497,871.50	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,546	211.85	6,894,870.10	
HOWMET AEROSPACE INC	20,893	26.81	560,141.33	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,230	174.98	390,205.40	
IDEX CORP	3,890	192.67	749,486.30	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,745	199.67	2,944,134.15	
INGERSOLL-RAND INC	16,138	43.86	707,812.68	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,640	105.26	593,666.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,370	55.95	636,151.50	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	8,700	25.83	224,721.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,474	45.10	1,509,677.40	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,155	189.95	1,928,942.25	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	273.00	382,200.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	11,756	357.66	4,204,650.96	
MASCO CORP	11,689	55.06	643,596.34	
NORDSON CORP	3,030	199.72	605,151.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,374	298.00	2,197,452.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	20,494	62.78	1,286,613.32	
OWENS CORNING	4,030	72.65	292,779.50	
PACCAR INC	15,674	84.46	1,323,826.04	
PARKER HANNIFIN CORP	6,240	270.09	1,685,361.60	
PENTAIR PLC	8,438	51.36	433,375.68	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	71,256	70.80	5,044,924.80	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,643	242.99	1,371,192.57	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,100	422.89	2,156,739.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	49.94	323,111.80	
SMITH (A.O.) CORP	4,770	55.41	264,305.70	
SNAP-ON INC	1,820	175.18	318,827.60	

STANLEY BLACK & DECKER INC	7,946	170.40	1,353,998.40	
SUNRUN INC	6,000	57.10	342,600.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,600	380.90	609,440.00	
TEXTRON INC	11,916	46.74	556,953.84	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,926	137.71	1,504,619.46	
TRANSDIGM GROUP INC	2,500	595.82	1,489,550.00	
UNITED RENTALS INC	3,570	238.89	852,837.30	
WABTEC CORP	8,020	73.26	587,545.20	
WW GRAINGER INC	2,127	400.46	851,778.42	
XYLEM INC	8,028	97.14	779,839.92	
CINTAS CORP	3,837	347.26	1,332,436.62	
COPART INC	9,400	118.29	1,111,926.00	
COSTAR GROUP INC	1,945	853.20	1,659,474.00	
EQUIFAX INC	6,004	189.12	1,135,476.48	
IHS MARKIT LTD	17,683	88.97	1,573,256.51	
REPUBLIC SERVICES INC	10,230	94.90	970,827.00	
ROBERT HALF INTL INC	4,405	63.08	277,867.40	
ROLLINS INC	8,030	38.46	308,833.80	
ROLLINS INC(N)	4,015	38.46	154,416.90	
TRANSUNION	8,490	97.64	828,963.60	
VERISK ANALYTICS INC	7,280	194.77	1,417,925.60	
WASTE CONNECTIONS INC	12,786	101.22	1,294,198.92	
WASTE MANAGEMENT INC	19,314	114.78	2,216,860.92	
AMERCO	375	429.10	160,912.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,210	91.78	661,733.80	
CSX CORP	35,683	88.92	3,172,932.36	
DELTA AIR LINES INC	8,455	40.69	344,033.95	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,507	90.18	676,981.26	
FEDEX CORP	11,508	285.54	3,285,994.32	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	133.78	602,010.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,860	192.02	741,197.20	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,140	40.68	290,455.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,190	229.25	2,794,557.50	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,575	195.35	893,726.25	
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,120	45.26	367,511.20	

UBER TECHNOLOGIES INC	45,270	51.46	2,329,594.20	
UNION PACIFIC CORP	31,486	198.00	6,234,228.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,777	166.62	5,461,303.74	
XPO LOGISTICS INC	4,830	120.00	579,600.00	
APTIV PLC	12,100	121.65	1,471,965.00	
AUTOLIV INC	4,250	90.54	384,795.00	
BORGWARNER INC	9,890	36.34	359,402.60	
FORD MOTOR COMPANY	180,695	8.91	1,609,992.45	
GENERAL MOTORS CORP	60,185	41.62	2,504,899.70	
LEAR CORP	2,710	156.07	422,949.70	
TESLA INC	34,735	639.83	22,224,495.05	
DR HORTON INC	16,856	70.40	1,186,662.40	
GARMIN LTD	7,065	117.21	828,088.65	
HASBRO INC	6,698	90.11	603,556.78	
LENNAR CORP-CL A	11,960	74.68	893,172.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,720	352.37	2,015,556.40	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,268	131.53	429,840.04	
NEWELL BRANDS INC	16,126	20.32	327,680.32	
NIKE INC -CL B	57,778	136.28	7,873,985.84	
NVR INC	160	4,022.00	643,520.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,000	121.91	1,219,100.00	
PULTE GROUP INC	11,640	42.12	490,276.80	
VF CORP	15,410	85.75	1,321,407.50	
WHIRLPOOL CORP	2,864	184.03	527,061.92	
ARAMARK	9,340	37.24	347,821.60	
CARNIVAL CORP	23,087	20.93	483,210.91	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,195	1,309.52	1,564,876.40	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,553	112.51	737,278.03	
DOMINO'S PIZZA INC	2,090	383.23	800,950.70	
DRAFTKINGS INC - CL A	7,680	50.58	388,454.40	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,270	103.04	1,367,340.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,060	56.53	964,401.80	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,523	126.62	1,585,662.26	
MCDONALD'S CORP	34,521	211.92	7,315,690.32	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,080	18.00	145,440.00	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,070	29.51	651,285.70	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,248	74.06	536,786.88	
STARBUCKS CORP	54,184	103.32	5,598,290.88	
VAIL RESORTS INC	2,220	278.76	618,847.20	
WYNN RESORTS LTD	4,820	107.54	518,342.80	
YUM! BRANDS INC	13,144	105.50	1,386,692.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	36,200	85.94	3,111,028.00	
ALPHABET INC-CL A	13,970	1,752.26	24,479,072.20	
ALPHABET INC-CL C	13,962	1,760.06	24,573,957.72	
ALTICE USA INC- A	16,770	34.59	580,074.30	
CABLE ONE INC	250	2,144.01	536,002.50	
CHARTER COMMUNICATION-A	6,696	649.67	4,350,190.32	
COMCAST CORP-CLASS A	211,694	50.99	10,794,277.06	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,790	28.65	165,883.50	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	25.21	312,856.10	
DISH NETWORK CORP-A	12,729	35.03	445,896.87	
ELECTRONIC ARTS INC	13,374	137.54	1,839,459.96	
FACEBOOK INC-CLASS A	111,920	274.19	30,687,344.80	
FOX CORP - CLASS A	17,524	28.78	504,340.72	
FOX CORP- CLASS B	7,486	28.34	212,153.24	
IAC/INTERACTIVECORP	4,350	150.75	655,762.50	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,826	23.70	375,076.20	
LIBERTY BROADBAND-A	1,280	158.59	202,995.20	
LIBERTY BROADBAND-C	4,920	161.22	793,202.40	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	42.52	141,379.00	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	9,296	42.76	397,496.96	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,160	42.66	433,425.60	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,820	70.35	550,137.00	
MATCH GROUP INC	11,642	144.81	1,685,878.02	
NETFLIX INC	20,480	522.42	10,699,161.60	
NEWS CORP - CLASS A	18,680	17.75	331,570.00	
OMNICOM GROUP	8,337	63.58	530,066.46	
PINTEREST INC- CLASS A	18,920	69.79	1,320,426.80	
ROKU INC	4,850	324.32	1,572,952.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.33	299,029.20	

SNAP INC - A	43,500	51.60	2,244,600.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	5,740	195.20	1,120,448.00	
THE WALT DISNEY CO.	83,962	169.30	14,214,766.60	
TWITTER INC	35,170	52.02	1,829,543.40	
VIACOMCBS INC - CLASS B	23,823	34.67	825,943.41	
ZILLOW GROUP INC - A	2,710	137.65	373,031.50	
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	134.17	908,330.90	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,278	157.56	516,481.68	
AMAZON.COM INC	19,805	3,156.97	62,523,790.85	
AUTOZONE INC	1,147	1,151.13	1,320,346.11	
BEST BUY CO INC	10,714	101.28	1,085,113.92	
BOOKING HOLDINGS INC	1,898	2,066.01	3,921,286.98	
BURLINGTON STORES INC	3,120	230.51	719,191.20	
CARMAX INC	7,819	92.54	723,570.26	
CARVANA CO	2,820	250.97	707,735.40	
CHEWY INC - CLASS A	3,410	82.81	282,382.10	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	11,780	205.90	2,425,502.00	
DOLLAR TREE INC	11,976	107.68	1,289,575.68	
EBAY INC	33,827	49.57	1,676,804.39	
ETSY INC	5,390	169.97	916,138.30	
EXPEDIA INC	5,912	123.33	729,126.96	
GENUINE PARTS CO	5,611	95.82	537,646.02	
HOME DEPOT INC	50,020	265.58	13,284,311.60	
LKQ CORP	12,000	36.61	439,320.00	
LOWE'S COS INC	35,032	160.09	5,608,272.88	
MERCADOLIBRE INC	2,070	1,618.06	3,349,384.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,685	447.55	1,649,221.75	
POOL CORP	1,810	346.58	627,309.80	
ROSS STORES INC	17,422	110.55	1,926,002.10	
TARGET CORP	23,380	170.99	3,997,746.20	
TIFFANY & CO	5,820	131.11	763,060.20	
TJX COMPANIES INC	55,936	65.34	3,654,858.24	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,990	140.53	841,774.70	
ULTA BEAUTY INC	2,180	265.79	579,422.20	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,110	253.48	788,322.80	

COSTCO WHOLESALE CORP	20,489	374.38	7,670,671.82	
KROGER CO	39,000	31.30	1,220,700.00	
SYSCO CORP	22,436	73.43	1,647,475.48	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,972	41.48	1,492,118.56	
WALMART INC	65,752	145.65	9,576,778.80	
ALTRIA GROUP INC	86,878	42.90	3,727,066.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,963	48.69	1,215,448.47	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,270	75.53	1,153,343.10	
BUNGE LTD	5,457	63.78	348,047.46	
CAMPBELL SOUP CO	8,995	46.71	420,156.45	
COCA-COLA CO/THE	189,472	53.27	10,093,173.44	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,620	47.00	499,140.00	
CONAGRA BRANDS INC	23,430	35.63	834,810.90	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,960	207.00	1,647,720.00	
GENERAL MILLS INC	29,749	59.35	1,765,603.15	
HERSHEY CO/THE	6,795	149.14	1,013,406.30	
HORMEL FOODS CORP	13,870	47.20	654,664.00	
JM SMUCKER CO/THE	4,760	113.25	539,070.00	
KELLOGG CO	11,848	61.92	733,628.16	
KEURIG DR PEPPER INC	23,950	30.35	726,882.50	
KRAFT HEINZ CO/THE	32,231	34.42	1,109,391.02	
LAMB WESTON HOLDING INC	5,990	76.54	458,474.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,070	93.28	1,125,889.60	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,330	45.92	382,513.60	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	66,685	57.29	3,820,383.65	
MONSTER BEVERAGE CORP	17,830	88.42	1,576,528.60	
PEPSICO INC	64,281	144.23	9,271,248.63	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	72,188	84.40	6,092,667.20	
TYSON FOODS INC-CL A	14,326	69.78	999,668.28	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,740	86.06	1,010,344.40	
CLOROX COMPANY	6,206	202.38	1,255,970.28	
COLGATE-PALMOLIVE CO	37,650	84.19	3,169,753.50	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,610	247.45	2,625,444.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	16,193	136.00	2,202,248.00	
PROCTER & GAMBLE CO	115,269	135.85	15,659,293.65	

