【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年7月26日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 佐谷戸　淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	新屋敷　昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）（以下「ファンド」といいます。）
・愛称として「Aナビ40」、「ステージ３」、「アセット・ナビゲーション・ファンド」、「Aナビ」という名称を用いることがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（5）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は1.1%（税抜１%）が上限となっております。

（6）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（7）【申込期間】

2021年7月27日から2022年1月26日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（8）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

４つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

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	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２回 年４回 年６回 （隔月） 年 12回 （毎月） 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり （部分ヘッジ）
不動産投信	その他 （　）	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 （投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券）））		アフリカ 中近東 （中東）		
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））

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

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

◇年１回

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

◇グローバル（含む日本）

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

◇ファミリーファンド

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

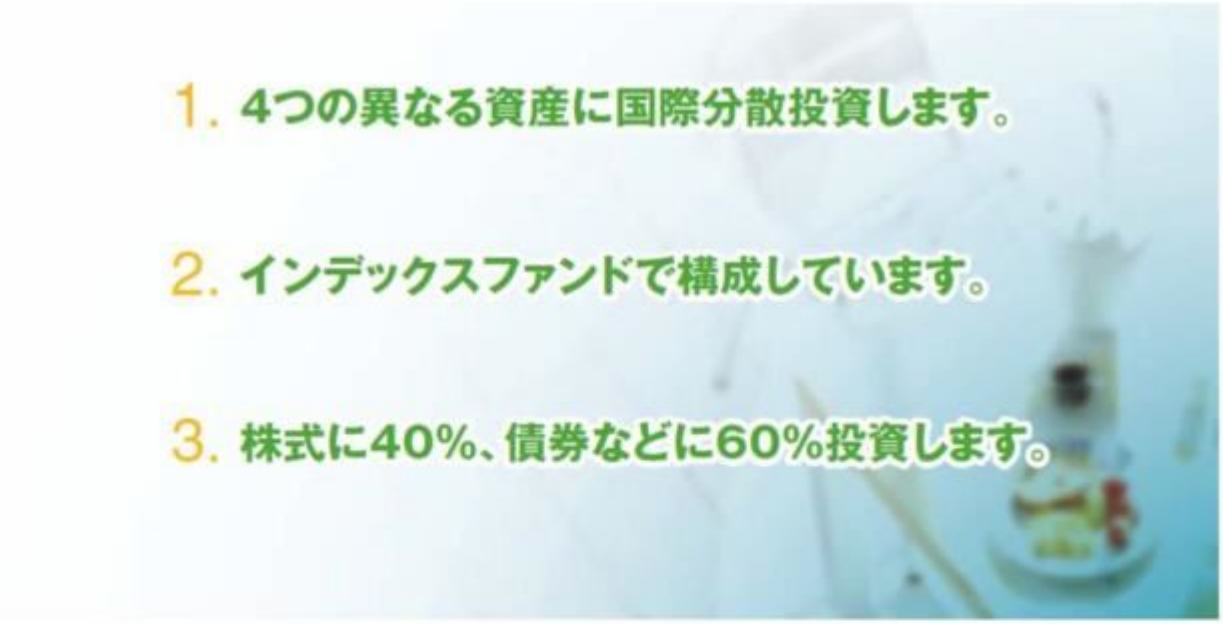
◇為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

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

③　ファンドの特色



ファンドの仕組み

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

（主な投資制限）
・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

（分配方針）
・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」
主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

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

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

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

3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

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

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

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。
※基本投資比率からかい離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

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

④ 信託金限度額

・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

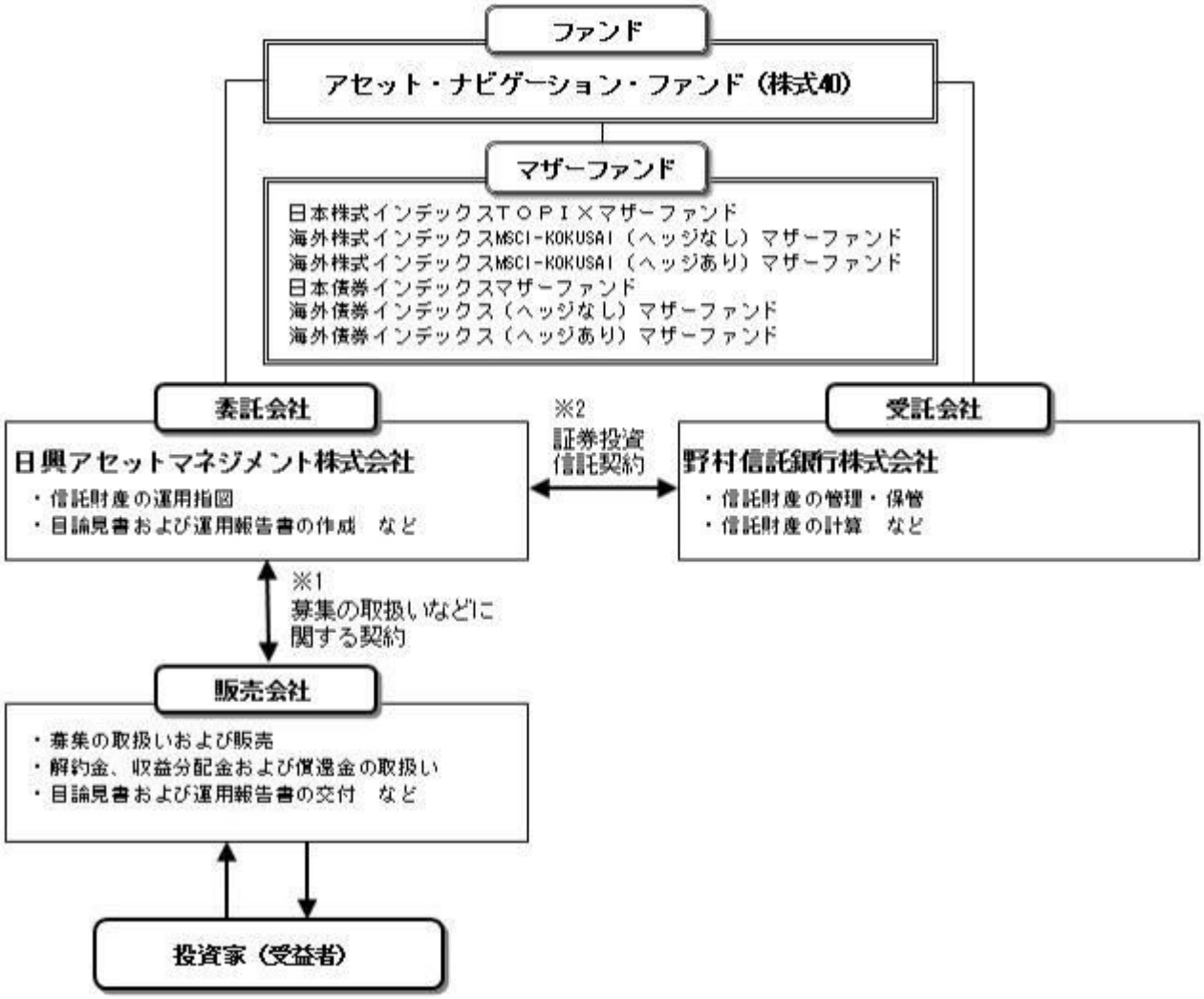
（2）【ファンドの沿革】

1999年10月29日

・ファンドの信託契約締結、運用開始
2001年６月１日
・ファンド名称変更
新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）
旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ３）

（３）【ファンドの仕組み】

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（2021年4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	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

（2）【投資対象】

＜アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）＞
以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
　証券投資信託　「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
　証券投資信託　「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
　証券投資信託　「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
　証券投資信託　「日本債券インデックスマザーファンド」
　証券投資信託　「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
　証券投資信託　「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
　3）金銭債権
　4）約束手形
　5）為替手形
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「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券
　2）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
　3）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
　4）証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
　5）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
　6）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
　7）株券または新株引受権証書
　8）国債証券
　9）地方債証券
　10）特別の法律により法人の発行する債券

11）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
13）コマーシャル・ペーパー
14）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
15）外国または外国の者の発行する証券または証書で、７）～14）の証券または証書の性質を有するもの
16）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
17）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
18）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
20）外国法人が発行する譲渡性預金証書
21）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23）外国の者に対する権利で22）の有価証券の性質を有するもの

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
10）資金の借入

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド＞
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

＜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

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

内外の公社債を主要投資対象とします。

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

◆投資対象とするマザーファンドの概要
＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

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

	投資方針	・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。

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

運用の基本方針

	基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2000年５月17日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

＊MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・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。

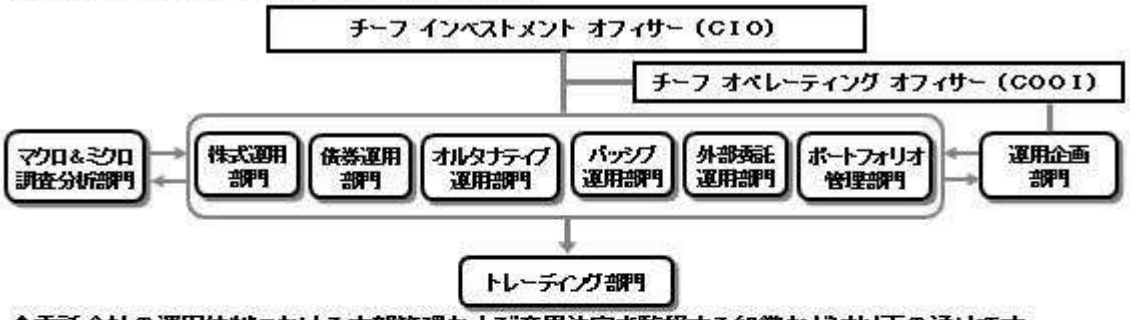
＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