ABBOTT LABORATORIES	82,186	106.79	8,776,642.94	
ABIOMED INC	2,390	267.62	639,611.80	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,420	504.31	1,724,740.20	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,934	97.12	673,430.08	
ANTHEM INC	11,741	310.10	3,640,884.10	
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,169	78.83	1,747,582.27	
BECTON DICKINSON AND CO	13,517	240.00	3,244,080.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	65,768	33.45	2,199,939.60	
CARDINAL HEALTH INC	13,565	53.55	726,405.75	
CENTENE CORP	28,267	59.73	1,688,387.91	
CERNER CORP	13,400	74.25	994,950.00	
CIGNA CORP	17,140	203.15	3,481,991.00	
COOPER COS INC/THE	2,190	342.85	750,841.50	
CVS HEALTH CORP	61,118	69.72	4,261,146.96	
DANAHER CORP	29,619	221.10	6,548,760.90	
DAVITA INC	3,068	109.19	334,994.92	
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	52.23	600,749.46	
DEXCOM INC	4,620	353.59	1,633,585.80	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,600	83.57	2,390,102.00	
HCA HEALTHCARE INC	12,865	160.86	2,069,463.90	
HENRY SCHEIN INC	5,040	68.07	343,072.80	
HOLOGIC INC	11,868	74.17	880,249.56	
HUMANA INC	6,275	388.23	2,436,143.25	
IDEXX LABORATORIES INC	3,900	458.17	1,786,863.00	
INSULET CORP	3,390	239.05	810,379.50	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,470	764.79	4,183,401.30	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,815	204.11	982,789.65	
MASIMO CORP	2,020	263.00	531,260.00	
MCKESSON CORP	7,824	172.33	1,348,309.92	
MEDTRONIC PLC	62,308	111.97	6,976,626.76	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,550	199.68	509,184.00	
NOVOCURE LTD	3,880	168.99	655,681.20	
QUEST DIAGNOSTICS	6,396	123.16	787,731.36	
RESMED INC	7,260	206.38	1,498,318.80	
STERIS PLC	4,210	186.33	784,449.30	

STRYKER CORP	15,783	230.95	3,645,083.85	
TELADOC HEALTH INC	5,430	194.63	1,056,840.90	
TELEFLEX INC	2,000	380.67	761,340.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,170	336.13	14,846,862.10	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	134.56	406,371.20	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,894	174.13	678,062.22	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,070	264.78	1,607,214.60	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,640	264.92	964,308.80	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,372	142.59	1,336,353.48	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,770	151.75	420,347.50	
ABBVIE INC	81,916	104.20	8,535,647.20	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,870	116.74	1,735,923.80	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,740	156.31	1,678,769.40	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,580	132.69	740,410.20	
AMGEN INC	27,161	229.46	6,232,363.06	
AVANTOR INC	22,000	26.80	589,600.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,150	579.65	666,597.50	
BIOGEN INC	7,123	245.25	1,746,915.75	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,200	82.85	762,220.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	104,535	59.97	6,268,963.95	
CATALENT INC	6,520	97.93	638,503.60	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,836	28.71	598,201.56	
ELI LILLY & CO	39,914	157.91	6,302,819.74	
EXACT SCIENCES CORP	6,990	129.80	907,302.00	
GILEAD SCIENCES INC	58,504	59.84	3,500,879.36	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,950	77.87	774,806.50	
ILLUMINA INC	6,720	347.11	2,332,579.20	
INCYTE CORP	8,950	86.81	776,949.50	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,080	47.83	242,976.40	
IQVIA HOLDINGS INC	9,503	167.30	1,589,851.90	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,140	149.23	468,582.20	
JOHNSON & JOHNSON	122,371	149.07	18,241,844.97	
MERCK & CO. INC.	117,423	80.32	9,431,415.36	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,075	1,139.26	1,224,704.50	
MODERNA INC	12,430	155.07	1,927,520.10	

NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,230	93.46	395,335.80	
PERKINELMER INC	4,790	145.32	696,082.80	
PERRIGO CO PLC	7,139	46.63	332,891.57	
PFIZER INC	258,020	39.21	10,116,964.20	
PPD INC	5,510	34.04	187,560.40	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,025	500.38	2,514,409.50	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	5,130	43.12	221,205.60	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,730	169.54	632,384.20	
SEAGEN INC	6,080	193.59	1,177,027.20	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	59,050	10.31	608,805.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,364	467.13	8,578,375.32	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,160	228.13	2,774,060.80	
VIATRIS INC	60,699	17.33	1,051,913.67	
WATERS CORP	3,036	240.75	730,917.00	
ZOETIS INC	22,170	159.50	3,536,115.00	
BANK OF AMERICA CORP	362,089	28.22	10,218,151.58	
CITIGROUP INC	96,487	58.74	5,667,646.38	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	17,320	34.62	599,618.40	
FIFTH THIRD BANCORP	34,439	26.62	916,766.18	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,440	129.26	1,090,954.40	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	50,560	12.51	632,505.60	
JPMORGAN CHASE & CO	141,630	118.30	16,754,829.00	
KEYCORP	41,558	15.43	641,239.94	
M & T BANK CORP	5,643	124.76	704,020.68	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,230	141.79	2,726,621.70	
REGIONS FINANCIAL CORP	41,044	15.15	621,816.60	
SVB FINANCIAL GROUP	2,285	349.49	798,584.65	
TRUIST FINANCIAL CORP	63,350	45.91	2,908,398.50	
US BANCORP	64,861	44.81	2,906,421.41	
WELLS FARGO & CO	181,790	28.64	5,206,465.60	
ALLY FINANCIAL INC	20,430	33.67	687,878.10	
AMERICAN EXPRESS CO	31,944	117.36	3,748,947.84	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,570	190.99	1,063,814.30	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,500	47.83	454,385.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	36,872	39.83	1,468,611.76	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	65,300	222.85	14,552,105.00	
BLACKROCK INC	7,065	683.92	4,831,894.80	
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	32,120	63.11	2,027,093.20	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,945	90.42	1,893,846.90	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,170	29.40	210,798.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	88.25	347,705.00	
CME GROUP INC	16,710	177.55	2,966,860.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,630	82.63	1,208,876.90	
EQUITABLE HOLDINGS INC	17,100	25.27	432,117.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	344.89	551,824.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	15,725	23.73	373,154.25	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,268	237.79	3,630,577.72	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,480	107.71	2,636,740.80	
INVESCO LTD	22,157	17.10	378,884.70	
KKR & CO INC -A	22,540	39.22	884,018.80	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,650	551.15	909,397.50	
MOODY'S CORP	7,487	274.62	2,056,079.94	
MORGAN STANLEY	62,753	61.88	3,883,155.64	
MSCI INC	4,100	423.90	1,737,990.00	
NASDAQ INC	5,835	124.04	723,773.40	
NORTHERN TRUST CORP	9,170	88.58	812,278.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,360	91.46	490,225.60	
S&P GLOBAL INC	11,257	323.68	3,643,665.76	
SCHWAB (CHARLES) CORP	70,733	49.84	3,525,332.72	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	55.49	255,531.45	
STATE STREET CORP	15,577	70.70	1,101,293.90	
SYNCHRONY FINANCIAL	21,570	31.91	688,298.70	
T ROWE PRICE GROUP INC	10,325	147.86	1,526,654.50	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	64.70	282,092.00	
VOYA FINANCIAL INC	5,580	57.49	320,794.20	
AFLAC INC	33,424	44.20	1,477,340.80	
ALLEGHANY CORP	820	586.97	481,315.40	
ALLSTATE CORP	14,203	104.87	1,489,468.61	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	86.85	251,865.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,605	38.16	1,587,646.80	

AON PLC	10,742	203.96	2,190,938.32	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,685	33.57	727,965.45	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,150	120.50	982,075.00	
ASSURANT INC	3,300	131.65	434,445.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,360	41.75	265,530.00	
BROWN & BROWN INC	10,380	45.45	471,771.00	
CHUBB LTD	21,045	150.86	3,174,848.70	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,230	79.61	495,970.30	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	235.72	280,506.80	
EVEREST RE GROUP LTD	2,314	229.70	531,525.80	
FNF GROUP	15,131	37.51	567,563.81	
GLOBE LIFE INC	5,426	91.77	497,944.02	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,482	45.54	705,050.28	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,243	50.05	412,562.15	
LOEWS CORP	10,835	42.87	464,496.45	
MARKEL CORP	565	992.69	560,869.85	
MARSH & MCLENNAN COS	23,953	114.92	2,752,678.76	
METLIFE INC	35,865	45.84	1,644,051.60	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,300	47.82	636,006.00	
PROGRESSIVE CORP	27,250	94.10	2,564,225.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,052	76.61	1,306,353.72	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,610	117.63	424,644.30	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,437	165.48	403,274.76	
TRAVELERS COS INC/THE	11,794	133.99	1,580,278.06	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,758	205.76	1,184,766.08	
WR BERKLEY CORP	7,264	64.11	465,695.04	
CBRE GROUP INC - A	16,420	65.13	1,069,434.60	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.23	208,116.00	
ACCENTURE PLC-CL A	29,528	243.75	7,197,450.00	
ADOBE INC	22,389	486.42	10,890,457.38	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,730	103.27	695,007.10	
ANSYS INC	3,850	343.39	1,322,051.50	
AUTODESK INC	10,260	288.33	2,958,265.80	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,061	173.15	3,473,562.15	
AVALARA INC	4,050	169.02	684,531.00	

BLACK KNIGHT INC	6,530	87.93	574,182.90	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,490	88.29	661,292.10	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,630	146.10	676,443.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	13,030	121.31	1,580,669.30	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,990	98.75	591,512.50	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,320	122.52	529,286.40	
CITRIX SYSTEMS INC	5,028	128.43	645,746.04	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	6,960	81.43	566,752.80	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,978	79.19	1,978,007.82	
COUPA SOFTWARE INC	3,410	314.79	1,073,433.90	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,680	173.80	987,184.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,090	112.76	235,668.40	
DATADOG INC-CLASS A	5,760	102.27	589,075.20	
DOCUSIGN INC	7,850	228.33	1,792,390.50	
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	23.32	249,757.20	
DYNATRACE INC	6,630	38.45	254,923.50	
EPAM SYSTEMS INC	2,350	325.22	764,267.00	
FAIR ISAAC CORP	1,180	517.64	610,815.20	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	28,878	144.22	4,164,785.16	
FISERV INC	26,534	113.63	3,015,058.42	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,680	271.16	997,868.80	
FORTINET INC	6,710	130.69	876,929.90	
GARTNER INC	3,790	154.59	585,896.10	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,019	191.88	2,689,965.72	
GODADDY INC-CLASS A	7,040	84.60	595,584.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,370	126.23	551,625.10	
HUBSPOT INC	1,950	381.97	744,841.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	41,282	123.53	5,099,565.46	
INTUIT INC	12,166	365.51	4,446,794.66	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,240	157.38	667,291.20	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,620	104.13	689,340.60	
MASTERCARD INC	41,530	331.15	13,752,659.50	
MICROSOFT CORP	334,484	214.20	71,646,472.80	
MONGODB INC	2,470	340.12	840,096.40	
NORTONLIFELOCK INC	28,405	19.87	564,407.35	

OKTA INC	5,930	251.54	1,491,632.20	
ORACLE CORP	92,443	60.76	5,616,836.68	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,330	314.28	1,360,832.40	
PAYCHEX INC	14,902	91.33	1,360,999.66	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,445	425.98	1,041,521.10	
PAYPAL HOLDINGS INC	52,017	220.79	11,484,833.43	
PTC INC	5,940	113.83	676,150.20	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,220	352.52	1,135,114.40	
SALESFORCE.COM INC	42,535	221.27	9,411,719.45	
SERVICENOW INC	8,995	532.48	4,789,657.60	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	17,030	42.26	719,687.80	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,300	329.15	427,895.00	
SPLUNK INC	7,600	159.38	1,211,288.00	
SQUARE INC - A	17,240	215.86	3,721,426.40	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,900	71.49	779,241.00	
SYNOPSYS INC	7,237	238.86	1,728,629.82	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,025	922.42	1,867,900.50	
TWILIO INC - A	6,210	350.09	2,174,058.90	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,030	446.49	906,374.70	
VERISIGN INC	4,860	212.11	1,030,854.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	78,352	207.25	16,238,452.00	
VMWARE INC	4,435	143.66	637,132.10	
WESTERN UNION CO	14,561	22.07	321,361.27	
WIX.COM LTD	2,700	260.94	704,538.00	
WORKDAY INC-CLASS A	7,870	220.37	1,734,311.90	
ZENDESK INC	5,210	137.30	715,333.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,920	395.99	3,136,240.80	
ZSCALER INC	3,600	183.45	660,420.00	
AMPHENOL CORP-CL A	14,050	130.30	1,830,715.00	
APPLE INC	795,758	121.78	96,907,409.24	
ARISTA NETWORKS INC	2,870	274.48	787,757.60	
ARROW ELECTRONICS INC	3,370	95.08	320,419.60	
CDW CORP/DE	6,680	131.73	879,956.40	
CISCO SYSTEMS INC	195,980	44.24	8,670,155.20	
COGNEX CORP	8,920	77.84	694,332.80	

CORNING INC	36,448	36.81	1,341,650.88	
DELL TECHNOLOGIES -C	10,272	72.43	744,000.96	
F5 NETWORKS INC	2,385	171.20	408,312.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,655	11.87	601,274.85	
HP INC	69,365	23.21	1,609,961.65	
IPG PHOTONICS CORP	1,840	209.11	384,762.40	
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	22.08	407,442.24	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,550	123.72	1,181,526.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,275	165.92	1,372,988.00	
NETAPP INC	10,616	61.67	654,688.72	
SEAGATE TECHNOLOGY	9,694	64.64	626,620.16	
TE CONNECTIVITY LTD	15,865	117.17	1,858,902.05	
TRIMBLE INC	11,140	64.64	720,089.60	
WESTERN DIGITAL CORP	12,428	51.14	635,567.92	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,280	383.46	874,288.80	
AT&T INC	330,807	30.55	10,106,153.85	
CENTURYLINK INC	34,386	10.42	358,302.12	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	24.57	186,363.45	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,111	23.63	475,222.93	
T-MOBILE US INC	25,759	129.36	3,332,184.24	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	192,207	59.98	11,528,575.86	
AES CORP	34,668	21.30	738,428.40	
ALLIANT ENERGY CORP	12,340	51.34	633,535.60	
AMEREN CORPORATION	12,032	77.24	929,351.68	
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,998	82.21	1,890,665.58	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,985	148.55	1,186,171.75	
ATMOS ENERGY CORP	4,880	99.51	485,608.80	
CENTERPOINT ENERGY INC	24,962	21.64	540,177.68	
CMS ENERGY CORP	13,070	59.22	774,005.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,076	72.41	1,164,063.16	
DOMINION ENERGY INC	39,931	74.47	2,973,661.57	
DTE ENERGY COMPANY	9,308	123.52	1,149,724.16	
DUKE ENERGY CORP	33,986	91.13	3,097,144.18	
EDISON INTERNATIONAL	17,459	62.26	1,086,997.34	
ENTERGY CORP	9,367	101.41	949,907.47	

ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	47.07	432,573.30	
EVERGY INC	8,720	54.41	474,455.20	
EVERSOURCE ENERGY	16,170	85.46	1,381,888.20	
EXELON CORP	46,796	41.06	1,921,443.76	
FIRSTENERGY CORP	26,905	30.35	816,566.75	
NEXTERA ENERGY INC	90,850	73.55	6,682,017.50	
NISOURCE INC	19,580	22.65	443,487.00	
NRG ENERGY INC	10,000	32.63	326,300.00	
OGE ENERGY CORP	7,330	32.08	235,146.40	
P G & E CORP	54,000	11.85	639,900.00	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	79.14	350,511.06	
PPL CORP	36,218	27.60	999,616.80	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	23,878	56.43	1,347,435.54	
SEMPRA ENERGY	14,107	128.04	1,806,260.28	
SOUTHERN CO	48,805	59.66	2,911,706.30	
UGI CORP	7,720	34.98	270,045.60	
VISTRA CORP	20,980	18.14	380,577.20	
WEC ENERGY GROUP INC	15,380	91.58	1,408,500.40	
XCEL ENERGY INC	23,484	65.04	1,527,399.36	
ADVANCED MICRO DEVICES	54,680	94.78	5,182,570.40	
ANALOG DEVICES INC	16,890	142.33	2,403,953.70	
APPLIED MATERIALS INC	42,613	88.50	3,771,250.50	
BROADCOM INC	18,670	411.80	7,688,306.00	
ENPHASE ENERGY INC	5,400	145.07	783,378.00	
INTEL CORP	196,942	50.47	9,939,662.74	
KLA CORP	7,619	260.13	1,981,930.47	
LAM RESEARCH CORP	6,777	491.87	3,333,402.99	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,564	44.33	1,399,232.12	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,440	85.31	975,946.40	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,844	141.50	1,675,926.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	51,577	71.54	3,689,818.58	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,930	319.46	616,557.80	
NVIDIA CORP	28,750	532.35	15,305,062.50	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,337	158.46	2,113,381.02	
ON SEMICONDUCTOR CORP	21,090	30.82	649,993.80	

	QORVO INC	4,930	154.51	761,734.30	
	QUALCOMM INC	52,372	146.29	7,661,499.88	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,320	139.26	1,158,643.20	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,260	293.32	662,903.20	
	TERADYNE INC	8,220	117.18	963,219.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,502	160.12	6,805,420.24	
	XILINX INC	11,675	149.03	1,739,925.25	
米ドル小計		14,459,099		1,498,294,376.16 (156,002,410,445)	
加ドル	CAMECO CORP	19,892	16.96	337,368.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	52,704	31.27	1,648,054.08	
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	7.70	424,909.10	
	ENBRIDGE INC	94,387	42.53	4,014,279.11	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	24.52	235,931.44	
	INTER PIPELINE LTD	24,540	13.29	326,136.60	
	KEYERA CORP	12,200	23.39	285,358.00	
	PARKLAND CORP	7,370	41.31	304,454.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,932	33.55	970,668.60	
	SUNCOR ENERGY INC	73,799	23.08	1,703,280.92	
	TC ENERGY CORP	44,663	56.41	2,519,439.83	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,625	87.66	1,019,047.50	
	B2GOLD CORP	55,700	6.88	383,216.00	
	BARRICK GOLD CORP	82,644	28.62	2,365,271.28	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	59.46	475,680.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,145	165.76	1,350,115.20	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	8.79	404,559.75	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,580	49.78	626,232.40	
	LUNDIN MINING CORP	35,450	9.84	348,828.00	
	NUTRIEN LTD	28,588	62.39	1,783,605.32	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,120	36.86	409,883.20	
	SSR MINING INC	10,000	22.89	228,900.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	22.64	574,490.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,085	51.34	1,185,183.90	
	YAMANA GOLD INC	50,700	6.71	340,197.00	
	CAE INC	14,195	31.28	444,019.60	

TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,710	93.40	346,514.00	
WSP GLOBAL INC	5,830	125.12	729,449.60	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	8,510	34.45	293,169.50	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,810	89.45	519,704.50	
THOMSON REUTERS CORP	8,516	102.63	873,997.08	
AIR CANADA	7,190	26.10	187,659.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,118	139.63	4,624,266.34	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,175	427.60	2,640,430.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,248	79.44	1,052,421.12	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	34.51	343,374.50	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,318	78.37	965,361.66	
QUEBECOR INC -CL B	6,110	33.62	205,418.20	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	23.18	404,838.70	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,110	164.61	511,937.10	
DOLLARAMA INC	15,530	53.94	837,688.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	38,700	44.65	1,727,955.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	35.54	294,626.60	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,209	65.20	600,426.80	
METRO INC	12,590	59.00	742,810.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	99.15	332,945.70	
SAPUTO INC	9,620	37.00	355,940.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	26.29	333,462.36	
CANOPY GROWTH CORP	11,710	32.31	378,350.10	
BANK OF MONTREAL	28,501	96.12	2,739,516.12	
BANK OF NOVA SCOTIA	55,209	68.16	3,763,045.44	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,505	110.75	2,160,178.75	
NATIONAL BANK OF CANADA	15,060	72.39	1,090,193.40	
ROYAL BANK OF CANADA	65,969	104.86	6,917,509.34	
TORONTO-DOMINION BANK	84,240	71.69	6,039,165.60	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	61,449	51.84	3,185,516.16	
CI FINANCIAL CORP	9,990	16.64	166,233.60	
IGM FINANCIAL INC	3,335	35.17	117,291.95	
ONEX CORPORATION	4,665	72.64	338,865.60	
TMX GROUP LTD	3,030	125.98	381,719.40	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,460	448.02	654,109.20	

	GREAT-WEST LIFECO INC	14,894	29.14	434,011.16	
	IA FINANCIAL CORP INC	3,895	56.35	219,483.25	
	INTACT FINANCIAL CORP	5,965	149.00	888,785.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	90,681	22.40	2,031,254.40	
	POWER CORP OF CANADA	23,289	29.46	686,093.94	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,004	56.59	1,528,156.36	
	FIRSTSERVICE CORP	1,770	166.12	294,032.40	
	BLACKBERRY LTD	27,808	10.54	293,096.32	
	CGI INC	10,430	96.97	1,011,397.10	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	990	1,668.18	1,651,498.20	
	OPEN TEXT CORP	13,750	58.68	806,850.00	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	5,075	1,350.26	6,852,569.50	
	BCE INC	5,900	56.52	333,468.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,575	60.10	936,057.50	
	TELUS CORP	21,332	25.47	543,326.04	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	20.38	551,890.40	
	ALTAGAS LTD	11,770	18.77	220,922.90	
	ATCO LTD -CLASS I	4,130	38.16	157,600.80	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	3,630	63.11	229,089.30	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A(N)	1,815	63.11	114,544.65	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,320	31.99	234,166.80	
	EMERA INC	12,030	54.55	656,236.50	
	FORTIS INC	19,615	53.11	1,041,752.65	
	HYDRO ONE LTD	11,790	29.09	342,971.10	
加ドル小計		1,829,226		93,624,454.74 (7,643,500,484)	
ユーロ	ENI SPA	119,116	8.67	1,033,688.64	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	8.96	190,888.38	
	NESTE OYJ	18,920	57.64	1,090,548.80	
	OMV AG	7,890	32.34	255,162.60	
	REPSOL SA	57,649	8.62	496,934.38	
	TENARIS SA	19,915	6.71	133,669.48	
	TOTAL SE	117,777	36.60	4,310,638.20	
	VOPAK	3,530	42.67	150,625.10	
	AIR LIQUIDE SA	22,100	136.20	3,010,020.00	

AKZO NOBEL	8,597	86.44	743,124.68	
ARCELORMITTAL	35,962	17.38	625,307.25	
ARKEMA	3,045	95.00	289,275.00	
BASF SE	42,825	63.90	2,736,517.50	
COVESTRO AG	9,190	50.54	464,462.60	
CRH PLC	36,340	32.73	1,189,408.20	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,440	26.10	298,584.00	
FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	45.96	133,284.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	58.54	441,684.30	
KONINKLIJKE DSM NV	7,792	135.10	1,052,699.20	
LANXESS AG	3,115	60.74	189,205.10	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,840	37.76	447,078.40	
SOLVAY SA	3,231	97.40	314,699.40	
STORA ENSO OYJ-R SHS	29,305	14.87	435,911.87	
SYMRISE AG	6,400	106.35	680,640.00	
UMICORE	10,350	36.90	381,915.00	
UPM-KYMMENE OYJ	25,078	29.28	734,283.84	
VOESTALPINE AG	4,249	28.13	119,524.37	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	26.52	278,088.72	
AIRBUS GROUP SE	27,038	92.05	2,488,847.90	
ALSTOM	11,635	45.91	534,162.85	
BOUYGUES SA	11,990	33.85	405,861.50	
BRENNTAG AG	6,735	63.34	426,594.90	
CNH INDUSTRIAL NV	46,280	9.12	422,443.84	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	23,266	38.54	896,671.64	
DASSAULT AVIATION SA	135	896.50	121,027.50	
EIFFAGE	3,250	80.28	260,910.00	
FERROVIAL SA	23,315	23.29	543,006.35	
GEA GROUP AG	6,680	27.49	183,633.20	
HOCHTIEF AG	870	76.60	66,642.00	
KINGSPAN GROUP PLC	7,880	71.45	563,026.00	
KION GROUP AG	2,284	69.04	157,687.36	
KNORR-BREMSE AG	2,970	106.06	314,998.20	
KONE OYJ-B	16,134	67.22	1,084,527.48	
LEGRAND SA	11,278	70.88	799,384.64	