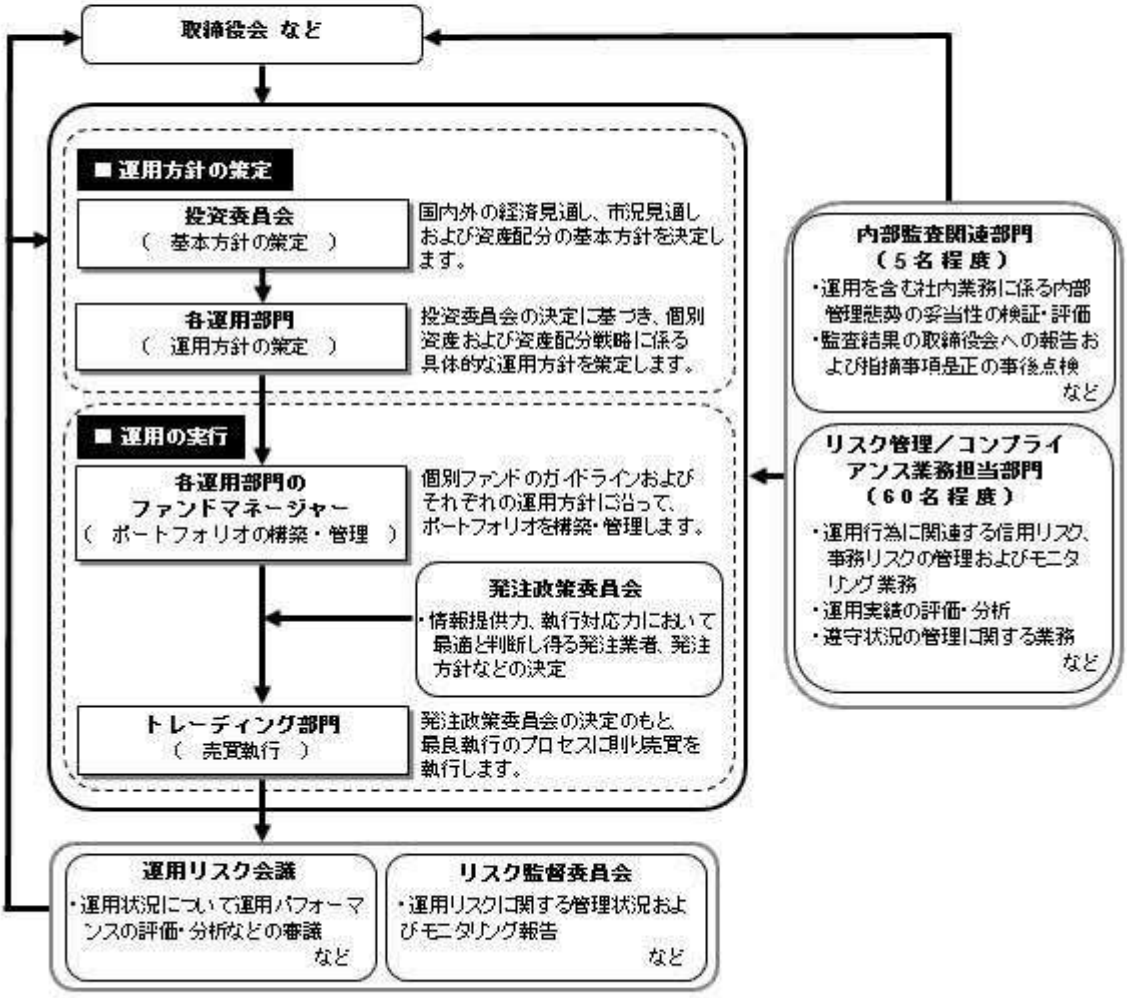
＊FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

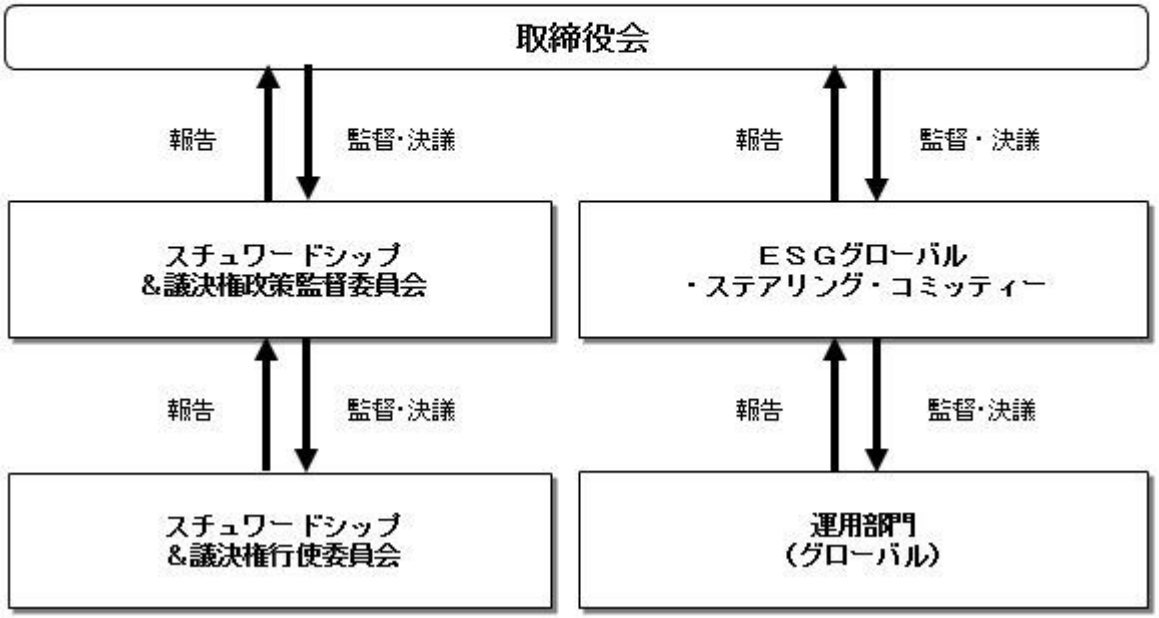


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。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2021年4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、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
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
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
＜アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）＞
１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
３）外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
４）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内と

します。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

14）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴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。

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

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

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

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

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

３）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

４）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

16）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポー

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

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

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

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

３）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

４）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資は行ないません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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。

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

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

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

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴ないます。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、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

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

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

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

廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

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

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

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

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。

・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないますが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

＜その他の留意事項＞

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

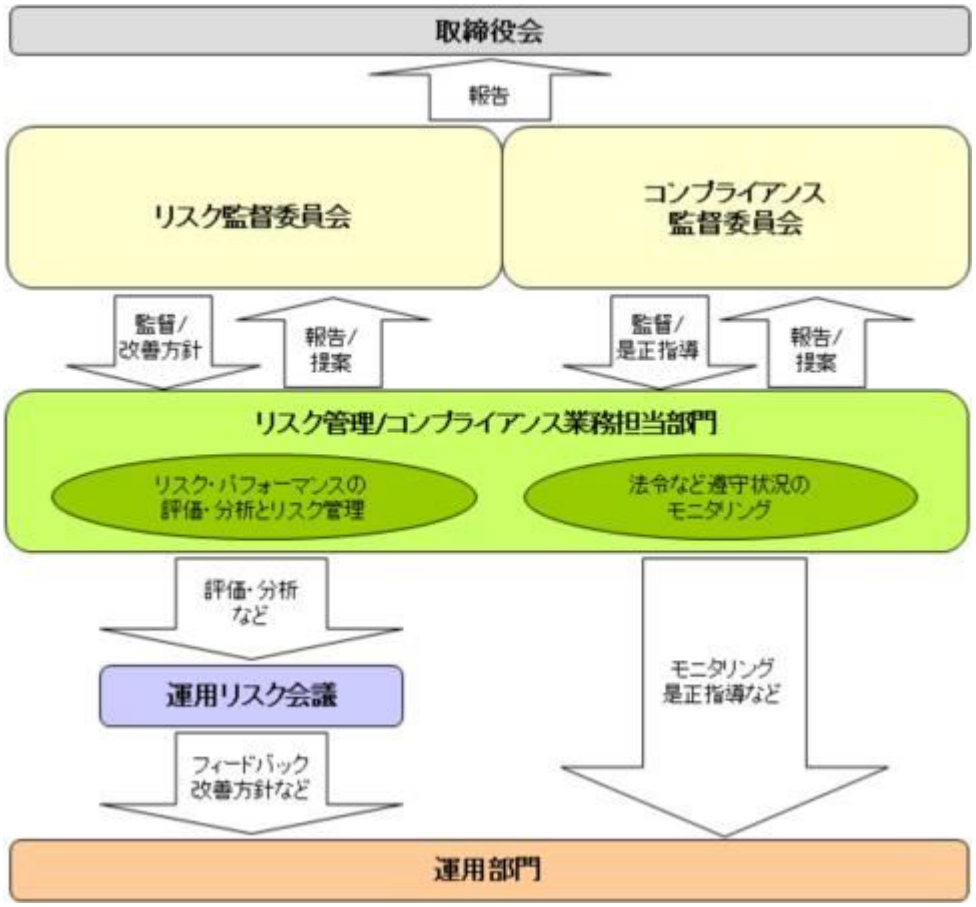
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（2）リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

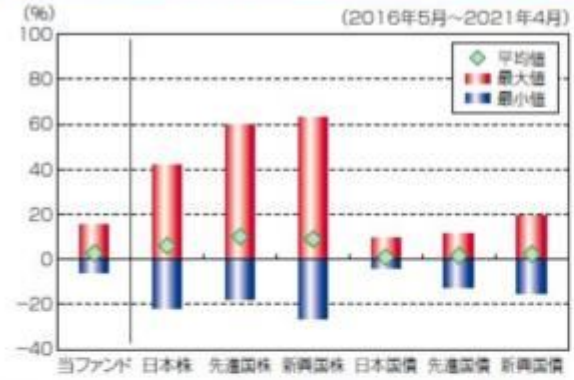
■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は2021年4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	2.9%	6.0%	10.0%	9.0%	1.0%	1.6%	2.3%
最大値	15.3%	42.1%	59.8%	62.7%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-6.1%	-22.0%	-17.5%	-26.1%	-4.0%	-12.3%	-15.0%

※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5月から2021年4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5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。

〇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1.1%（税抜１％）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。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0.671%（税抜0.61%）の率を乗じて得た額とします。
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
0.61%	0.22%	0.35%	0.04%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
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、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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

① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
③ 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。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

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

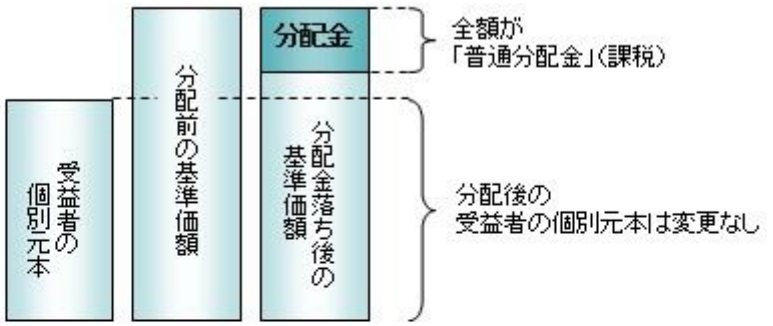
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

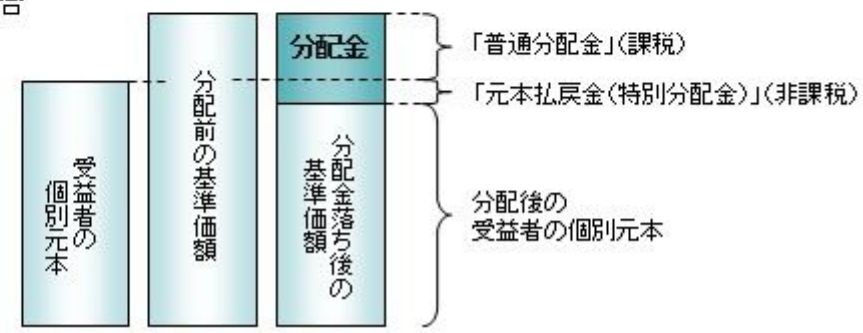
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜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7月26日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

以下の運用状況は2021年 4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	288,517,097	95.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	15,175,798	5.00
合計（純資産総額）		303,692,895	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	日本債券インデックスマザーファンド	96,817,406	1.4126	136,764,268	1.4109	136,599,678	44.98
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	49,844,449	1.5385	76,685,685	1.8242	90,926,243	29.94
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	4,208,450	2.8372	11,940,215	3.6516	15,367,576	5.06
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	6,069,716	2.4531	14,889,621	2.5141	15,259,872	5.02
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	6,427,291	1.9432	12,489,512	2.3713	15,241,035	5.02
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	9,471,811	1.6518	15,645,538	1.5966	15,122,693	4.98