MTU AERO ENGINES AG	2,510	206.00	517,060.00	
PRYSMIAN SPA	13,115	27.52	360,924.80	
RATIONAL AG	230	718.50	165,255.00	
SAFRAN SA	15,600	119.30	1,861,080.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,138	116.15	2,919,778.70	
SIEMENS AG-REG	35,756	112.70	4,029,701.20	
SIEMENS ENERGY AG	20,123	25.65	516,154.95	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	28.50	335,160.00	
THALES SA	5,655	76.64	433,399.20	
VINCI SA	24,450	84.96	2,077,272.00	
WARTSILA OYJ ABP	21,180	8.20	173,803.08	
BUREAU VERITAS SA	14,440	22.57	325,910.80	
RANDSTAD NV	4,965	53.20	264,138.00	
TELEPERFORMANCE	2,640	264.60	698,544.00	
WOLTERS KLUWER	13,177	68.16	898,144.32	
ADP	1,090	105.00	114,450.00	
AENA SA	2,870	135.90	390,033.00	
ATLANTIA SPA	18,740	14.50	271,730.00	
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	9.75	116,415.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	45,953	39.25	1,803,655.25	
GETLINK	24,830	13.41	332,970.30	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,005	71.91	1,079,009.55	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	54.30	156,384.00	
CONTINENTAL AG	4,385	110.00	482,350.00	
DAIMLER AG	39,672	56.37	2,236,310.64	
FAURECIA	4,660	40.21	187,378.60	
FERRARI NV	5,904	178.90	1,056,225.60	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	51,557	13.82	712,517.74	
MICHELIN (CGDE)-B	8,259	106.70	881,235.30	
PEUGEOT SA	27,870	21.06	586,942.20	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	8,230	54.02	444,584.60	
RENAULT SA	10,857	35.73	387,974.89	
VALEO SA	12,380	31.70	392,446.00	
VOLKSWAGEN AG	1,441	154.50	222,634.50	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,153	139.68	1,278,491.04	

ADIDAS AG	9,041	287.50	2,599,287.50	
ESSILORLUXOTTICA	13,385	129.55	1,734,026.75	
HERMES INTERNATIONAL	1,367	844.60	1,154,568.20	
KERING	3,407	564.10	1,921,888.70	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,879	509.20	6,557,986.80	
MONCLER SPA	8,860	47.88	424,216.80	
PUMA SE	4,530	84.44	382,513.20	
SEB SA	1,300	145.00	188,500.00	
ACCOR SA	7,646	29.48	225,404.08	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,946	165.65	1,150,604.90	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	35.56	138,684.00	
SODEXO	4,090	72.14	295,052.60	
BOLLORE	47,430	3.39	161,072.28	
PUBLICIS GROUPE	8,645	40.92	353,753.40	
SCOUT24 AG	5,880	66.45	390,726.00	
SES	21,670	7.78	168,592.60	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,800	77.00	369,600.00	
VIVENDI	38,320	25.73	985,973.60	
DELIVERY HERO SE	5,680	114.65	651,212.00	
HELLOFRESH SE	6,670	60.70	404,869.00	
INDITEX	52,245	27.45	1,434,125.25	
JUST EAT TAKEAWAY	6,500	87.26	567,190.00	
PROSUS	22,600	90.08	2,035,808.00	
ZALANDO SE	7,390	84.52	624,602.80	
CARREFOUR SA	31,793	13.75	437,153.75	
COLRUYT SA	2,305	49.20	113,406.00	
JERONIMO MARTINS	9,035	14.58	131,730.30	
KESKO OYJ-B SHS	12,330	20.66	254,737.80	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	51,068	23.43	1,196,523.24	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,991	57.60	1,957,881.60	
DANONE	28,464	52.46	1,493,221.44	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	31,170	9.36	291,938.22	
HEINEKEN HOLDING NV	6,325	79.80	504,735.00	
HEINEKEN NV	12,123	91.98	1,115,073.54	
KERRY GROUP PLC-A	7,010	120.90	847,509.00	
PERNOD-RICARD SA	9,796	160.65	1,573,727.40	

REMY COINTREAU	810	151.00	122,310.00	
BEIERSDORF AG	5,415	92.24	499,479.60	
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	78.20	351,118.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,693	88.56	681,292.08	
L'OREAL	11,756	302.70	3,558,541.20	
UNILEVER PLC	68,305	47.84	3,267,711.20	
AMPLIFON SPA	5,620	33.61	188,888.20	
BIOMERIEUX	2,140	119.70	256,158.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	108.00	205,200.00	
DIASORIN SPA	1,330	170.70	227,031.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,343	67.78	633,268.54	
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,955	38.02	682,649.10	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,740	43.03	1,796,280.90	
ORPEA	2,780	107.10	297,738.00	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,810	362.60	656,306.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	40.45	454,309.65	
ARGENX SE	2,260	254.00	574,040.00	
BAYER AG-REG	47,284	47.16	2,229,913.44	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,950	66.63	396,448.50	
GALAPAGOS NV	1,710	98.12	167,785.20	
GRIFOLS SA	16,550	24.68	408,454.00	
IPSEN	1,350	69.00	93,150.00	
MERCK KGAA	6,090	135.95	827,935.50	
ORION OYJ-CLASS B	5,150	38.04	195,906.00	
QIAGEN N.V.	12,144	42.79	519,641.76	
RECORDATI SPA	3,920	44.77	175,498.40	
SANOFI	52,926	77.85	4,120,289.10	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,160	291.40	338,024.00	
UCB SA	6,838	87.40	597,641.20	
ABN AMRO BANK NV-CVA	22,380	8.09	181,143.72	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	297,973	4.02	1,200,235.24	
BANCO SANTANDER SA	812,949	2.62	2,132,365.22	
BNP PARIBAS	53,282	44.15	2,352,400.30	
CAIXABANK S.A	134,350	2.23	299,600.50	
COMMERZBANK AG	48,544	5.13	249,127.80	

CREDIT AGRICOLE SA	45,692	10.48	479,080.62	
ERSTE GROUP BANK AG	12,928	25.04	323,717.12	
FINECOBANK SPA	26,120	13.11	342,433.20	
ING GROEP NV-CVA	181,635	7.90	1,436,006.31	
INTESA SANPAOLO	729,993	1.93	1,415,602.42	
KBC GROEP NV	11,839	60.34	714,365.26	
MEDIOBANCA SPA	33,950	7.35	249,600.40	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	16.47	127,807.20	
SOCIETE GENERALE	41,059	16.99	697,674.52	
UNICREDIT SPA	96,946	7.69	745,902.52	
AMUNDI SA	3,300	66.55	219,615.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	85,645	8.79	753,247.77	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,000	138.55	1,246,950.00	
EURAZEO SE	1,877	55.00	103,235.00	
EXOR NV	5,564	59.64	331,836.96	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,252	81.72	510,913.44	
NATIXIS	49,540	2.61	129,695.72	
SOFINA	800	264.50	211,600.00	
WENDEL	1,000	98.60	98,600.00	
AEGON NV	77,949	2.97	231,976.22	
AGEAS	9,104	42.15	383,733.60	
ALLIANZ SE-REG	19,498	191.98	3,743,226.04	
ASSICURAZIONI GENERALI	49,048	14.26	699,424.48	
AXA SA	90,332	19.67	1,777,553.09	
CNP ASSURANCES	6,040	12.95	78,218.00	
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	132.10	403,565.50	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,156	238.40	1,467,590.40	
NN GROUP NV	14,100	33.50	472,350.00	
POSTE ITALIANE SPA	19,560	8.35	163,326.00	
SAMPO OYJ-A SHS	24,259	34.50	836,935.50	
SCOR SE	7,452	27.04	201,502.08	
AROUNDTOWN SA	56,420	6.18	349,126.96	
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,170	42.72	690,782.40	
LEG IMMOBILIEN AG	3,800	121.34	461,092.00	
VONOVIA SE	24,148	57.62	1,391,407.76	

ADYEN NV	840	1,837.00	1,543,080.00	
AMADEUS IT GROUP SA	21,670	59.92	1,298,466.40	
ATOS SE	5,240	73.18	383,463.20	
BECHTLE AG	1,230	174.90	215,127.00	
CAP GEMINI SA	7,059	115.10	812,490.90	
DASSAULT SYSTEMES SA	6,010	156.30	939,363.00	
EDENRED	9,626	46.01	442,892.26	
NEMETSCHEK SE	3,020	57.10	172,442.00	
NEXI SPA	20,200	16.10	325,220.00	
SAP SE	48,412	99.93	4,837,811.16	
TEAMVIEWER AG	7,050	39.80	280,590.00	
WORLDLINE SA	10,250	75.14	770,185.00	
NOKIA OYJ	257,166	3.27	841,447.15	
ALTICE EUROPE NV	34,400	4.40	151,463.20	
CELLNEX TELECOM SA	15,470	51.28	793,301.60	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	149,266	14.79	2,207,644.14	
ELISA OYJ	5,465	44.81	244,886.65	
ILIAD SA	566	174.15	98,568.90	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	10,000	9.90	99,000.00	
KONINKLIJKE KPN NV	194,906	2.46	479,663.66	
ORANGE S.A.	91,354	10.00	913,540.00	
PROXIMUS	8,290	17.32	143,582.80	
TELECOM ITALIA SPA	317,713	0.38	122,351.27	
TELECOM ITALIA-RSP	334,757	0.41	140,162.75	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	54,770	2.27	124,492.21	
TELEFONICA SA	239,039	3.52	842,851.51	
TELEFONICA SA-RTS(N)	239,039	0.19	46,636.50	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	33.74	134,960.00	
E.ON SE	99,789	8.85	883,930.96	
EDF	32,475	12.37	401,715.75	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	121,971	4.80	585,460.80	
ELIA GROUP SA/NV	1,600	94.00	150,400.00	
ENAGAS SA	12,350	20.38	251,693.00	
ENDESA SA	16,390	22.75	372,872.50	
ENEL SPA	379,757	8.12	3,084,386.35	

	ENGIE	89,854	12.52	1,125,421.35	
	FORTUM OYJ	16,415	18.79	308,437.85	
	IBERDROLA SA	281,632	11.28	3,178,217.12	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	19.41	294,100.32	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	16.86	324,049.20	
	RWE AG	31,835	33.14	1,055,011.90	
	SNAM SPA	79,380	4.56	362,210.94	
	SUEZ	13,289	15.90	211,295.10	
	TERNA SPA	77,357	6.10	472,187.12	
	UNIPER SE	7,030	27.90	196,137.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,664	19.61	405,324.36	
	VERBUND AG	2,780	59.65	165,827.00	
	ASML HOLDING NV	19,762	376.00	7,430,512.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	57,585	29.45	1,695,878.25	
	STMICROELECTRONICS NV	28,543	28.95	826,319.85	
ユーロ小計		8,945,384		192,659,901.20 (24,390,743,491)	
英ポンド	BP PLC	944,788	2.69	2,548,565.63	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	191,268	13.60	2,601,627.33	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	170,689	13.09	2,235,001.76	
	ANGLO AMERICAN PLC	59,484	24.05	1,430,590.20	
	ANTOFAGASTA PLC	20,030	14.16	283,624.80	
	BHP GROUP PLC	94,441	19.40	1,832,533.16	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	64.04	353,564.84	
	EVRAZ PLC	27,180	4.55	123,750.54	
	GLENCORE PLC	481,513	2.35	1,136,129.92	
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,079	24.10	267,003.90	
	MONDI PLC	20,970	17.85	374,314.50	
	RIO TINTO PLC	51,925	55.42	2,877,683.50	
	ASHTEAD GROUP PLC	19,360	33.48	648,172.80	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	139,615	5.04	703,659.60	
	BUNZL PLC	13,836	24.79	342,994.44	
	DCC PLC	5,200	54.98	285,896.00	
	FERGUSON PLC	11,232	87.56	983,473.92	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	222,780	1.63	363,131.40	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	347,631	1.18	412,811.81	
SMITHS GROUP PLC	21,173	15.88	336,227.24	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	115.00	453,100.00	
EXPERIAN PLC	44,268	27.51	1,217,812.68	
INTERTEK GROUP PLC	8,415	57.90	487,228.50	
RELX PLC	89,775	17.95	1,611,461.25	
RENTOKIL INITIAL PLC	94,500	5.00	473,256.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	6.05	246,600.32	
BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	43.25	288,910.00	
BURBERRY GROUP PLC	23,124	18.26	422,359.86	
PERSIMMON PLC	13,570	25.84	350,648.80	
TAYLOR WIMPEY PLC	207,190	1.56	324,770.32	
COMPASS GROUP PLC	77,708	14.49	1,125,988.92	
ENTAIN PLC	30,970	10.88	336,953.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,283	46.79	434,351.57	
WHITBREAD PLC	10,770	31.05	334,408.50	
AUTO TRADER GROUP PLC	48,880	5.74	280,571.20	
INFORMA PLC	72,880	5.54	404,046.72	
PEARSON PLC	26,259	6.62	173,887.09	
WPP PLC	50,104	7.83	392,715.15	
JD SPORTS FASHION PLC	15,420	7.90	121,910.52	
KINGFISHER PLC	114,937	2.70	310,444.83	
NEXT PLC	6,767	67.46	456,501.82	
OCADO GROUP PLC	20,060	22.75	456,365.00	
SAINSBURY (J) PLC	97,801	2.26	221,030.26	
TESCO PLC	462,864	2.26	1,047,461.23	
WM MORRISON SUPERMARKETS	129,955	1.80	234,763.70	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,905	22.84	431,790.20	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	107,097	28.85	3,090,283.93	
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	23.32	179,330.80	
DIAGEO PLC	109,172	29.94	3,268,609.68	
IMPERIAL BRANDS PLC	41,212	15.64	644,555.68	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,145	65.44	2,169,008.80	
UNILEVER PLC	53,377	43.63	2,328,838.51	
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—	

	SMITH & NEPHEW PLC	45,766	15.28	699,304.48	
	ASTRAZENECA PLC	60,863	76.92	4,681,581.96	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	234,361	13.92	3,264,180.00	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	25.16	193,480.40	
	BARCLAYS PLC	754,951	1.42	1,074,748.24	
	HSBC HOLDINGS PLC	943,661	4.03	3,806,728.47	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,162,336	0.35	1,129,902.65	
	NATWEST GROUP PLC	181,130	1.57	285,913.70	
	STANDARD CHARTERED PLC	131,430	4.74	623,898.21	
	3I GROUP PLC	50,419	11.36	573,011.93	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	14.44	188,073.90	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,857	87.10	1,294,044.70	
	M&G PLC	134,322	1.89	254,405.86	
	SCHRODERS PLC	6,901	32.10	221,522.10	
	ST JAMES'S PLACE PLC	19,260	10.81	208,200.60	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	2.78	346,217.27	
	ADMIRAL GROUP PLC	10,865	28.65	311,282.25	
	AVIVA PLC	199,265	3.20	638,245.79	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	2.97	219,040.83	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	255,901	2.48	636,937.58	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	7.07	175,505.94	
	PRUDENTIAL PLC	126,302	13.13	1,658,345.26	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	6.76	372,732.88	
	AVEVA GROUP PLC	6,115	31.70	193,845.50	
	SAGE GROUP PLC/THE	57,710	5.86	338,180.60	
	HALMA PLC	16,450	23.63	388,713.50	
	BT GROUP PLC	355,852	1.34	477,909.23	
	VODAFONE GROUP PLC	1,300,728	1.31	1,706,034.84	
	NATIONAL GRID PLC	168,978	8.80	1,488,358.22	
	SEVERN TRENT PLC	11,503	23.10	265,719.30	
	SSE PLC	50,927	14.44	735,640.51	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	37,015	9.31	344,905.77	
英ポンド小計		13,581,637		73,257,335.20 (10,177,641,579)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	17.96	135,995.05	

EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	460	821.00	377,660.00	
GIVAUDAN-REG	408	3,632.00	1,481,856.00	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	22,379	46.47	1,039,952.13	
SIKA AG-REG	6,380	230.90	1,473,142.00	
ABB LTD-REG	89,325	23.88	2,133,081.00	
GEBERIT AG-REG	1,560	527.00	822,120.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	242.40	254,520.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,220	247.00	548,340.00	
ADECCO GROUP AG-REG	5,477	57.00	312,189.00	
SGS SA-REG	258	2,600.00	670,800.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,570	199.55	512,843.50	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	24,859	77.34	1,922,595.06	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,670	228.80	382,096.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	44.54	82,399.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	175	2,030.00	355,250.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	8,305.00	365,420.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	85,900.00	343,600.00	
NESTLE SA-REG	133,863	99.70	13,346,141.10	
ALCON INC	21,414	57.42	1,229,591.88	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,381	222.20	529,058.20	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	450	1,020.00	459,000.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,633	552.40	2,006,869.20	
NOVARTIS AG-REG	103,083	81.26	8,376,524.58	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,618	304.25	9,924,026.50	
VIFOR PHARMA AG	2,520	132.60	334,152.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,500	94.80	142,200.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	109,268	11.12	1,215,060.16	
JULIUS BAER GROUP LTD	11,750	49.44	580,920.00	
PARTNERS GROUP HOLDIING AG	820	971.60	796,712.00	
UBS GROUP AG-REG	171,042	12.43	2,126,907.27	
BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	151.40	376,986.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,510	398.20	601,282.00	
SWISS RE AG	12,249	80.58	987,024.42	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,041	357.00	2,513,637.00	
SWISS PRIME SITE-REG	4,291	86.35	370,527.85	

	TEMENOS AG	3,470	114.60	397,662.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	79.54	529,736.40	
	SWISSCOM AG-REG	1,094	475.90	520,634.60	
スイスフラン小計		801,406		60,578,511.90 (7,115,552,007)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	10,270	224.70	2,307,669.00	
	BOLIDEN AB	10,890	279.90	3,048,111.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	32,900	141.60	4,658,640.00	
	ALFA LAVAL AB	17,850	222.70	3,975,195.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,110	205.00	8,632,550.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	33,225	427.70	14,210,332.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,120	372.80	7,127,936.00	
	EPIROC AB-A	27,585	148.45	4,094,993.25	
	EPIROC AB-B	15,450	140.80	2,175,360.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	193.20	1,313,760.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,840	260.70	4,390,188.00	
	SANDVIK AB	48,250	199.60	9,630,700.00	
	SKANSKA AB-B SHS	19,210	204.80	3,934,208.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	217.60	4,332,198.40	
	VOLVO AB-B SHS-B	70,800	192.30	13,614,840.00	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	135.20	1,977,840.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,095	197.55	1,599,167.25	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	105.30	1,579,500.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,910	813.20	5,619,212.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	37,258	183.00	6,818,214.00	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	411.20	1,739,376.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,140	648.80	5,281,232.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	27,565	271.40	7,481,141.00	
	NORDEA BANK ABP	147,922	73.17	10,823,452.74	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	78,050	88.50	6,907,425.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	66,610	82.98	5,527,297.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,490	155.96	6,158,860.40	
	EQT AB	12,440	191.65	2,384,126.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	260.30	1,556,594.00	
	INVESTOR AB-B SHS	21,615	587.20	12,692,328.00	

	KINNEVIK AB - B	12,405	390.95	4,849,734.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	433.00	1,723,340.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,570	427.30	1,952,761.00	
	ERICSSON LM-B SHS	130,755	99.38	12,994,431.90	
	HEXAGON AB-B SHS	13,360	694.00	9,271,840.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,705	111.35	2,082,801.75	
	TELIA CO AB	94,230	34.58	3,258,473.40	
スウェーデンクローナ小計		1,163,148		201,725,830.94 (2,503,417,561)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	50,344	147.25	7,413,154.00	
	NORSK HYDRO A S	62,840	39.49	2,481,551.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,470	348.40	3,299,348.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	133.20	1,518,480.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	294.20	1,512,188.00	
	MOWI ASA	15,340	178.35	2,735,889.00	
	ORKLA ASA	38,170	85.28	3,255,137.60	
	DNB ASA	49,935	162.30	8,104,450.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,470	184.30	2,113,921.00	
	TELENOR ASA	33,565	150.90	5,064,958.50	
ノルウェークローネ小計		287,674		37,499,078.20 (447,738,993)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,350	610.80	3,267,780.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	341.20	2,700,598.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	9,080	1,268.50	11,517,980.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	12,670.00	1,457,050.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	283	13,485.00	3,816,255.00	
	DSV PANALPINA A S	9,440	980.00	9,251,200.00	
	PANDORA A/S	4,080	618.40	2,523,072.00	
	CARLSBERG AS-B	5,350	953.00	5,098,550.00	
	AMBU A/S-B	8,710	213.00	1,855,230.00	
	COLOPLAST-B	5,385	936.20	5,041,437.00	
	DEMANT A/S	4,410	230.50	1,016,505.00	
	GN STORE NORD A/S	6,950	493.50	3,429,825.00	
	GENMAB A/S	3,150	2,420.00	7,623,000.00	
	H LUNDBECK A/S	2,100	205.60	431,760.00	

	NOVO NORDISK A/S-B	79,805	426.70	34,052,793.50	
	DANSKE BANK A/S	31,805	101.05	3,213,895.25	
	TRYG A/S	6,075	182.20	1,106,865.00	
	ORSTED A/S	8,630	1,076.00	9,285,880.00	
デンマーククローネ小計		198,633		106,689,675.75 (1,814,791,384)	
豪ドル	AMPOL LTD	14,105	30.64	432,177.20	
	OIL SEARCH LTD	77,602	3.75	291,007.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	89,820	5.05	453,591.00	
	SANTOS LTD	94,995	6.57	624,117.15	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,333	23.19	888,942.27	
	BHP GROUP LTD	136,396	42.74	5,829,565.04	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	17.03	311,819.30	
	EVOLUTION MINING LTD	87,400	4.80	419,520.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	81,535	22.16	1,806,815.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	23,075	37.26	859,774.50	
	NEWCREST MINING LTD	41,779	26.81	1,120,094.99	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	31,690	12.17	385,667.30	
	ORICA LIMITED	20,325	15.56	316,257.00	
	RIO TINTO LTD	17,198	113.94	1,959,540.12	
	SOUTH32 LTD	255,347	2.60	663,902.20	
	CIMIC GROUP LTD	4,887	25.70	125,595.90	
	BRAMBLES LTD	78,698	10.57	831,837.86	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	4.18	307,522.60	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	5.07	223,080.00	
	SYDNEY AIRPORT	66,676	6.59	439,394.84	
	TRANSURBAN GROUP	134,769	13.75	1,853,073.75	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,290	30.01	758,952.90	
	CROWN RESORTS LTD	19,095	9.79	186,940.05	
	TABCORP HOLDINGS LTD	84,274	3.95	332,882.30	
	REA GROUP LTD	3,030	143.74	435,532.20	
	SEEK LTD	17,930	26.69	478,551.70	
	WESFARMERS LTD	52,315	50.94	2,664,926.10	
	COLES GROUP LTD	62,585	18.18	1,137,795.30	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	55,382	39.17	2,169,312.94	