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	95.00
合　　計	95.00

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計算期間末 (2011年10月26日)	560	560	0.9571	0.9571
第13計算期間末 (2012年10月26日)	515	515	0.9913	0.9913
第14計算期間末 (2013年10月28日)	466	466	1.2162	1.2172
第15計算期間末 (2014年10月27日)	360	360	1.2757	1.2767
第16計算期間末 (2015年10月26日)	343	344	1.4047	1.4057
第17計算期間末 (2016年10月26日)	308	308	1.3778	1.3788
第18計算期間末 (2017年10月26日)	314	314	1.5119	1.5129
第19計算期間末 (2018年10月26日)	355	355	1.4719	1.4729
第20計算期間末 (2019年10月28日)	386	387	1.5407	1.5417
第21計算期間末 (2020年10月26日)	301	301	1.5567	1.5577
2020年 4月末日	296	—	1.4882	—
5月末日	304	—	1.5220	—
6月末日	305	—	1.5232	—
7月末日	300	—	1.5140	—
8月末日	304	—	1.5557	—
9月末日	304	—	1.5581	—
10月末日	299	—	1.5372	—
11月末日	306	—	1.6059	—
12月末日	307	—	1.6245	—
2021年 1月末日	302	—	1.6254	—
2月末日	304	—	1.6345	—
3月末日	311	—	1.6763	—
4月末日	303	—	1.6708	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0000
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0000
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010

第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第20期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010
第21期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.0010
当中間期	2020年10月27日～2021年 4月26日	―

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	△1.96
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	3.57
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	22.79
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	4.97
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	10.19
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	△1.84
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	9.81
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	△2.58
第20期	2018年10月27日～2019年10月28日	4.74
第21期	2019年10月29日～2020年10月26日	1.10
当中間期	2020年10月27日～2021年 4月26日	7.61

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	38,817,760	115,309,278
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	27,776,150	93,719,970
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	18,386,017	154,999,819
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	11,663,810	112,584,086
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	11,849,353	49,640,624
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	8,937,726	29,583,310
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	8,537,068	24,925,795
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	57,906,257	23,995,805
第20期	2018年10月27日～2019年10月28日	27,380,609	17,962,808
第21期	2019年10月29日～2020年10月26日	9,217,244	66,583,100
当中間期	2020年10月27日～2021年 4月26日	5,551,890	14,930,301

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

以下の運用状況は2021年 4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	37,260,244,920	98.64
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	514,283,578	1.36
合計（純資産総額）		37,774,528,498	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	551,435,000	1.46

(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	144,800	7,003.75	1,014,144,334	8,127.00	1,176,789,600	3.12
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	111,300	6,942.82	772,736,688	9,885.00	1,100,200,500	2.91
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	89,500	8,088.68	723,937,328	10,900.00	975,550,000	2.58
日本	株式	キーエンス	電気機器	14,000	49,214.29	689,000,091	52,520.00	735,280,000	1.95
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	964,300	425.75	410,556,562	578.00	557,365,400	1.48
日本	株式	任天堂	その他製品	8,200	55,162.07	452,329,000	62,690.00	514,058,000	1.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	97,800	4,164.86	407,323,541	4,939.00	483,034,200	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	25,900	15,024.98	389,147,121	18,450.00	477,855,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	164,100	2,238.04	367,263,736	2,755.00	452,095,500	1.20
日本	株式	日本電産	電気機器	34,400	10,737.25	369,361,689	12,655.00	435,332,000	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	118,900	3,502.01	416,389,040	3,635.00	432,201,500	1.14
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,400	28,935.52	243,058,410	48,320.00	405,888,000	1.07
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,200	19,530.34	355,452,290	21,930.00	399,126,000	1.06
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	112,500	2,845.98	320,173,344	3,306.00	371,925,000	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	97,600	2,993.49	292,165,476	3,802.00	371,075,200	0.98
日本	株式	日立製作所	電気機器	68,700	3,693.62	253,752,140	5,381.00	369,674,700	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	42,000	7,444.77	312,680,440	8,703.00	365,526,000	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	112,500	2,596.69	292,127,647	3,232.00	363,600,000	0.96

日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	28,100	11,809.63	331,850,660	12,435.00	349,423,500	0.93
日本	株式	第一三共	医薬品	122,700	2,697.40	330,971,529	2,787.00	341,964,900	0.91
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	96,300	2,562.09	246,729,416	3,408.00	328,190,400	0.87
日本	株式	ファナック	電気機器	12,500	21,657.74	270,721,864	25,175.00	314,687,500	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	191,600	1,314.63	251,884,431	1,535.00	294,106,000	0.78
日本	株式	ＳＭＣ	機械	4,200	56,544.73	237,487,866	63,450.00	266,490,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	114,300	1,797.02	205,399,670	2,303.50	263,290,050	0.70
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	55,100	3,421.65	188,532,942	4,699.00	258,914,900	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	85,700	2,450.03	209,968,100	3,020.00	258,814,000	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	46,400	4,934.70	228,970,080	5,230.00	242,672,000	0.64
日本	株式	三菱電機	電気機器	143,000	1,374.47	196,549,904	1,682.00	240,526,000	0.64
日本	株式	花王	化学	34,200	7,550.71	258,234,440	7,007.00	239,639,400	0.63

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	0.17
		建設業	2.35
		食料品	3.24
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.30
		医薬品	5.13
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.82
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.63
		機械	5.64
		電気機器	17.72
		輸送用機器	7.01
		精密機器	2.53
		その他製品	2.41
		電気・ガス業	1.27
		陸運業	3.32
		海運業	0.27
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.43
		卸売業	4.71
		小売業	4.58

		銀行業	4.96
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	1.84
		その他金融業	1.08
		不動産業	1.95
		サービス業	5.45
合　　計			98.64

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０６月	買建	29	日本円	564,660,950	551,435,000	1.46

(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2021年 4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	156,526,320,078	66.96
	カナダ	8,225,728,798	3.52
	ドイツ	7,022,247,301	3.00
	イタリア	1,402,425,161	0.60
	フランス	7,807,397,493	3.34
	オランダ	4,268,750,822	1.83
	スペイン	1,859,038,188	0.80
	ベルギー	653,519,685	0.28
	オーストリア	145,074,271	0.06
	ルクセンブルク	222,093,673	0.10
	フィンランド	914,713,855	0.39
	アイルランド	4,476,165,242	1.91
	ポルトガル	120,392,293	0.05
	イギリス	9,995,314,000	4.28
	スイス	7,584,999,732	3.25
	スウェーデン	2,578,039,932	1.10

	ノルウェー	480,199,220	0.21
	デンマーク	1,814,149,466	0.78
	ケイマン	422,168,421	0.18
	オーストラリア	4,854,301,848	2.08
	バミューダ	361,394,700	0.15
	ニュージーランド	260,725,022	0.11
	パプアニューギニア	25,189,027	0.01
	香港	2,018,873,247	0.86
	シンガポール	716,482,269	0.31
	イスラエル	507,460,917	0.22
	ジャージー	739,280,120	0.32
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	55,051,789	0.02
	小計	226,057,496,570	96.71
投資証券	アメリカ	4,370,172,332	1.87
	カナダ	13,570,390	0.01
	フランス	118,214,140	0.05
	イギリス	135,149,503	0.06
	オーストラリア	333,727,127	0.14
	香港	89,984,912	0.04
	シンガポール	111,721,880	0.05
	小計	5,172,540,284	2.21
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	2,514,174,457	1.08
合計（純資産総額）		233,744,211,311	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,174,912,719	0.93
	買建	ドイツ	421,562,861	0.18

(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	—	963,248,260	0.41
	売建	—	1,064,883,934	△0.46

(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	684,618	12,533.48	8,580,649,981	14,539.97	9,954,329,563	4.26
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	289,204	23,561.55	6,814,097,109	27,505.91	7,954,820,439	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,165	348,995.38	5,990,505,706	378,129.79	6,490,597,988	2.78
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	96,760	31,024.35	3,001,916,425	35,893.52	3,473,057,411	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,942	178,992.68	2,137,530,664	264,687.91	3,160,903,113	1.35
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	12,100	178,042.81	2,154,318,087	260,643.34	3,153,784,496	1.35
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	30,520	46,259.30	1,411,833,930	73,745.60	2,250,716,017	0.96
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	122,470	11,330.89	1,387,695,151	16,904.84	2,070,336,575	0.89
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	106,051	15,828.61	1,678,640,800	17,886.30	1,896,860,638	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	67,832	21,577.94	1,463,675,077	25,801.15	1,750,144,272	0.75
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	38,160	36,030.77	1,374,934,416	43,740.84	1,669,150,512	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,150	23,189.01	1,278,874,365	30,238.96	1,667,679,085	0.71
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	24,805	59,204.54	1,468,568,721	66,773.00	1,656,304,282	0.71
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	43,400	30,839.17	1,338,420,078	35,439.28	1,538,065,021	0.66
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	116,173	12,771.08	1,483,655,025	13,083.91	1,519,997,959	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	35,775	35,917.48	1,284,948,165	42,368.32	1,515,726,773	0.65
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	72,742	14,029.09	1,020,504,406	20,187.99	1,468,515,270	0.63
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	100,019	15,507.27	1,551,022,118	14,434.31	1,443,705,682	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	313,039	2,716.71	850,437,496	4,478.11	1,401,823,796	0.60
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	44,757	22,130.21	990,482,203	29,176.90	1,305,870,536	0.56
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	17,092	42,028.25	718,346,948	71,644.17	1,224,542,188	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	183,604	4,918.18	902,999,265	6,143.65	1,127,999,082	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	169,951	3,731.94	634,247,241	6,420.33	1,091,142,218	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	19,279	53,212.30	1,025,880,028	56,217.68	1,083,820,724	0.46
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	164,752	5,255.87	865,915,506	6,348.44	1,045,918,253	0.45
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	167,087	6,313.58	1,054,917,610	6,243.86	1,043,269,106	0.45

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	28,243	35,646.36	1,006,760,258	35,940.02	1,015,054,013	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	17,745	53,205.76	944,136,375	55,445.37	983,878,091	0.42
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	287,137	3,030.43	870,149,325	3,413.86	980,247,299	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	164,272	5,503.14	904,012,406	5,910.54	970,936,523	0.42

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	3.23
		素材	4.52
		資本財	6.52
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	2.04
		自動車・自動車部品	1.95
		耐久消費財・アパレル	1.95
		消費者サービス	1.92
		メディア・娯楽	7.32
		小売	5.65
		食品・生活必需品小売り	1.30
		食品・飲料・タバコ	3.89
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	5.17
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.12
		銀行	6.21
		各種金融	4.59
		保険	3.19
		不動産	0.43
		ソフトウェア・サービス	11.70
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.82
		電気通信サービス	1.76
		公益事業	3.02
		半導体・半導体製造装置	4.44
投資証券	―	―	2.21
合　　計			98.92

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（各通貨）	契約額等（円）	評価額（各通貨）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2106	買建	95	米ドル	19,043,362.5	2,074,393,477	19,966,150	2,174,912,719	0.93
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2106	買建	95	ユーロ	3,106,950	410,086,330	3,193,900	421,562,861	0.18

(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	6,300,000.00	681,366,600	685,977,420	0.29
	ユーロ	買建	2,100,000.00	272,465,940	277,270,840	0.12
	米ドル	売建	9,400,000.00	1,023,566,000	1,023,881,840	△0.44
	豪ドル	売建	220,000.00	18,574,600	18,644,054	△0.01
	ニュージーランドドル	売建	150,000.00	11,748,300	11,835,540	△0.01
	香港ドル	売建	750,000.00	10,524,000	10,522,500	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2021年 4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	9,778,946,130	64.55
	カナダ	514,801,807	3.40
	ドイツ	443,044,759	2.92
	イタリア	84,960,563	0.56
	フランス	493,548,386	3.26
	オランダ	271,783,016	1.79
	スペイン	115,572,369	0.76
	ベルギー	37,924,472	0.25
	オーストリア	6,370,595	0.04
	ルクセンブルク	12,092,388	0.08
	フィンランド	54,806,181	0.36
	アイルランド	280,785,939	1.85
	ポルトガル	4,169,130	0.03
	イギリス	630,322,090	4.16
	スイス	474,805,199	3.13
	スウェーデン	158,106,109	1.04

	ノルウェー	28,196,416	0.19
	デンマーク	113,953,693	0.75
	ケイマン	24,010,419	0.16
	オーストラリア	306,956,363	2.03
	バミューダ	21,940,372	0.14
	ニュージーランド	13,005,808	0.09
	パプアニューギニア	1,912,824	0.01
	香港	121,596,719	0.80
	シンガポール	41,271,995	0.27
	イスラエル	30,736,441	0.20
	ジャージー	43,757,830	0.29
	マン島	2,765,452	0.02
	小計	14,112,143,465	93.16
投資証券	アメリカ	277,843,463	1.83
	フランス	7,311,534	0.05
	イギリス	9,451,568	0.06
	オーストラリア	22,183,527	0.15
	香港	6,136,456	0.04
	シンガポール	5,455,055	0.04
	小計	328,381,603	2.17
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	708,113,421	4.67
合計（純資産総額）		15,148,638,489	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	618,133,088	4.08
	買建	ドイツ	119,812,602	0.79

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	14,894,055,646	△98.32

(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	42,834	12,552.82	537,687,802	14,539.97	622,805,349	4.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,102	23,586.83	426,968,937	27,505.91	497,912,061	3.29
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,076	348,596.31	375,089,630	378,129.79	406,867,663	2.69
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	6,059	30,926.62	187,384,394	35,893.52	217,478,864	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	751	179,635.80	134,906,490	264,687.91	198,780,626	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	755	179,451.46	135,485,855	260,643.34	196,785,727	1.30
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,912	47,397.00	90,623,075	73,745.60	141,001,606	0.93
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,669	11,471.59	87,975,678	16,904.84	129,643,269	0.86
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	6,669	15,859.69	105,768,334	17,886.30	119,283,775	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	4,251	21,661.23	92,081,914	25,801.15	109,680,730	0.72
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,405	36,035.20	86,664,679	43,740.84	105,196,724	0.69
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,560	59,197.81	92,348,591	66,773.00	104,165,881	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,434	23,239.53	79,804,547	30,238.96	103,840,616	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	2,734	30,738.59	84,039,314	35,439.28	96,891,008	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	7,278	12,738.57	92,711,360	13,083.91	95,224,752	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	2,240	35,989.80	80,617,157	42,368.32	94,905,045	0.63
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	4,586	14,214.34	65,186,989	20,187.99	92,582,154	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,294	15,439.52	97,176,350	14,434.31	90,849,574	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	19,564	2,745.22	53,707,507	4,478.11	87,609,789	0.58
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	2,816	22,275.06	62,726,578	29,176.90	82,162,152	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,076	42,466.92	45,694,415	71,644.17	77,089,129	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	11,572	4,947.23	57,249,445	6,143.65	71,094,341	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,215	53,105.34	64,522,990	56,217.68	68,304,486	0.45
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	10,629	3,782.85	40,207,917	6,420.33	68,241,732	0.45
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	10,533	6,316.22	66,528,748	6,243.86	65,766,657	0.43
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	10,314	5,250.42	54,152,893	6,348.44	65,477,814	0.43
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,762	35,657.80	62,829,054	35,940.02	63,326,317	0.42

アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	1,120	53,321.46	59,720,046	55,445.36	62,098,814	0.41
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	18,106	3,034.58	54,944,178	3,413.86	61,811,461	0.41
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,313	5,502.73	56,749,698	5,910.54	60,955,418	0.40

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	3.13
		素材	4.33
		資本財	6.32
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.96
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	1.89
		消費者サービス	1.81
		メディア・娯楽	7.07
		小売	5.45
		食品・生活必需品小売り	1.21
		食品・飲料・タバコ	3.76
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	4.98
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.89
		銀行	6.06
		各種金融	4.32
		保険	3.04
		不動産	0.38
		ソフトウェア・サービス	11.30
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.62
		電気通信サービス	1.68
		公益事業	2.87
		半導体・半導体製造装置	4.30
投資証券	―	―	2.17
合　　計			95.33

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 EMINI2106	買建	27	米ドル	5,471,467.5	596,006,954	5,674,590	618,133,088	4.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2106	買建	27	ユーロ	891,850	117,715,281	907,740	119,812,602	0.79

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	99,150,000.00	10,712,230,158	10,795,262,764	△71.26
	加ドル	売建	5,714,000.00	489,564,478	506,687,327	△3.34
	ユーロ	売建	12,146,000.00	1,576,715,087	1,604,001,014	△10.59
	英ポンド	売建	4,461,000.00	669,895,092	677,587,430	△4.47
	スイスフラン	売建	3,631,000.00	428,730,679	435,583,470	△2.88
	スウェーデンクローナ	売建	13,064,000.00	166,531,176	170,093,280	△1.12
	ノルウェークローネ	売建	2,129,000.00	26,931,052	28,306,022	△0.19
	デンマーククローネ	売建	6,428,000.00	112,236,170	114,135,820	△0.75
	豪ドル	売建	4,056,000.00	337,915,079	343,636,809	△2.27
	ニュージーランドドル	売建	121,000.00	9,357,838	9,541,645	△0.06
	香港ドル	売建	10,548,000.00	146,961,411	147,958,893	△0.98
	シンガポールドル	売建	593,000.00	48,118,993	48,679,323	△0.32
	イスラエルシュケル	売建	375,000.00	12,271,755	12,581,849	△0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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2021年 4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	34,988,592,462	75.26
地方債証券	日本	4,679,470,512	10.07
特殊債券	日本	4,898,413,145	10.54
社債券	日本	1,824,190,000	3.92
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	101,316,244	0.22
合計（純資産総額）		46,491,982,363	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	100.60	824,936,400	0.100	2029/12/20	1.77
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	740,000,000	100.88	746,569,200	100.53	743,922,000	0.100	2030/3/20	1.60
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	102.09	714,672,000	101.90	713,335,000	0.300	2025/12/20	1.53
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	690,000,000	101.07	697,448,300	101.03	697,120,800	0.100	2027/3/20	1.50
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	680,000,000	101.14	687,795,400	100.99	686,793,200	0.100	2028/3/20	1.48
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	610,000,000	101.23	617,545,700	101.01	616,203,700	0.100	2026/12/20	1.33
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	590,000,000	101.21	597,178,000	100.99	595,882,300	0.100	2027/12/20	1.28
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	590,000,000	101.08	596,409,100	100.92	595,445,700	0.100	2028/9/20	1.28
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	550,000,000	100.91	555,009,000	100.40	552,244,000	0.100	2030/6/20	1.19
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	535,000,000	101.18	541,317,100	100.96	540,157,400	0.100	2028/6/20	1.16
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	490,000,000	102.44	501,995,200	102.13	500,461,500	0.500	2024/9/20	1.08
日本	国債証券	第１４４回利付国債（２０年）	430,000,000	116.64	501,552,000	115.67	497,415,400	1.500	2033/3/20	1.07
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	420,000,000	102.46	430,336,200	102.28	429,605,400	0.400	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第１４０回利付国債（２０年）	358,000,000	118.60	424,588,000	117.53	420,768,140	1.700	2032/9/20	0.91
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	355,000,000	119.31	423,554,050	118.31	420,014,700	1.700	2033/6/20	0.90
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	360,000,000	115.24	414,864,000	114.55	412,408,800	1.300	2035/6/20	0.89
日本	国債証券	第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	119.67	410,474,960	118.21	405,460,300	2.100	2030/3/20	0.87
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	390,000,000	102.31	399,044,100	102.06	398,041,800	0.400	2025/3/20	0.86
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	350,000,000	113.75	398,132,000	113.03	395,636,500	1.200	2035/3/20	0.85
日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	350,000,000	111.09	388,821,500	110.50	386,760,500	1.000	2035/12/20	0.83
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	370,000,000	102.38	378,809,700	102.17	378,047,500	0.400	2025/6/20	0.81
日本	国債証券	第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	118.84	344,650,500	117.39	340,433,900	2.100	2029/9/20	0.73
日本	国債証券	第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	113.62	340,884,000	112.30	336,903,000	2.300	2026/6/20	0.72
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	325,000,000	100.91	327,967,750	100.82	327,684,500	0.100	2029/3/20	0.70
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	300,000,000	101.05	303,172,000	100.87	302,631,000	0.100	2028/12/20	0.65
日本	国債証券	第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	103.29	304,720,250	102.48	302,321,900	1.400	2022/12/20	0.65
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	285,000,000	102.71	292,729,200	102.38	291,808,650	0.500	2038/3/20	0.63
日本	国債証券	第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	114.24	285,600,000	112.87	282,197,500	2.300	2026/9/20	0.61
日本	国債証券	第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	117.20	269,562,300	116.11	267,071,400	1.600	2032/6/20	0.57

日本	国債証券	第３４回利付国債（３０年）	200,000,000	134.70	269,406,000	133.01	266,024,000	2.200	2041/3/20	0.57

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.26
地方債証券	10.07
特殊債券	10.54
社債券	3.92
合　　計	99.78

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2021年 4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	68,138,770,747	43.81
	カナダ	3,111,084,396	2.00
	メキシコ	1,218,921,823	0.78
	ドイツ	11,705,553,644	7.53
	イタリア	14,746,885,981	9.48
	フランス	16,280,378,885	10.47
	オランダ	2,969,618,222	1.91
	スペイン	9,275,027,783	5.96
	ベルギー	3,751,780,019	2.41
	オーストリア	2,349,535,110	1.51
	フィンランド	998,170,387	0.64
	アイルランド	1,265,057,651	0.81
	イギリス	10,018,874,651	6.44
	スウェーデン	558,378,816	0.36
	ノルウェー	401,040,670	0.26
	デンマーク	791,345,373	0.51