	COCA-COLA AMATIL LTD	18,190	12.79	232,650.10	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,246	9.39	340,349.94	
	COCHLEAR LTD	2,917	195.72	570,915.24	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,995	63.00	566,685.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,610	32.54	703,189.40	
	CSL LTD	21,232	286.50	6,082,968.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	137,689	23.18	3,191,631.02	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	82,737	83.92	6,943,289.04	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	153,493	23.55	3,614,760.15	
	WESTPAC BANKING CORP	171,631	20.03	3,437,768.93	
	AMP LTD	156,627	1.74	273,314.11	
	ASX LTD	10,195	75.06	765,236.70	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,714	137.80	2,303,189.20	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,820	54.83	264,280.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.12	487,040.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	142,760	2.87	409,721.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	64,150	9.86	632,519.00	
	SUNCORP GROUP LTD	70,376	10.16	715,020.16	
	AFTERPAY LTD	9,420	109.93	1,035,540.60	
	COMPUTERSHARE LTD	25,050	14.35	359,467.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,130	30.46	156,259.80	
	XERO LTD	5,480	143.94	788,791.20	
	TELSTRA CORPORATION LTD	231,884	3.03	702,608.52	
	TPG TELECOM LTD	21,450	7.18	154,011.00	
	AGL ENERGY LTD	35,761	13.51	483,131.11	
	APA GROUP	66,218	10.25	678,734.50	
	AUSNET SERVICES	72,810	1.84	134,334.45	
豪ドル小計		3,439,121		64,335,596.08 (5,049,700,936)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	7.95	449,294.25	
	A2 MILK CO LTD	38,820	14.06	545,809.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	25,140	32.07	806,239.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	19,940	15.00	299,100.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.50	344,979.38	
	MERCURY NZ LTD	34,000	6.25	212,500.00	

	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	6.53	300,249.40	
ニュージーランドドル小計		296,972		2,958,172.03 (218,165,187)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,708	55.05	7,690,925.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	103.50	6,675,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	82,000	18.76	1,538,320.00	
	MTR CORP	82,000	42.55	3,489,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	92,000	60.65	5,579,800.00	
	SANDS CHINA LTD	130,600	34.45	4,499,170.00	
	SJM HOLDINGS LTD	91,000	9.15	832,650.00	
	WYNN MACAU LTD	63,000	13.64	859,320.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	26.65	1,809,535.00	
	WH GROUP LTD	530,500	6.50	3,448,250.00	
	BANK OF EAST ASIA	76,040	17.02	1,294,200.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	24.65	3,697,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,700	136.90	5,024,230.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	56,300	387.80	21,833,140.00	
	AIA GROUP LTD	560,790	90.00	50,471,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	127,708	42.95	5,485,058.60	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	23.95	1,815,410.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	19.84	1,547,520.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	31.15	2,270,866.15	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	37.00	2,688,642.00	
	SINO LAND CO	143,050	10.68	1,527,774.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,980	105.30	5,578,794.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	44.90	786,513.30	
	SWIRE PROPERTIES LTD	66,000	23.35	1,541,100.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	40.05	2,555,190.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	214,000	10.32	2,208,480.00	
	PCCW LTD	231,000	4.82	1,113,420.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	39.80	995,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	75,500	70.85	5,349,175.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.71	732,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	451,655	11.72	5,293,396.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	40.90	2,249,500.00	

	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,800	98.55	1,754,190.00	
香港ドル小計		4,158,415		164,235,470.85 (2,205,682,373)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	5.29	282,274.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	86,700	3.87	335,529.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	4.42	238,238.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.85	179,435.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.23	312,850.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	88,615	25.45	2,255,251.75	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	167,240	10.13	1,694,141.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,500	22.92	1,340,820.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,700	9.35	371,195.00	
	CAPITALAND LTD	145,700	3.27	476,439.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.97	137,881.00	
	UOL GROUP LTD	26,150	7.71	201,616.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.95	187,605.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	409,080	2.35	961,338.00	
シンガポールドル小計		1,441,205		8,974,614.65 (700,917,404)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	36,890	15.41	568,474.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	390.20	468,240.00	
	BANK HAPOALIM BM	60,335	22.39	1,350,900.65	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	19.60	1,117,298.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,400	12.13	781,172.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	71.00	347,900.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	202.80	271,752.00	
	NICE LTD	3,355	796.80	2,673,264.00	
イスラエルシュケル小計		229,425		7,579,001.55 (242,149,099)	
合　　計		50,831,345		218,512,410,943 (218,512,410,943)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	31,970	489,141.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	905,629.20	
		AMERICAN TOWER CORP	20,729	4,492,388.88	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	501,816.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,785	1,083,360.95	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,977	588,734.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,330	514,345.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	19,820	3,075,865.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,085	1,676,057.65	
		DUKE REALTY CORPORATION	19,465	753,490.15	
		EQUINIX INC	4,208	2,903,646.24	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	384,174.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,430	1,067,097.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,140	754,416.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	561,486.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,055	810,228.40	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	39,369	552,347.07	
		INVITATION HOMES INC	22,810	656,471.80	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	343,190.75	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	418,080.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,520	670,348.80	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	418,388.40	
		PROLOGIS INC	34,468	3,338,915.16	
		PUBLIC STORAGE	7,049	1,577,143.26	
		REALTY INCOME CORP	15,030	911,118.60	
		REGENCY CENTERS CORP	6,695	313,861.60	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,830	1,324,241.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,394	1,344,204.08	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	627,303.60	
		UDR INC	16,160	607,454.40	
		VENTAS INC	17,135	819,738.40	
		VEREIT INC	37,964	285,109.64	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	541,609.20	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	260,886.08	

		WELLTOWER INC	19,850	1,255,314.00	
		WEYERHAEUSER CO	36,698	1,187,547.28	
		WP CAREY INC	9,580	662,552.80	
米ドル小計			618,652	38,677,703.99 (4,027,122,539)	
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	4,700	238,572.00	
		NORTHLAND POWER INC	8,600	384,678.00	
加ドル小計			13,300	623,250.00 (50,882,130)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	2,655	199,656.00	
		GECINA SA	2,350	296,100.00	
		KLEPIERRE	10,512	195,207.84	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,700	468,622.00	
ユーロ小計			23,217	1,159,585.84 (146,803,567)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	49,131	236,909.68	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	238,255.32	
		SEGRO PLC	62,233	565,573.50	
英ポンド小計			145,498	1,040,738.50 (144,589,799)	
豪ドル	投資証券	DEXUS	57,587	566,080.21	
		GOODMAN GROUP	75,982	1,352,479.60	
		GPT GROUP	71,335	338,127.90	
		LENDLEASE GROUP	28,927	393,696.47	
		MIRVAC GROUP	208,775	569,955.75	
		SCENTRE GROUP	198,271	553,176.09	
		STOCKLAND	96,900	429,267.00	
		VICINITY CENTRES	191,002	320,883.36	
豪ドル小計			928,779	4,523,666.38 (355,062,574)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	101,800	7,044,560.00	
香港ドル小計			101,800	7,044,560.00 (94,608,440)	
シンガポールド	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	166,243	493,741.71	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	249,428	538,764.48	

ル		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,400	256,154.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	269,040.07	
		SUNTEC REIT	91,400	138,928.00	
シンガポールドル小計			767,870	1,696,628.26 (132,506,667)	
合計				4,951,575,716 (4,951,575,716)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式　595銘柄	97.5%	—	69.7%
	投資証券　37銘柄	—	2.5%	1.8%
加ドル	株式　85銘柄	99.3%	—	3.4%
	投資証券　2銘柄	—	0.7%	0.0%
ユーロ	株式　235銘柄	99.4%	—	10.9%
	投資証券　4銘柄	—	0.6%	0.1%
英ポンド	株式　85銘柄	98.6%	—	4.6%
	投資証券　3銘柄	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	3.2%
スウェーデンクローナ	株式　37銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式　10銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　18銘柄	100.0%	—	0.8%
豪ドル	株式　56銘柄	93.4%	—	2.3%
	投資証券　8銘柄	—	6.6%	0.2%
ニュージーランドドル	株式　7銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式　33銘柄	95.9%	—	1.0%
	投資証券　1銘柄	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	84.1%	—	0.3%
	投資証券　5銘柄	—	15.9%	0.1%
イスラエルシュケル	株式　8銘柄	100.0%	—	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年12月30日現在です。

【世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	31,390,651,287円
Ⅱ　負債総額	42,021,025円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,348,630,262円
Ⅳ　発行済口数	34,738,988,954口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9024円

（参考）

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	99,587,992,173円
Ⅱ　負債総額	4,084,059円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	99,583,908,114円
Ⅳ　発行済口数	45,353,742,796口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1957円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	93,137,767,050円
Ⅱ　負債総額	10,777,830円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	93,126,989,220円
Ⅳ　発行済口数	46,860,589,697口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9873円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	45,196,080,405円
Ⅱ　負債総額	202,800,866円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	44,993,279,539円
Ⅳ　発行済口数	31,818,112,817口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4141円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	154,616,176,689円
Ⅱ　負債総額	261,047,643円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	154,355,129,046円
Ⅳ　発行済口数	62,083,881,848口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4862円

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	36,604,551,917円
Ⅱ　負債総額	6,119,051円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	36,598,432,866円
Ⅳ　発行済口数	21,304,259,837口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7179円

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	224,101,369,326円
Ⅱ　負債総額	50,349,078円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	224,051,020,248円
Ⅳ　発行済口数	72,370,614,408口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0959円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換

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

いものとします。

（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　受益権の譲渡

・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③　受益権の譲渡の対抗要件

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

（４）受益証券の再発行

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2020年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去５年間における主な資本金の増減　：　該当事項はありません。

（２）会社の意思決定機関（2020年12月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年３月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年３月31日（事業年度の終了）から３ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、５名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

（３）運用の意思決定プロセス（2020年12月末現在）

１．投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
２．各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
３．各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
４．トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
５．運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理／コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

２【事業の内容及び営業の概況】

・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
・委託会社の運用する、2020年12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種　類			ファンド本数	純資産額 （単位：億円）
投資信託総合計			849	240,912
	株式投資信託		790	206,595
		単位型	277	11,306
		追加型	513	195,289
	公社債投資信託		59	34,316
		単位型	46	1,842
		追加型	13	32,474

3【委託会社等の経理状況】

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

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第61期事業年度（2019年４月１日から2020年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第62期中間会計期間（2020年４月１日から2020年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第60期 (2019年３月31日)		第61期 (2020年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	20,680		24,591
有価証券		1		19
前払費用		495		603
未収入金		38		14
未収委託者報酬		16,867		16,912
未収収益	※3	618	※3	1,412
関係会社短期貸付金		2,408		2,371
立替金		791		1,437
その他	※2	869	※2	1,316
流動資産合計		42,769		48,679
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	136	※1	182
器具備品	※1	137	※1	135
有形固定資産合計		274		318
無形固定資産				

ソフトウエア	107	120
無形固定資産合計	107	120
投資その他の資産		
投資有価証券	16,755	17,826
関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	447	484
繰延税金資産	1,913	2,022
投資その他の資産合計	44,886	46,102
固定資産合計	45,268	46,540
資産合計	88,038	95,220

（単位：百万円）

		第60期 (2019年３月31日)		第61期 (2020年３月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		354		554
未払金		6,112		5,881
未払収益分配金		7		8
未払償還金		71		71
未払手数料	※3	5,299		5,202
その他未払金		734		599
未払費用	※3	3,897	※3	4,289
未払法人税等		2,382		1,439
未払消費税等	※4	621	※4	746
賞与引当金		2,680		2,718
役員賞与引当金		210		55
その他	※3	172		42
流動負債合計		16,431		15,726
固定負債				
退職給付引当金		1,405		1,395
その他		629		695
固定負債合計		2,035		2,091
負債合計		18,466		17,818
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		47,142		55,395
利益剰余金合計		47,142		55,395
自己株式		△833		△905
株主資本合計		68,891		77,073

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	493	△60
繰延ヘッジ損益	185	389
評価・換算差額等合計	679	329
純資産合計	69,571	77,402
負債純資産合計	88,038	95,220

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第60期 (自　2018年４月１日 至　2019年３月31日)	第61期 (自　2019年４月１日 至　2020年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	77,264	74,265
その他営業収益	3,063	2,994
営業収益合計	80,328	77,259
営業費用		
支払手数料	32,834	31,322
広告宣伝費	960	953
公告費	2	2
調査費	18,251	17,275
調査費	890	920
委託調査費	17,333	16,333
図書費	27	21
委託計算費	541	534
営業雑経費	794	1,058
通信費	128	116
印刷費	334	337
協会費	69	52
諸会費	19	10
その他	243	541
営業費用計	53,385	51,148
一般管理費		
給料	9,783	9,857
役員報酬	241	360
役員賞与引当金繰入額	210	55
給料・手当	6,589	6,675
賞与	61	64
賞与引当金繰入額	2,680	2,702
交際費	92	92
寄付金	13	29
旅費交通費	476	420
租税公課	428	440
不動産賃借料	888	901
退職給付費用	378	387
退職金	52	82
固定資産減価償却費	108	118
福利費	1,071	1,014
諸経費	3,106	3,229
一般管理費計	16,401	16,573
営業利益	10,540	9,538