	ポーランド	1,037,057,776	0.67
	オーストラリア	3,411,701,194	2.19
	シンガポール	678,486,610	0.44
	マレーシア	730,295,114	0.47
	イスラエル	702,028,044	0.45
	小計	154,139,992,896	99.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,392,428,548	0.90
合計（純資産総額）		155,532,421,444	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（%）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,888.49	871,079,939	10,894.27	871,542,046	0.125	2022/10/31	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,913.74	873,099,344	10,893.21	871,456,993	0.250	2023/11/15	0.56
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	24,973.72	757,952,472	22,944.61	696,369,024	4.500	2041/4/25	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,590,000	10,700.67	705,174,183	10,009.22	659,607,618	0.625	2030/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,223.19	639,722,062	11,137.24	634,822,718	1.875	2022/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,598.06	614,697,486	11,462.11	607,492,131	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	11,911.02	612,226,793	11,625.72	597,562,222	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,679.28	626,356,480	12,042.29	594,889,445	2.875	2028/5/15	0.38
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,955,000	22,116.24	653,535,022	20,033.87	592,001,087	2.500	2044/7/4	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	12,566.09	624,534,979	11,861.88	589,535,493	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,750,000	10,816.75	621,963,680	10,171.33	584,851,978	0.875	2030/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	15,189.80	596,959,343	14,817.23	582,317,414	4.250	2023/10/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,735,000	22,639.16	619,181,193	21,217.20	580,290,631	4.750	2035/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,040,000	11,866.98	598,096,130	11,480.41	578,612,797	2.000	2026/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,742.73	589,485,495	11,502.75	577,438,151	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	11,676.35	580,315,052	11,488.49	570,978,322	2.000	2025/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,294.40	577,837,247	11,976.98	562,918,105	3.000	2025/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,773.80	565,142,417	11,549.55	554,378,791	2.125	2025/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	12,965.64	584,750,731	12,253.34	552,626,009	3.125	2028/11/15	0.36
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,692,000	22,704.91	611,216,442	20,416.42	549,610,109	2.500	2046/8/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,540,000	22,861.98	580,694,493	21,617.74	549,090,712	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,597.77	561,332,412	11,293.82	546,621,253	1.625	2026/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,862.36	543,118,150	10,872.57	543,628,781	0.250	2024/3/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,762.73	543,438,469	11,592.74	535,584,898	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,687.66	534,383,348	10,668.33	533,416,594	0.375	2026/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,595,000	15,690.97	564,090,415	14,775.47	531,178,339	1.250	2034/5/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,745,000	20,010.42	549,286,115	19,175.66	526,372,020	5.500	2029/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,595.73	529,786,501	10,518.97	525,948,930	0.750	2028/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,814.44	540,722,388	10,392.81	519,640,778	0.500	2027/10/31	0.33

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	11,993.36	527,707,969	11,754.65	517,204,716	2.625	2025/3/31	0.33

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.10
合　　計	99.10

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（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2021年 4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	11,114,482,301	43.87
	カナダ	506,289,574	2.00
	メキシコ	222,025,840	0.88
	ドイツ	1,644,913,828	6.49
	イタリア	2,365,176,751	9.33
	フランス	2,670,845,230	10.54
	オランダ	541,388,974	2.14
	スペイン	1,554,696,204	6.14
	ベルギー	618,520,563	2.44
	オーストリア	433,145,383	1.71
	フィンランド	134,828,364	0.53
	アイルランド	233,064,787	0.92
	イギリス	1,635,514,334	6.46
	スウェーデン	121,111,787	0.48
	ノルウェー	71,138,777	0.28
	デンマーク	81,540,143	0.32
	ポーランド	163,207,619	0.64
	オーストラリア	573,711,054	2.26
	シンガポール	104,559,702	0.41
	マレーシア	245,376,962	0.97

	イスラエル	98,884,994	0.39
	小計	25,134,423,171	99.20
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	202,266,832	0.80
合計（純資産総額）		25,336,690,003	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	25,395,272,760	△100.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,866.98	474,679,468	11,480.41	459,216,506	2.000	2026/11/15	1.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,830,000	11,762.26	450,494,611	11,592.74	444,002,198	2.375	2024/8/15	1.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	11,753.54	446,634,786	11,568.91	439,618,894	2.250	2024/11/15	1.74
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,800,000	22,862.54	411,525,760	21,617.74	389,119,402	5.750	2032/10/25	1.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,900,000	12,131.53	351,814,488	11,595.72	336,276,052	2.250	2027/11/15	1.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,814.44	324,433,433	10,392.81	311,784,467	0.500	2027/10/31	1.23
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,750,000	12,427.82	341,765,152	10,794.06	296,836,909	2.250	2046/8/15	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,550,000	11,182.77	285,160,638	11,110.22	283,310,653	1.625	2022/8/15	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,553.53	277,284,735	11,447.22	274,733,373	2.000	2024/6/30	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	10,676.38	288,262,466	10,171.33	274,626,146	0.875	2030/11/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,598.49	278,363,800	11,293.82	271,051,861	1.625	2026/5/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,243.19	269,836,621	11,172.13	268,131,195	1.500	2023/3/31	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	11,742.73	270,082,996	11,502.75	264,563,296	2.000	2025/8/15	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	11,165.32	262,385,137	11,083.92	260,472,234	1.750	2022/5/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	11,309.00	248,798,081	11,253.83	247,584,274	2.125	2022/12/31	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,906.95	238,139,171	11,625.72	232,514,484	2.250	2025/11/15	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	11,330.84	232,282,371	11,241.06	230,441,834	1.750	2023/5/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,598.06	231,961,316	11,462.11	229,242,314	2.500	2023/8/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,085.47	221,709,586	11,077.07	221,541,420	1.750	2022/4/30	0.87
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	950,000	22,255.29	211,425,311	21,126.79	200,704,549	4.000	2037/1/15	0.79
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000	17,897.52	196,872,799	17,405.70	191,462,767	5.900	2026/7/30	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,270.42	191,597,225	11,179.79	190,056,464	1.875	2022/10/31	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	11,676.35	192,659,927	11,488.49	189,560,207	2.000	2025/2/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	13,657.09	211,685,031	11,874.43	184,053,714	2.750	2047/8/15	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,380.99	182,095,860	11,303.61	180,857,839	1.625	2026/2/15	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,714.30	190,714,644	12,050.80	180,762,091	2.875	2028/8/15	0.71
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000	16,585.05	182,435,641	16,298.54	179,284,023	3.500	2030/3/1	0.71

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,283.19	180,531,049	11,198.51	179,176,221	1.750	2023/1/31	0.71
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,200,000	15,610.66	187,327,996	14,775.47	177,305,705	1.250	2034/5/25	0.70
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1,200,000	15,005.94	180,071,317	14,441.42	173,297,062	1.000	2031/6/22	0.68

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.20
合　　計	99.20

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	102,713,000.00	11,187,146,031	11,183,298,190	△44.14
	加ドル	売建	5,761,000.00	501,951,874	510,854,176	△2.02
	メキシコペソ	売建	42,076,000.00	222,821,248	226,921,185	△0.90
	ユーロ	売建	78,279,000.00	10,199,266,094	10,336,882,136	△40.80
	英ポンド	売建	10,842,000.00	1,641,047,246	1,646,801,911	△6.50
	スウェーデンクローナ	売建	9,441,000.00	121,083,708	122,921,820	△0.49
	ノルウェークローネ	売建	5,411,000.00	69,967,262	71,928,337	△0.28
	デンマーククローネ	売建	4,648,000.00	81,458,473	82,541,547	△0.33
	ポーランドズロチ	売建	5,752,000.00	163,434,065	166,320,340	△0.66
	豪ドル	売建	6,885,000.00	580,097,877	583,300,972	△2.30
	シンガポールドル	売建	1,281,000.00	103,638,380	105,164,704	△0.42
	マレーシアリンギット	売建	9,681,000.00	256,144,738	256,584,255	△1.01
	イスラエルシュケル	売建	3,033,000.00	98,004,242	101,753,187	△0.40

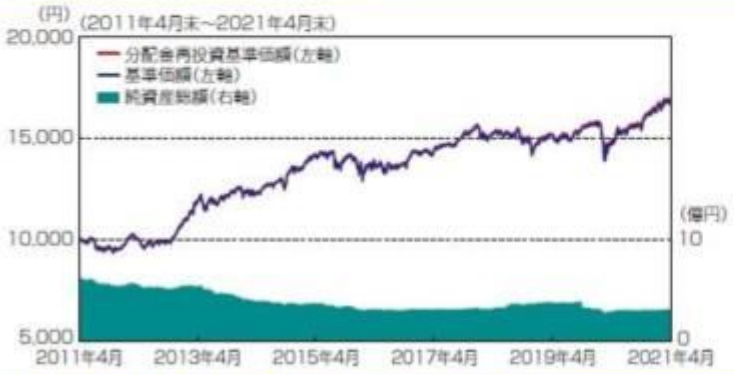
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2021年4月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……16,708円
純資産総額……3.03億円

※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，2011年4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ことにご留意ください。

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2016年10月	2017年10月	2018年10月	2019年10月	2020年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	110円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比　率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	29.94%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.06%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5.02%
日本債券インデックスマザーファンド	44.98%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.02%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.98%
現金その他	5.00%

※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産		銘　柄	業　種　・　種　類	比　率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.12%
	2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.91%
	3	ソニーグループ	電気機器	2.58%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.26%
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.40%
	3	AMAZON.COM INC	小売	2.78%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.11%
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.29%
	3	AMAZON.COM INC	小売	2.69%
日本債券インデックスマザーファンド	1	第357回利付国債(10年)	国債証券	1.77%
	2	第358回利付国債(10年)	国債証券	1.60%
	3	第341回利付国債(10年)	国債証券	1.53%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1	US TREASURY N/B(クーポン0.125%)	国債証券	0.56%
	2	US TREASURY N/B(クーポン0.250%)	国債証券	0.56%
	3	FRANCE (GOVT OF)(クーポン4.500%)	国債証券	0.45%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1	US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	1.81%
	2	US TREASURY N/B(クーポン2.375%)	国債証券	1.75%
	3	US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	1.74%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。

（２）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。

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

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

（５）申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。

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

（７）受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

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

（９）乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の１年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。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。

（４）解約価額

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

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

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

（５）手取額

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

（６）解約単位

１口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（７）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。

（８）受付の中止および取消

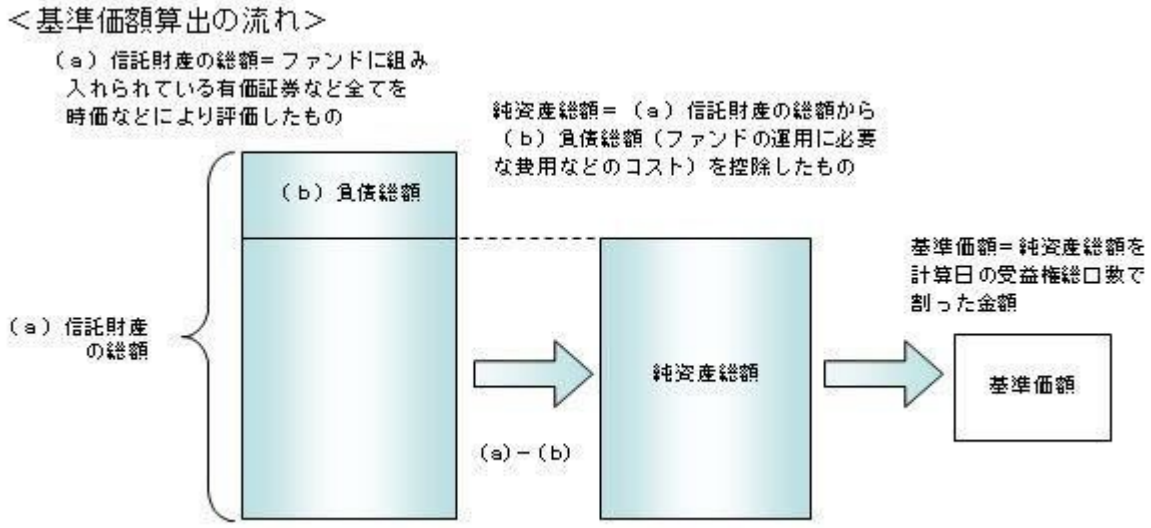
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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



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。

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

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。

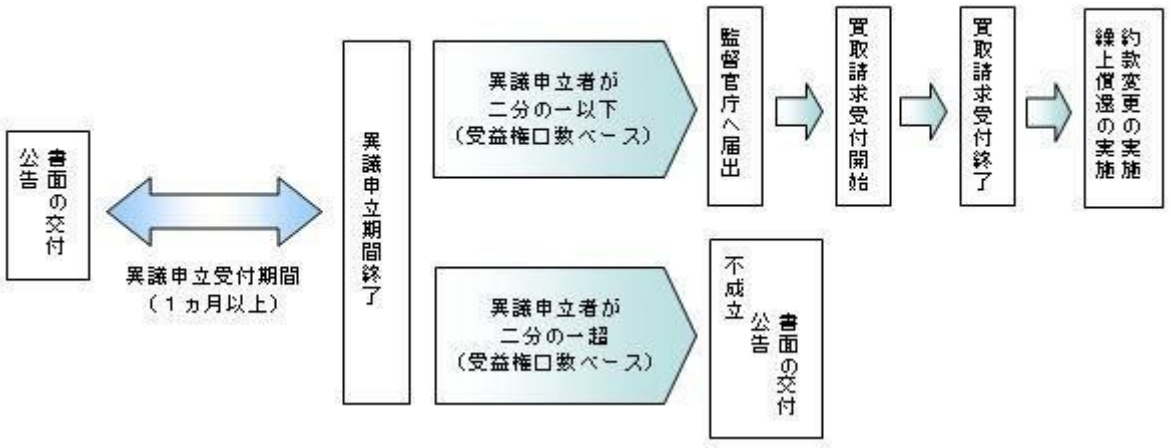
④　異議の申立て

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、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

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

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

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）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2019年10月29日から2020年10月26日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2019年10月28日現在	第21期 2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,192,104	16,048,180
親投資信託受益証券	367,498,309	286,653,758
未収入金	2,153,162	3,018,193
流動資産合計	390,843,575	305,720,131
資産合計	390,843,575	305,720,131
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	251,025	193,659
未払解約金	2,550,316	3,039,365
未払受託者報酬	83,552	66,486
未払委託者報酬	1,191,483	948,324
未払利息	5	4
その他未払費用	8,301	6,585
流動負債合計	4,084,682	4,254,423
負債合計	4,084,682	4,254,423
純資産の部		
元本等		
元本	251,025,434	193,659,578
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	135,733,459	107,806,130
（分配準備積立金）	84,496,305	65,436,609
元本等合計	386,758,893	301,465,708
純資産合計	386,758,893	301,465,708
負債純資産合計	390,843,575	305,720,131

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期 自　2018年10月27日 至　2019年10月28日	第21期 自　2019年10月29日 至　2020年10月26日
営業収益		
受取利息	10	-
有価証券売買等損益	20,111,351	5,716,298
営業収益合計	20,111,361	5,716,298
営業費用		
支払利息	7,543	4,217
受託者報酬	164,054	134,875
委託者報酬	2,339,538	1,923,716
その他費用	17,370	13,408
営業費用合計	2,528,505	2,076,216
営業利益又は営業損失（△）	17,582,856	3,640,082
経常利益又は経常損失（△）	17,582,856	3,640,082
当期純利益又は当期純損失（△）	17,582,856	3,640,082
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（△）	510,666	455,247
期首剰余金又は期首欠損金（△）	114,023,513	135,733,459
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,333,809	4,906,516
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,333,809	4,906,516
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,445,028	35,825,021
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,445,028	35,825,021
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	251,025	193,659
期末剰余金又は期末欠損金（△）	135,733,459	107,806,130

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2019年10月29日から2020年10月26日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第20期 2019年10月28日現在	第21期 2020年10月26日現在
１．	期首元本額	241,607,633円	251,025,434円
	期中追加設定元本額	27,380,609円	9,217,244円
	期中一部解約元本額	17,962,808円	66,583,100円
２．	受益権の総数	251,025,434口	193,659,578口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第20期 自 2018年10月27日 至 2019年10月28日		第21期 自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	7,729,782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	3,183,446円
C 信託約款に定める収益調整金	72,021,367円	C 信託約款に定める収益調整金	58,483,501円
D 信託約款に定める分配準備積立金	77,017,548円	D 信託約款に定める分配準備積立金	62,446,822円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	156,768,697円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	124,113,769円
F 分配対象収益(1万口当たり)	6,245円	F 分配対象収益(1万口当たり)	6,408円
G 分配金額	251,025円	G 分配金額	193,659円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第20期 自 2018年10月27日 至 2019年10月28日	第21期 自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	第20期 2019年10月28日現在	第21期 2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第20期（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	18,935,833
合計	18,935,833

第21期（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,052,764
合計	6,052,764

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第20期 2019年10月28日現在		第21期 2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5407円	1口当たり純資産額	1.5567円
(1万口当たり純資産額)	(15,407円)	(1万口当たり純資産額)	(15,567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	5,328,950	15,127,823	
	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	7,811,402	15,185,365	
	日本債券インデックスマザーファンド	96,410,954	136,209,395	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	6,124,228	15,022,731	
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	9,124,934	15,088,078	
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	58,523,187	90,020,366	
合計		183,323,655	286,653,758	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	105,155,626	114,776,019
株式	32,604,968,140	33,489,436,240
派生商品評価勘定	9,697,520	445,600
未収入金	117,101	-

未収配当金	315,854,716	292,763,801
前払金	-	2,115,000
流動資産合計	33,035,793,103	33,899,536,660
資産合計	33,035,793,103	33,899,536,660
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,333,250
前受金	9,250,000	-
未払解約金	51,516,719	28,402,432
未払利息	28	32
流動負債合計	60,766,747	31,735,714
負債合計	60,766,747	31,735,714
純資産の部		
元本等		
元本	21,582,031,788	22,017,538,384
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	11,392,994,568	11,850,262,562
元本等合計	32,975,026,356	33,867,800,946
純資産合計	32,975,026,356	33,867,800,946
負債純資産合計	33,035,793,103	33,899,536,660

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）

		2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
1．	期首	2018年10月27日	2019年10月29日
	期首元本額	19,319,878,842円	21,582,031,788円
	期首からの追加設定元本額	3,992,379,046円	5,024,902,333円
	期首からの一部解約元本額	1,730,226,100円	4,589,395,737円

	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	574,416,732円	694,622,832円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	1,483,712,124円	1,780,001,539円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	2,874,696,617円	3,373,731,467円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	2,939,858,857円	3,455,337,100円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,366,211,327円	1,361,389,089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	3,595,775,852円	3,267,569,917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）	739,710,271円	734,514,070円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	51,444,028円	49,415,304円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	42,771,993円	41,038,145円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	77,144,007円	58,523,187円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	61,225,049円	53,449,514円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,329,728,922円	3,758,810,767円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	285,200,157円	292,909,234円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	817,760,788円	799,731,646円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,188,038,465円	1,179,083,972円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	1,154,336,599円	1,117,410,601円
	計	21,582,031,788円	22,017,538,384円
２．	受益権の総数	21,582,031,788口	22,017,538,384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	424,630,000円	369,625,000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 2018年10月27日 至 2019年10月28日	自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	111,722,397
合計	111,722,397

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	369,100,000	－	378,810,000	9,710,000
合計		369,100,000	－	378,810,000	9,710,000

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	375,130,000	－	372,255,000	△2,875,000
合計		375,130,000	－	372,255,000	△2,875,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2019年10月28日現在		2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5279円	1口当たり純資産額	1.5382円
(1万口当たり純資産額)	(15,279円)	(1万口当たり純資産額)	(15,382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	2,730.00	1,911,000	
日本水産	20,000	422.00	8,440,000	
マルハニチロ	2,900	2,238.00	6,490,200	
カネコ種苗	600	1,532.00	919,200	
サカタのタネ	2,400	3,725.00	8,940,000	
ホクト	1,500	2,201.00	3,301,500	
ホクリヨウ	300	676.00	202,800	
住石ホールディングス	4,300	125.00	537,500	
日鉄鉱業	500	4,785.00	2,392,500	
三井松島ホールディングス	800	717.00	573,600	
国際石油開発帝石	73,700	544.50	40,129,650	
石油資源開発	2,600	1,823.00	4,739,800	
K＆Oエナジーグループ	900	1,428.00	1,285,200	
ヒノキヤグループ	500	2,018.00	1,009,000	

ショーボンドホールディングス	3,100	5,120.00	15,872,000	
ミライト・ホールディングス	6,000	1,530.00	9,180,000	
サンヨーホームズ	200	688.00	137,600	
日本アクア	900	723.00	650,700	
ファーストコーポレーション	700	708.00	495,600	
ベステラ	400	1,437.00	574,800	
キャンディル	400	610.00	244,000	
スペースバリューホールディングス	2,500	572.00	1,430,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	712.00	284,800	
第一カッター興業	300	2,149.00	644,700	
安藤・間	12,000	681.00	8,172,000	
東急建設	6,000	481.00	2,886,000	
コムシスホールディングス	7,100	2,716.00	19,283,600	
ビーアールホールディングス	2,300	748.00	1,720,400	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,189.00	2,845,700	
東建コーポレーション	600	7,890.00	4,734,000	
ソネック	300	872.00	261,600	
ヤマウラ	900	893.00	803,700	
大成建設	15,400	3,400.00	52,360,000	
大林組	46,300	909.00	42,086,700	
清水建設	47,000	759.00	35,673,000	
飛島建設	1,400	1,090.00	1,526,000	
長谷工コーポレーション	17,900	1,315.00	23,538,500	
松井建設	1,900	709.00	1,347,100	
錢高組	200	4,265.00	853,000	
鹿島建設	36,400	1,166.00	42,442,400	
不動テトラ	1,200	1,532.00	1,838,400	
大末建設	600	812.00	487,200	
鉄建建設	1,000	2,018.00	2,018,000	
西松建設	3,600	2,082.00	7,495,200	
三井住友建設	11,200	424.00	4,748,800	
大豊建設	1,100	3,295.00	3,624,500	
前田建設工業	11,700	768.00	8,985,600	
ナカノフドー建設	1,400	419.00	586,600	
奥村組	2,200	2,500.00	5,500,000	
東鉄工業	2,000	2,749.00	5,498,000	

イチケン	400	1,659.00	663,600	
富士ピー・エス	800	547.00	437,600	
淺沼組	500	4,095.00	2,047,500	
戸田建設	19,300	609.00	11,753,700	
熊谷組	2,200	2,517.00	5,537,400	
北野建設	300	2,586.00	775,800	
植木組	200	2,735.00	547,000	
矢作建設工業	2,100	854.00	1,793,400	
ピーエス三菱	1,600	590.00	944,000	
日本ハウスホールディングス	3,300	267.00	881,100	
大東建託	5,100	9,828.00	50,122,800	
新日本建設	2,000	891.00	1,782,000	
ＮＩＰＰＯ	3,800	2,755.00	10,469,000	
東亜道路工業	300	3,575.00	1,072,500	
前田道路	4,100	1,819.00	7,457,900	
日本道路	500	7,780.00	3,890,000	
東亜建設工業	1,500	1,863.00	2,794,500	
日本国土開発	4,600	554.00	2,548,400	
若築建設	900	1,187.00	1,068,300	
東洋建設	5,300	413.00	2,188,900	
五洋建設	18,400	668.00	12,291,200	
福田組	500	5,000.00	2,500,000	
住友林業	11,700	1,723.00	20,159,100	
日本基礎技術	1,700	440.00	748,000	
巴コーポレーション	2,200	361.00	794,200	
大和ハウス工業	45,800	2,934.50	134,400,100	
ライト工業	2,700	1,532.00	4,136,400	
積水ハウス	50,300	1,782.00	89,634,600	
日特建設	1,300	804.00	1,045,200	
北陸電気工事	800	1,095.00	876,000	
ユアテック	2,700	631.00	1,703,700	
日本リーテック	1,000	2,273.00	2,273,000	
四電工	300	2,250.00	675,000	
中電工	1,900	2,173.00	4,128,700	
関電工	6,600	814.00	5,372,400	
きんでん	11,000	1,715.00	18,865,000	