（単位：百万円）

		第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）		第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
営業外収益				
受取利息		37		99
受取配当金	※１	1,865	※１	4,881
有価証券償還益		1		－
デリバティブ収益	※１	142		223
時効成立分配金・償還金		21		1
為替差益		58		5
その他		48		145
営業外収益合計		2,176		5,357
営業外費用				
支払利息	※１	286		185
有価証券償還損		－		0
時効成立後支払分配金・償還金		78		1
その他		24		12
営業外費用合計		388		199
経常利益		12,328		14,695
特別利益				
投資有価証券売却益		218		164
特別利益合計		218		164
特別損失				
投資有価証券売却損		176		19
投資有価証券評価損		－		21
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		180		－
特別損失合計		357		41
税引前当期純利益		12,189		14,818
法人税、住民税及び事業税		3,741		3,307
法人税等調整額		△375		45
法人税等合計		3,366		3,353
当期純利益		8,823		11,465

（３）【株主資本等変動計算書】

第60期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	△786	61,756
当期変動額							

剰余金の配当				△1,640	△1,640		△1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						△47	△47
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	7,182	7,182	△47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	△833	68,891

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

第61期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	△833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				△3,212	△3,212		△3,212
当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						△71	△71
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	8,252	8,252	△71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	△905	77,073

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				△3,212
当期純利益				11,465

自己株式の取得				△71
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△553	204	△349	△349
当期変動額合計	△553	204	△349	7,831
当期末残高	△60	389	329	77,402

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　３年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(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。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。

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

（未適用の会計基準等）

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

（１）　概要
収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。
ステップ１：顧客との契約を識別する。
ステップ２：契約における履行義務を識別する。
ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（２）　適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

（３）　当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,281百万円 器具備品　655百万円	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,311百万円 器具備品　707百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　1,347百万円 未収収益　127百万円 (流動負債) 未払手数料　350百万円 未払費用　767百万円 その他　162百万円	※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益　151百万円 (流動負債) 未払費用　623百万円
※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。	※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　1,831百万円 デリバティブ収益　54百万円 支払利息　75百万円	※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　4,849百万円

（株主資本等変動計算書関係）

第60期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

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

2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	―	―	3,618,000	―
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	―	66,000	3,811,000	―
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	―	4,422,000	66,000	4,356,000	―
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	―

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

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第61期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

1　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,365,700	88,800	―	1,454,500

3　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	―	1,171,500	―	―
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	―	75,900	―	―
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	―	871,200	1,184,700	―
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	―	2,272,000	1,346,000	―
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	―	1,417,000	2,394,000	―
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	―	1,417,000	2,939,000	―
合計		15,088,300	―	7,224,600	7,863,700	―

(注) 1　当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
2　2011年度ストックオプション(1)1,184,700株、2016年度ストックオプション(1)881,000株及び2016年度ストックオプション(2)804,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)465,000株、2016年度ストックオプション(2)1,590,000株及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年６月12日取締役会	普通株式	利益剰余金	2,862	14.64	2020年３月31日	2020年７月１日

(リース取引関係)

第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）		第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	
オペレーティング・リース取引		オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	853百万円	１年内	912百万円
１年超	6,704百万円	１年超	6,148百万円
合計	7,558百万円	合計	7,060百万円

（金融商品関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１ 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ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、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ

会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに（4）関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

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

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

4　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債

権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ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、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「４　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２ 金融商品の時価等に関する事項

2020年３月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	－
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	－
(3) 未収収益	1,412	1,412	－
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	－
(5) 有価証券及び投資有価証券			

その他有価証券	17,828	17,828	－
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	－
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	－
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	－
デリバティブ取引計	142	142	－

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに（4）関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち15百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、41百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち167百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

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

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

4　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	－	－	－
未収委託者報酬	16,912	－	－	－
未収収益	1,412	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

（有価証券関係）
第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)
1　子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2　その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

1　子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2　その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	5,381	4,912	469
	小計	5,381	4,912	469
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	12,447	13,003	△556
	小計	12,447	13,003	△556
合計		17,828	17,915	△86

(注) 1　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円（その他有価証券の投資信託）減損処理を行っております。
2　非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,230	164	19
合計	2,230	164	19

（デリバティブ取引関係）
第60期(2019年３月31日)
1　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1) 株式関連

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

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2,251	－	△42
	豪ドル		63	－	△0
	シンガポールドル		975	－	△18

	香港ドル		518	－	△8
	人民元		2,149	－	△58
	ユーロ		81	－	0
合計			6,040	－	△127

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第61期(2020年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,913	－	△41	△41
	買建	－	－	－	－
合計		1,913	－	△41	△41

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	1,808	－	15	15
合計		1,808	－	15	15

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,427	－	20
	豪ドル		48	－	9
	シンガポールドル		944	－	58
	香港ドル		529	－	2
	人民元		2,017	－	76
	ユーロ		70	－	1
合計			7,038	－	167

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円）	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円）
(1)関連会社に対する投資の金額　3,010	(1)関連会社に対する投資の金額　3,002
(2)持分法を適用した場合の投資の金額　10,668	(2)持分法を適用した場合の投資の金額　10,485
(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,704	(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,631

（退職給付関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　採用している退職給付制度の概要

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

２　確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	△59
退職給付債務の期末残高	1,411

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.1%

３　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　採用している退職給付制度の概要

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

2　確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	△31
退職給付の支払額	△164
退職給付債務の期末残高	1,363

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の費用処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用	154

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%

3　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

1　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年２月８日	2010年８月20日

権利確定条件	2012年１月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年１月22日から 2020年１月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員　36名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,409,000株	普通株式　4,422,000株
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日

権利確定条件	2019年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

権利未行使残	―	―

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

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

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

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員　36名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,409,000株	普通株式　4,422,000株
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日

権利確定条件	2019年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年２月８日	2010年８月20日
権利確定前(株)		
期首	1,171,500	75,900
付与	0	0
失効	1,171,500	75,900
権利確定	0	0
権利未確定残	―	―
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月７日	2016年７月15日
権利確定前(株)		
期首	2,055,900	3,618,000
付与	0	0
失効	871,200	2,272,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,184,700	1,346,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―

権利未行使残	―	―

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日
権利確定前(株)		
期首	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

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

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

(注)　１　公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　1,633百万円
３　株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)

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

1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	（単位：百万円）
繰延税金資産	
賞与引当金	822
投資有価証券評価損	102
関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	427
固定資産減価償却費	96
その他	744
繰延税金資産小計	3,624
評価性引当金	△1,430
繰延税金資産合計	2,194
繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172
繰延税金負債合計	172
繰延税金資産の純額	2,022

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.8%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	△4.4%
その他	0.6%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	△9.6%
その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%

（関連当事者情報）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
							資金の貸付の返済（シンガポールドル貨建）(注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	―	―

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	貸付金利息（シンガポールドル貨建）（注1）	8 (SGD 104 千)	―	―
							資金の貸付（米国ドル貨建）（注3）	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社短期貸付金	1,830 (USD 16,500 千)
							貸付金利息（米国ドル貨建）（注3）	17 (USD 209 千)	未収収益	17 (USD 209 千)
							資金の貸付（円貨建）（注3）	―	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息（円貨建）（注3）	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	配当の受取	1,021 (USD 9,000 千)	―	―
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入（米国ドル貨建）（注6）	5,364 (USD 50,000 千) (注7)	―	―
							資金の借入の返済（米国ドル貨建）（注6）	5,526 (USD 50,000 千) (注7)	―	―
							借入金利息（米国ドル貨建）（注6）	65 (USD 593 千)	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2　取引金額554百万円（SGD6,800千）の内訳は、貸付の返済554百万円（SGD6,800千）であります。

3　融資枠5,000百万円（若しくは5,000百万円相当額の外国通貨）、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

4　取引金額1,807百万円（USD16,500千）の内訳は、貸付1,807百万円（USD16,500千）であります。

5　Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

6　借入枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

7　取引金額5,364百万円（USD50,000千）及び5,526百万円（USD50,000千）の内訳は、借入5,364百万円（USD50,000千）及び借入の返済5,526百万円（USD50,000千）であります。

2　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	26,768百万円
負債合計	5,586百万円
純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	1,793 (USD 16,500 千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122 千)
							資金の貸付(円貨建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貨建)(注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	配当の受取	1,526 (USD 14,000 千)	―	―
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	配当の受取	2,700	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　資枠5,000百万円（若しくは5,000百万円相当額の外国通貨）、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2　Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

２　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円

営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

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

関連情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

該当事項はありません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

該当事項はありません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

該当事項はありません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
１株当たり純資産額	355円59銭	395円50銭
１株当たり当期純利益金額	45円08銭	58円61銭

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

２　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
当期純利益（百万円）	8,823	11,465
普通株主に帰属しない金額（百万円）	－	－
普通株式に係る当期純利益（百万円）	8,823	11,465
普通株式の期中平均株式数（千株）	195,677	195,599

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション（1）1,346,000株、2016年度ストックオプション（2）2,394,000株、2017年度ストックオプション（1）2,939,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	69,571	77,402
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－	－
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	69,571	77,402
１株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	195,647	195,558

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第62期中間会計期間 (2020年９月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		23,938
有価証券		42
未収委託者報酬		14,700
未収収益		838
関係会社短期貸付金		2,323
その他	※２	2,990
流動資産合計		44,833
固定資産		
有形固定資産	※１	408
無形固定資産		154
投資その他の資産		
投資有価証券		21,271
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		462
繰延税金資産		1,702
投資その他の資産合計		49,206
固定資産合計		49,769
資産合計		94,603

(単位：百万円)

		第62期中間会計期間 (2020年９月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,010
未払費用		3,510
未払法人税等		1,507
未払消費税等	※３	562
賞与引当金		1,606
役員賞与引当金		27
その他		1,069
流動負債合計		15,294
固定負債		
退職給付引当金		1,452
その他		315
固定負債合計		1,768
負債合計		17,062
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		55,970
利益剰余金合計		55,970
自己株式		△2,067
株主資本合計		76,486
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		645
繰延ヘッジ損益		408
評価・換算差額等合計		1,054
純資産合計		77,541
負債純資産合計		94,603

（２）中間損益計算書

(単位：百万円)

	第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)
営業収益	
委託者報酬	35,275
その他営業収益	1,507

営業収益合計		36,782
営業費用及び一般管理費	※１	32,215
営業利益		4,567
営業外収益	※２	789
営業外費用	※３	418
経常利益		4,938
特別利益	※４	43
特別損失	※５	91
税引前中間純利益		4,891
法人税等	※６	1,452
中間純利益		3,438

（３）中間株主資本等変動計算書

第62期中間会計期間（自　2020年４月１日　至　2020年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	△905	77,073
当中間期変動額							
剰余金の配当				△2,862	△2,862		△2,862
中間純利益				3,438	3,438		3,438
自己株式の取得						△1,161	△1,161
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	－	－	－	575	575	△1,161	△586
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	55,970	55,970	△2,067	76,486

	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	△60	389	329	77,402
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,862
中間純利益				3,438
自己株式の取得				△1,161
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	706	18	724	724
当中間期変動額合計	706	18	724	138
当中間期末残高	645	408	1,054	77,541

注記事項
（重要な会計方針）

項目	第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(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。
３　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
４　ヘッジ会計の方法	(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、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。

５　その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。 (2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。

（中間貸借対照表関係）

第62期中間会計期間 (2020年９月30日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 2,060百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※３　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※４　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務28百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)	
※１　減価償却実施額	
有形固定資産	43百万円
無形固定資産	20百万円
※２　営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	40百万円
受取配当金	719百万円
※３　営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	60百万円
デリバティブ費用	338百万円
※４　特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	43百万円
※５　特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	90百万円
※６　中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第62期中間会計期間（自　2020年４月１日　至　2020年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,454,500	1,405,500	－	2,860,000