東京エネシス	1,600	781.00	1,249,600	
トーエネック	500	3,425.00	1,712,500	
住友電設	1,300	2,502.00	3,252,600	
日本電設工業	2,600	2,081.00	5,410,600	
協和エクシオ	7,000	2,481.00	17,367,000	
新日本空調	1,300	2,157.00	2,804,100	
九電工	3,300	2,902.00	9,576,600	
三機工業	3,300	1,171.00	3,864,300	
日揮ホールディングス	14,300	962.00	13,756,600	
中外炉工業	500	1,462.00	731,000	
ヤマト	1,500	660.00	990,000	
太平電業	1,100	2,306.00	2,536,600	
高砂熱学工業	3,900	1,437.00	5,604,300	
三晃金属工業	200	2,637.00	527,400	
朝日工業社	300	2,878.00	863,400	
明星工業	3,100	805.00	2,495,500	
大氣社	2,300	2,815.00	6,474,500	
ダイダン	1,100	2,580.00	2,838,000	
日比谷総合設備	1,500	1,716.00	2,574,000	
フィル・カンパニー	300	2,202.00	660,600	
ＯＳＪＢホールディングス	7,500	249.00	1,867,500	
東洋エンジニアリング	2,100	338.00	709,800	
レイズネクスト	2,500	1,238.00	3,095,000	
日本製粉	4,300	1,711.00	7,357,300	
日清製粉グループ本社	16,700	1,666.00	27,822,200	
日東富士製粉	100	6,720.00	672,000	
昭和産業	1,400	3,220.00	4,508,000	
鳥越製粉	1,300	1,050.00	1,365,000	
中部飼料	1,800	1,503.00	2,705,400	
フィード・ワン	2,000	920.00	1,840,000	
東洋精糖	300	1,251.00	375,300	
日本甜菜製糖	800	1,811.00	1,448,800	
三井製糖	1,300	1,873.00	2,434,900	
塩水港精糖	1,700	220.00	374,000	
日新製糖	700	1,884.00	1,318,800	
森永製菓	3,500	4,005.00	14,017,500	

中村屋	400	4,035.00	1,614,000	
江崎グリコ	4,100	4,450.00	18,245,000	
名糖産業	700	1,403.00	982,100	
井村屋グループ	800	2,260.00	1,808,000	
不二家	1,000	2,301.00	2,301,000	
山崎製パン	11,100	1,803.00	20,013,300	
第一屋製パン	300	997.00	299,100	
モロゾフ	300	5,670.00	1,701,000	
亀田製菓	800	5,060.00	4,048,000	
寿スピリッツ	1,400	5,420.00	7,588,000	
カルビー	6,700	3,225.00	21,607,500	
森永乳業	2,700	4,980.00	13,446,000	
六甲バター	1,000	1,668.00	1,668,000	
ヤクルト本社	10,200	5,120.00	52,224,000	
明治ホールディングス	9,800	7,470.00	73,206,000	
雪印メグミルク	3,600	2,289.00	8,240,400	
プリマハム	2,300	3,080.00	7,084,000	
日本ハム	5,700	4,335.00	24,709,500	
林兼産業	500	569.00	284,500	
丸大食品	1,600	1,687.00	2,699,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,200	3,465.00	4,158,000	
柿安本店	500	2,510.00	1,255,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,500	721.00	6,849,500	
サッポロホールディングス	5,100	1,797.00	9,164,700	
アサヒグループホールディングス	32,400	3,479.00	112,719,600	
キリンホールディングス	62,800	1,974.00	123,967,200	
宝ホールディングス	11,000	1,133.00	12,463,000	
オエノンホールディングス	4,200	405.00	1,701,000	
養命酒製造	500	1,862.00	931,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	11,300	1,606.00	18,147,800	
サントリー食品インターナショナル	9,900	3,855.00	38,164,500	
ダイドーグループホールディングス	800	5,280.00	4,224,000	
伊藤園	4,500	6,580.00	29,610,000	
キーコーヒー	1,500	2,168.00	3,252,000	
ユニカフェ	500	1,059.00	529,500	

ジャパンフーズ	200	1,268.00	253,600	
日清オイリオグループ	1,900	3,045.00	5,785,500	
不二製油グループ本社	3,600	3,365.00	12,114,000	
Ｊ－オイルミルズ	800	3,760.00	3,008,000	
キッコーマン	10,700	5,300.00	56,710,000	
味の素	32,700	2,082.50	68,097,750	
キユーピー	8,200	2,137.00	17,523,400	
ハウス食品グループ本社	5,500	3,450.00	18,975,000	
カゴメ	6,100	3,485.00	21,258,500	
焼津水産化学工業	700	994.00	695,800	
アリアケジャパン	1,400	6,860.00	9,604,000	
ピエトロ	200	1,668.00	333,600	
エバラ食品工業	400	2,387.00	954,800	
やまみ	100	2,204.00	220,400	
ニチレイ	7,100	2,632.00	18,687,200	
東洋水産	7,600	5,230.00	39,748,000	
イートアンドホールディングス	500	1,830.00	915,000	
大冷	200	2,147.00	429,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	834.00	667,200	
日清食品ホールディングス	6,300	8,960.00	56,448,000	
永谷園ホールディングス	700	2,327.00	1,628,900	
一正蒲鉾	600	1,128.00	676,800	
フジッコ	1,600	1,996.00	3,193,600	
ロック・フィールド	1,600	1,436.00	2,297,600	
日本たばこ産業	79,500	1,999.50	158,960,250	
ケンコーマヨネーズ	800	1,772.00	1,417,600	
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,503.00	1,503,000	
なとり	800	1,983.00	1,586,400	
イフジ産業	300	904.00	271,200	
ピックルスコーポレーション	300	2,875.00	862,500	
北の達人コーポレーション	5,200	482.00	2,506,400	
ユーグレナ	6,400	866.00	5,542,400	
ミヨシ油脂	500	1,133.00	566,500	
理研ビタミン	1,400	1,320.00	1,848,000	
片倉工業	2,000	1,164.00	2,328,000	
グンゼ	1,100	3,890.00	4,279,000	

東洋紡	5,700	1,508.00	8,595,600	
ユニチカ	4,300	379.00	1,629,700	
富士紡ホールディングス	700	3,745.00	2,621,500	
倉敷紡績	1,500	1,941.00	2,911,500	
シキボウ	800	949.00	759,200	
日本毛織	4,700	1,036.00	4,869,200	
ダイトウボウ	2,400	104.00	249,600	
トーア紡コーポレーション	600	480.00	288,000	
ダイドーリミテッド	2,000	197.00	394,000	
帝国繊維	1,600	2,598.00	4,156,800	
帝人	11,800	1,669.00	19,694,200	
東レ	104,700	503.30	52,695,510	
サカイオーベックス	400	1,943.00	777,200	
住江織物	300	2,100.00	630,000	
日本フエルト	800	493.00	394,400	
イチカワ	200	1,368.00	273,600	
日東製網	200	1,468.00	293,600	
アツギ	1,200	572.00	686,400	
ダイニック	600	814.00	488,400	
セーレン	3,600	1,661.00	5,979,600	
ソトー	600	940.00	564,000	
東海染工	200	1,138.00	227,600	
小松マテーレ	2,400	824.00	1,977,600	
ワコールホールディングス	3,600	1,969.00	7,088,400	
ホギメディカル	1,600	3,125.00	5,000,000	
クラウディアホールディングス	400	293.00	117,200	
ＴＳＩホールディングス	4,400	272.00	1,196,800	
マツオカコーポレーション	400	2,177.00	870,800	
ワールド	2,100	1,396.00	2,931,600	
三陽商会	800	517.00	413,600	
ナイガイ	600	379.00	227,400	
オンワードホールディングス	8,800	222.00	1,953,600	
ルックホールディングス	500	984.00	492,000	
ゴールドウイン	2,600	7,990.00	20,774,000	
デサント	2,800	1,701.00	4,762,800	
キング	700	588.00	411,600	

ヤマトインターナショナル	1,300	325.00	422,500	
特種東海製紙	900	4,445.00	4,000,500	
王子ホールディングス	60,300	461.00	27,798,300	
日本製紙	6,400	1,270.00	8,128,000	
三菱製紙	1,700	331.00	562,700	
北越コーポレーション	8,700	362.00	3,149,400	
中越パルプ工業	600	1,248.00	748,800	
巴川製紙所	500	969.00	484,500	
大王製紙	6,600	1,521.00	10,038,600	
阿波製紙	400	439.00	175,600	
レンゴー	13,600	862.00	11,723,200	
トーモク	900	1,679.00	1,511,100	
ザ・パック	1,100	2,985.00	3,283,500	
クラレ	22,800	1,036.00	23,620,800	
旭化成	95,900	954.10	91,498,190	
共和レザー	800	641.00	512,800	
昭和電工	11,000	1,929.00	21,219,000	
住友化学	106,200	363.00	38,550,600	
住友精化	600	3,435.00	2,061,000	
日産化学	8,000	5,620.00	44,960,000	
ラサ工業	500	2,055.00	1,027,500	
クレハ	1,200	4,745.00	5,694,000	
多木化学	600	6,670.00	4,002,000	
テイカ	1,100	1,400.00	1,540,000	
石原産業	2,600	727.00	1,890,200	
片倉コープアグリ	400	1,251.00	500,400	
日本曹達	2,100	2,829.00	5,940,900	
東ソー	22,300	1,742.00	38,846,600	
トクヤマ	4,200	2,639.00	11,083,800	
セントラル硝子	2,900	2,303.00	6,678,700	
東亞合成	9,100	1,131.00	10,292,100	
大阪ソーダ	1,500	2,557.00	3,835,500	
関東電化工業	3,500	737.00	2,579,500	
デンカ	5,300	3,345.00	17,728,500	
信越化学工業	24,800	14,630.00	362,824,000	
日本カーバイド工業	500	1,254.00	627,000	

堺化学工業	900	1,981.00	1,782,900	
第一稀元素化学工業	1,600	710.00	1,136,000	
エア・ウォーター	13,400	1,541.00	20,649,400	
日本酸素ホールディングス	13,900	1,645.00	22,865,500	
日本化学工業	500	2,493.00	1,246,500	
東邦アセチレン	200	1,253.00	250,600	
日本パーカライジング	7,300	1,063.00	7,759,900	
高圧ガス工業	2,300	779.00	1,791,700	
四国化成工業	2,100	1,191.00	2,501,100	
戸田工業	300	1,934.00	580,200	
ステラ　ケミファ	800	2,982.00	2,385,600	
保土谷化学工業	500	5,240.00	2,620,000	
日本触媒	2,200	5,420.00	11,924,000	
大日精化工業	1,300	2,283.00	2,967,900	
カネカ	3,700	3,035.00	11,229,500	
三菱瓦斯化学	13,400	2,029.00	27,188,600	
三井化学	13,400	2,792.00	37,412,800	
ＪＳＲ	13,500	2,525.00	34,087,500	
東京応化工業	2,500	6,290.00	15,725,000	
大阪有機化学工業	1,300	2,715.00	3,529,500	
三菱ケミカルホールディングス	96,600	625.50	60,423,300	
ＫＨネオケム	2,400	2,600.00	6,240,000	
ダイセル	18,800	789.00	14,833,200	
住友ベークライト	2,300	3,095.00	7,118,500	
積水化学工業	30,600	1,735.00	53,091,000	
日本ゼオン	13,000	1,336.00	17,368,000	
アイカ工業	4,300	3,595.00	15,458,500	
宇部興産	7,300	1,871.00	13,658,300	
積水樹脂	2,600	2,083.00	5,415,800	
タキロンシーアイ	3,200	680.00	2,176,000	
旭有機材	800	1,357.00	1,085,600	
ニチバン	800	1,689.00	1,351,200	
リケンテクノス	3,500	410.00	1,435,000	
大倉工業	700	1,777.00	1,243,900	
積水化成品工業	2,000	574.00	1,148,000	
群栄化学工業	300	2,516.00	754,800	