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2011年度ストックオプション（1）	普通株式	1,184,700	－	270,600	914,100	－
2016年度ストックオプション（1）	普通株式	1,346,000	－	319,000	1,027,000	－
2016年度ストックオプション（2）	普通株式	2,394,000	－	402,000	1,992,000	－
2017年度ストックオプション（1）	普通株式	2,939,000	－	－	2,939,000	－
合計		7,863,700	－	991,600	6,872,100	－

（注）１　当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

２　2011年度ストックオプション(1)914,100株、2016年度ストックオプション(1)1,027,000株、2016年度ストックオプション(2)1,198,000株及び2017年度ストックオプション(1)986,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(2)794,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,953,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

４　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年６月12日取締役会	普通株式	2,862	14.64	2020年３月31日	2020年７月１日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	911百万円
１年超	5,692百万円
合計	6,604百万円

（金融商品関係）

第62期中間会計期間(2020年９月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2020年９月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表 計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	23,938	23,938	－
(2) 未収委託者報酬	14,700	14,700	－
(3) 未収収益	838	838	－
(4) 関係会社短期貸付金	2,323	2,323	－
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	21,297	21,297	－
(6) 未払金	(7,010)	(7,010)	－
(7) 未払費用	(3,510)	(3,510)	－
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(15)	(15)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	14	14	－
デリバティブ取引計	(1)	(1)	－

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち21百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、36百万円は、流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち65百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、51百万円は、流動負債のその他に含まれております。

２ 非上場株式等（中間貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証

券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第62期中間会計期間(2020年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	9,871	8,550	1,320
	小計	9,871	8,550	1,320
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	11,425	11,815	△389
	小計	11,425	11,815	△389
合計		21,297	20,366	930

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

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

（デリバティブ取引関係）

第62期中間会計期間(2020年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,250	－	△36	△36
合計		2,250	－	△36	△36

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

２ 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

（2）通貨関連

種類		契約額等 （百万円）	契約額等の うち１年超 （百万円）	時価 （百万円）	評価損益 （百万円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,766	－	21	21
合計		1,766	－	21	21

（注）１ 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
２ 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

２ ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 （百万円）	契約額等の うち１年超 （百万円）	時価 （百万円）
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	4,775	－	53
	豪ドル		3	－	△0
	シンガポールドル		509	－	△1
	ユーロ		47	－	△0
	香港ドル		1,068	－	12
	人民元		2,404	－	△48
合計			8,808	－	14

（注）１ 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （1）関連会社に対する投資の金額　3,003百万円 （2）持分法を適用した場合の投資の金額　10,460百万円 （3）持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,335百万円

（ストックオプション等関係）

第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)
該当事項はありません。

（セグメント情報等）
［セグメント情報］
第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)
当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

［関連情報］
第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)
１ 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020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62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020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62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)
１株当たり純資産額	399円38銭
１株当たり中間純利益金額	17円64銭

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

２ １株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期中間会計期間 (自　2020年４月１日 至　2020年９月30日)
中間純利益（百万円）	3,438
普通株主に帰属しない金額（百万円）	―
普通株式に係る中間純利益（百万円）	3,438
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,864
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)914,100株、 2016年度ストックオプション(1)1,027,000株、 2016年度ストックオプション(2)1,992,000株、 2017年度ストックオプション(1)2,939,000株

３ １株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期中間会計期間 (2020年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	77,541
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	77,541
１株当たり純資産額の算定に用いられた 中間会計期間末の普通株式の数（千株）	194,153

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （2020年3月末現在）	事業の内容

野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （2020年3月末現在）	事業の内容
エース証券株式会社	8,831百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
東洋証券株式会社　※1	13,494百万円	
野村證券株式会社　※1	10,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	10,007百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社秋田銀行　※1	14,100百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
オーストラリア・アンド・ニュージーランド・バンキング・グループ・リミテッド（銀行）　※1	26,490百万豪ドル （2019年9月末現在）	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社第三銀行	37,461百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行　※1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社三重銀行　※1	15,295百万円	
株式会社南日本銀行	16,601百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	
株式会社ＳＭＢＣ信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信

みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	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。
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
労働金庫連合会	120,000百万円 （出資の総額）	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

※1　募集の取扱いを行ないません。

名　　称	資本金の額 （2020年3月末現在）	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	165,600百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
東京都信用農業協同組合連合会	130,200百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	201,700百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	60,662百万円	
新潟県信用農業協同組合連合会	56,200百万円	
石川県信用農業協同組合連合会	33,047百万円	
岐阜県信用農業協同組合連合会	74,618百万円	
静岡県信用農業協同組合連合会	161,300百万円	
愛知県信用農業協同組合連合会	220,402百万円	
三重県信用農業協同組合連合会	68,752百万円	
滋賀県信用農業協同組合連合会	40,700百万円	
大阪府信用農業協同組合連合会	140,600百万円	
兵庫県信用農業協同組合連合会	208,800百万円	
和歌山県信用農業協同組合連合会	57,883百万円	
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円	
徳島県信用農業協同組合連合会	32,500百万円	
高知県信用農業協同組合連合会	24,879百万円	
福岡県信用農業協同組合連合会	46,173百万円	
きたそらち農業協同組合	3,331百万円	
仙台農業協同組合	3,375百万円	
みやぎ亘理農業協同組合	1,532百万円	
みやぎ登米農業協同組合	6,378百万円	
新みやぎ農業協同組合	10,536百万円	
いしのまき農業協同組合	4,584百万円	
みやぎ仙南農業協同組合	3,882百万円	
秋田しんせい農業協同組合	5,410百万円	
山形農業協同組合	4,007百万円	

さがえ西村山農業協同組合	3,682百万円
山形おきたま農業協同組合	4,761百万円
鶴岡市農業協同組合	1,474百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,290百万円
ふくしま未来農業協同組合	15,999百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,231百万円
北つくば農業協同組合	3,393百万円
はが野農業協同組合	3,888百万円
那須南農業協同組合	1,171百万円
高崎市農業協同組合	2,121百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,573百万円
さいたま農業協同組合	8,291百万円
あさか野農業協同組合	867百万円
いるま野農業協同組合	5,778百万円
埼玉中央農業協同組合	2,349百万円
くまがや農業協同組合	2,721百万円
ほくさい農業協同組合	3,135百万円
越谷市農業協同組合	2,035百万円
南彩農業協同組合	2,835百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,469百万円
さいかつ農業協同組合	1,842百万円
ふかや農業協同組合	1,732百万円
横浜農業協同組合	11,919百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,517百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,411百万円
さがみ農業協同組合	5,161百万円
湘南農業協同組合	3,301百万円
秦野市農業協同組合	1,698百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,448百万円
厚木市農業協同組合	2,477百万円
相模原市農業協同組合	859百万円
神奈川つくい農業協同組合	806百万円
佐久浅間農業協同組合	6,853百万円
信州うえだ農業協同組合	4,172百万円
信州諏訪農業協同組合	6,384百万円
上伊那農業協同組合	8,122百万円
みなみ信州農業協同組合	4,436百万円
松本ハイランド農業協同組合	6,494百万円
大北農業協同組合	3,141百万円
グリーン長野農業協同組合	3,803百万円
中野市農業協同組合	2,590百万円
ながの農業協同組合	12,924百万円
北越後農業協同組合	2,971百万円

新潟みらい農業協同組合	4,781百万円
越後中央農業協同組合	5,202百万円
にいがた南蒲農業協同組合	4,946百万円
越後ながおか農業協同組合	5,382百万円
十日町農業協同組合	2,729百万円
ひすい農業協同組合	1,225百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,414百万円
佐渡農業協同組合	2,422百万円
加賀農業協同組合	1,986百万円
小松市農業協同組合	1,876百万円
能美農業協同組合	1,259百万円
金沢中央農業協同組合	1,061百万円
金沢市農業協同組合	3,136百万円
はくい農業協同組合	1,361百万円
能登わかば農業協同組合	2,650百万円
おおぞら農業協同組合	1,404百万円
ぎふ農業協同組合	7,192百万円
西美濃農業協同組合	4,584百万円
いび川農業協同組合	2,019百万円
めぐみの農業協同組合	4,997百万円
陶都信用農業協同組合	1,604百万円
東美濃農業協同組合	2,610百万円
飛騨農業協同組合	6,452百万円
伊豆太陽農業協同組合	1,757百万円
三島函南農業協同組合	1,012百万円
伊豆の国農業協同組合	902百万円
あいら伊豆農業協同組合	901百万円
南駿農業協同組合	3,113百万円
御殿場農業協同組合	1,215百万円
富士市農業協同組合	1,467百万円
富士宮農業協同組合	932百万円
清水農業協同組合	2,945百万円
静岡市農業協同組合	1,868百万円
大井川農業協同組合	3,364百万円
ハイナン農業協同組合	840百万円
掛川市農業協同組合	766百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,495百万円
遠州中央農業協同組合	3,273百万円
とぴあ浜松農業協同組合	3,677百万円
三ヶ日町農業協同組合	295百万円
なごや農業協同組合	2,411百万円
尾張中央農業協同組合	2,091百万円
西春日井農業協同組合	156百万円

あいち尾東農業協同組合	1,201百万円
愛知北農業協同組合	751百万円
愛知西農業協同組合	1,606百万円
あいち知多農業協同組合	6,979百万円
あいち中央農業協同組合	3,542百万円
西三河農業協同組合	1,316百万円
あいち三河農業協同組合	1,118百万円
あいち豊田農業協同組合	1,808百万円
愛知東農業協同組合	948百万円
豊橋農業協同組合	2,495百万円
鈴鹿農業協同組合	1,574百万円
津安芸農業協同組合	2,408百万円
伊勢農業協同組合	6,287百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	3,733百万円
甲賀農業協同組合	2,518百万円
北大阪農業協同組合	1,845百万円
茨木市農業協同組合	1,217百万円
大阪泉州農業協同組合	1,961百万円
いずみの農業協同組合	2,841百万円
堺市農業協同組合	1,190百万円
大阪南農業協同組合	3,728百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,466百万円
大阪中河内農業協同組合	4,237百万円
北河内農業協同組合	2,640百万円
大阪市農業協同組合	2,318百万円
兵庫南農業協同組合	3,749百万円
みのり農業協同組合	4,340百万円
兵庫西農業協同組合	12,582百万円
たじま農業協同組合	4,383百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,220百万円
淡路日の出農業協同組合	1,862百万円
奈良県農業協同組合	9,371百万円
わかやま農業協同組合	4,698百万円
ながみね農業協同組合	2,012百万円
紀の里農業協同組合	3,716百万円
紀北川上農業協同組合	4,671百万円
ありだ農業協同組合	2,091百万円
紀州農業協同組合	3,712百万円
紀南農業協同組合	4,778百万円
みくまの農業協同組合	1,059百万円
鳥取いなば農業協同組合	5,888百万円
鳥取中央農業協同組合	3,740百万円
鳥取西部農業協同組合	5,066百万円

島根県農業協同組合	22,328百万円
広島市農業協同組合	9,390百万円
広島中央農業協同組合	3,076百万円
山口県農業協同組合	16,655百万円
徳島市農業協同組合	3,215百万円
香川県農業協同組合	25,453百万円
越智今治農業協同組合	6,444百万円
高知市農業協同組合	4,777百万円
高知県農業協同組合	11,009百万円
福岡八女農業協同組合	3,409百万円
宮崎中央農業協同組合	5,718百万円
延岡農業協同組合	1,416百万円
沖縄県農業協同組合	22,989百万円

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（2）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 6月30日	臨時報告書
2020年 9月15日	有価証券届出書
2020年 9月15日	有価証券報告書
2020年 9月30日	臨時報告書

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2020年６月８日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　貞 廣 篤 典

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61期事業年度の財務諸表、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。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020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、全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。

監査意見の根拠
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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
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。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象

や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

以　上

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

2021年１月27日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　佐々木　貴司
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2020年６月16日から2020年12月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2020年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

(注)1.上記は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.ＸＢＲＬ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

2020年12月４日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　貞 廣 篤 典

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年４月１日から2020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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020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（2020年４月１日から2020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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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、監査人は、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。
・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、

継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。