タイガースポリマー	800	431.00	344,800	
ミライアル	500	1,203.00	601,500	
ダイキアクシス	600	880.00	528,000	
ダイキョーニシカワ	3,100	608.00	1,884,800	
竹本容器	600	1,087.00	652,200	
森六ホールディングス	800	1,845.00	1,476,000	
日本化薬	9,000	928.00	8,352,000	
カーリットホールディングス	1,600	515.00	824,000	
日本精化	1,200	1,615.00	1,938,000	
扶桑化学工業	1,500	3,720.00	5,580,000	
トリケミカル研究所	300	13,010.00	3,903,000	
ＡＤＥＫＡ	6,700	1,431.00	9,587,700	
日油	5,400	3,960.00	21,384,000	
新日本理化	2,400	159.00	381,600	
ハリマ化成グループ	1,200	1,116.00	1,339,200	
花王	35,300	7,551.00	266,550,300	
第一工業製薬	500	3,945.00	1,972,500	
石原ケミカル	400	2,068.00	827,200	
日華化学	500	915.00	457,500	
ニイタカ	300	3,040.00	912,000	
三洋化成工業	900	4,710.00	4,239,000	
有機合成薬品工業	1,100	317.00	348,700	
大日本塗料	1,700	940.00	1,598,000	
日本ペイントホールディングス	11,900	9,480.00	112,812,000	
関西ペイント	16,200	2,805.00	45,441,000	
神東塗料	1,200	176.00	211,200	
中国塗料	4,100	1,000.00	4,100,000	
日本特殊塗料	1,100	947.00	1,041,700	
藤倉化成	2,000	478.00	956,000	
太陽ホールディングス	1,100	5,520.00	6,072,000	
ＤＩＣ	6,100	2,653.00	16,183,300	
サカタインクス	3,200	1,117.00	3,574,400	
東洋インキＳＣホールディングス	3,100	2,017.00	6,252,700	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,100	836.00	919,600	
富士フイルムホールディングス	28,300	5,434.00	153,782,200	
資生堂	29,300	6,641.00	194,581,300	

ライオン	19,200	2,097.00	40,262,400	
高砂香料工業	900	2,149.00	1,934,100	
マンダム	3,300	1,770.00	5,841,000	
ミルボン	2,000	5,330.00	10,660,000	
ファンケル	6,000	3,290.00	19,740,000	
コーセー	2,800	14,900.00	41,720,000	
コタ	900	1,270.00	1,143,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,300	2,200.00	13,860,000	
ノエビアホールディングス	1,200	4,690.00	5,628,000	
アジュバンコスメジャパン	300	1,007.00	302,100	
エステー	1,000	1,955.00	1,955,000	
アグロ　カネショウ	600	1,551.00	930,600	
コニシ	2,500	1,518.00	3,795,000	
長谷川香料	2,500	2,070.00	5,175,000	
星光ＰＭＣ	900	644.00	579,600	
小林製薬	4,100	9,750.00	39,975,000	
荒川化学工業	1,300	1,206.00	1,567,800	
メック	1,000	2,119.00	2,119,000	
日本高純度化学	400	2,623.00	1,049,200	
タカラバイオ	3,900	2,891.00	11,274,900	
ＪＣＵ	1,800	3,340.00	6,012,000	
新田ゼラチン	1,000	689.00	689,000	
ＯＡＴアグリオ	300	1,273.00	381,900	
デクセリアルズ	3,800	1,163.00	4,419,400	
アース製薬	1,100	6,640.00	7,304,000	
北興化学工業	1,400	973.00	1,362,200	
大成ラミック	500	2,728.00	1,364,000	
クミアイ化学工業	6,100	1,019.00	6,215,900	
日本農薬	2,700	505.00	1,363,500	
アキレス	1,000	1,661.00	1,661,000	
有沢製作所	2,400	959.00	2,301,600	
日東電工	10,200	7,380.00	75,276,000	
レック	1,600	1,456.00	2,329,600	
三光合成	1,800	285.00	513,000	
きもと	2,500	165.00	412,500	
藤森工業	1,300	4,215.00	5,479,500	

前澤化成工業	900	976.00	878,400	
未来工業	800	1,938.00	1,550,400	
ウェーブロックホールディングス	500	728.00	364,000	
ＪＳＰ	900	1,629.00	1,466,100	
エフピコ	3,100	4,085.00	12,663,500	
天馬	1,000	1,807.00	1,807,000	
信越ポリマー	2,700	939.00	2,535,300	
東リ	3,700	259.00	958,300	
ニフコ	5,400	3,150.00	17,010,000	
バルカー	1,200	1,832.00	2,198,400	
ユニ・チャーム	31,300	4,928.00	154,246,400	
ショーエイコーポレーション	200	1,125.00	225,000	
協和キリン	14,800	2,619.00	38,761,200	
武田薬品工業	122,800	3,495.00	429,186,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	127,900	1,471.00	188,140,900	
大日本住友製薬	10,900	1,239.00	13,505,100	
塩野義製薬	18,600	5,035.00	93,651,000	
わかもと製薬	1,900	260.00	494,000	
あすか製薬	1,700	1,351.00	2,296,700	
日本新薬	3,900	7,790.00	30,381,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,427.00	728,100	
中外製薬	46,200	4,167.00	192,515,400	
科研製薬	2,500	4,355.00	10,887,500	
エーザイ	17,700	8,451.00	149,582,700	
ロート製薬	7,600	3,250.00	24,700,000	
小野薬品工業	33,900	3,157.00	107,022,300	
久光製薬	3,900	5,080.00	19,812,000	
持田製薬	2,000	3,855.00	7,710,000	
参天製薬	27,500	1,965.00	54,037,500	
扶桑薬品工業	500	2,678.00	1,339,000	
日本ケミファ	200	2,608.00	521,600	
ツムラ	4,600	3,135.00	14,421,000	
日医工	4,200	1,074.00	4,510,800	
キッセイ薬品工業	2,600	2,122.00	5,517,200	
生化学工業	2,900	983.00	2,850,700	

栄研化学	2,600	2,227.00	5,790,200	
日水製薬	700	1,071.00	749,700	
鳥居薬品	900	2,978.00	2,680,200	
ＪＣＲファーマ	4,100	2,748.00	11,266,800	
東和薬品	1,900	1,981.00	3,763,900	
富士製薬工業	1,000	1,189.00	1,189,000	
沢井製薬	3,000	5,130.00	15,390,000	
ゼリア新薬工業	2,700	1,843.00	4,976,100	
第一三共	126,700	2,680.00	339,556,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	1,942.00	6,408,600	
大幸薬品	1,800	1,859.00	3,346,200	
ダイト	900	3,995.00	3,595,500	
大塚ホールディングス	30,700	4,053.00	124,427,100	
大正製薬ホールディングス	3,100	6,500.00	20,150,000	
ペプチドリーム	7,500	4,755.00	35,662,500	
日本コークス工業	12,700	68.00	863,600	
ニチレキ	1,700	1,644.00	2,794,800	
ユシロ化学工業	800	1,295.00	1,036,000	
ビーピー・カストロール	500	1,220.00	610,000	
富士石油	4,000	194.00	776,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	600	1,008.00	604,800	
出光興産	16,400	2,180.00	35,752,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	222,000	365.80	81,207,600	
コスモエネルギーホールディングス	4,300	1,599.00	6,875,700	
横浜ゴム	8,500	1,600.00	13,600,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	7,700	1,714.00	13,197,800	
ブリヂストン	39,300	3,597.00	141,362,100	
住友ゴム工業	13,200	998.00	13,173,600	
藤倉コンポジット	1,300	343.00	445,900	
オカモト	900	4,260.00	3,834,000	
フコク	600	637.00	382,200	
ニッタ	1,700	2,383.00	4,051,100	
住友理工	2,900	579.00	1,679,100	
三ツ星ベルト	2,000	1,697.00	3,394,000	
バンドー化学	2,600	610.00	1,586,000	
日東紡績	2,200	3,930.00	8,646,000	

ＡＧＣ	13,500	3,255.00	43,942,500	
日本板硝子	7,100	392.00	2,783,200	
石塚硝子	300	1,872.00	561,600	
日本山村硝子	700	849.00	594,300	
日本電気硝子	5,500	2,024.00	11,132,000	
オハラ	600	1,236.00	741,600	
住友大阪セメント	2,800	3,305.00	9,254,000	
太平洋セメント	9,300	2,621.00	24,375,300	
日本ヒューム	1,500	797.00	1,195,500	
日本コンクリート工業	3,200	316.00	1,011,200	
三谷セキサン	700	4,795.00	3,356,500	
アジアパイルホールディングス	2,100	467.00	980,700	
東海カーボン	14,400	1,250.00	18,000,000	
日本カーボン	800	3,730.00	2,984,000	
東洋炭素	900	1,855.00	1,669,500	
ノリタケカンパニーリミテド	800	3,100.00	2,480,000	
ＴＯＴＯ	10,500	4,650.00	48,825,000	
日本碍子	17,700	1,552.00	27,470,400	
日本特殊陶業	11,200	2,004.00	22,444,800	
ダントーホールディングス	900	719.00	647,100	
ＭＡＲＵＷＡ	600	10,130.00	6,078,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,260.00	904,000	
黒崎播磨	300	3,035.00	910,500	
ヨータイ	1,200	781.00	937,200	
イソライト工業	800	470.00	376,000	
東京窯業	1,900	312.00	592,800	
ニッカトー	700	703.00	492,100	
フジミインコーポレーテッド	1,300	3,790.00	4,927,000	
クニミネ工業	600	1,092.00	655,200	
エーアンドエーマテリアル	200	1,057.00	211,400	
ニチアス	4,000	2,355.00	9,420,000	
ニチハ	2,000	3,115.00	6,230,000	
日本製鉄	65,400	1,102.00	72,070,800	
神戸製鋼所	26,700	437.00	11,667,900	
合同製鐵	800	2,003.00	1,602,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	39,400	794.00	31,283,600	

東京製鐵	7,100	699.00	4,962,900	
共英製鋼	1,700	1,369.00	2,327,300	
大和工業	3,100	2,590.00	8,029,000	
東京鐵鋼	600	1,723.00	1,033,800	
大阪製鐵	800	1,129.00	903,200	
淀川製鋼所	2,000	2,042.00	4,084,000	
丸一鋼管	4,700	2,557.00	12,017,900	
モリ工業	500	2,472.00	1,236,000	
大同特殊鋼	2,400	3,535.00	8,484,000	
日本高周波鋼業	600	342.00	205,200	
日本冶金工業	1,200	1,562.00	1,874,400	
山陽特殊製鋼	1,000	1,097.00	1,097,000	
愛知製鋼	800	2,552.00	2,041,600	
日立金属	15,700	1,540.00	24,178,000	
日本金属	400	663.00	265,200	
大平洋金属	1,000	1,708.00	1,708,000	
新日本電工	9,600	242.00	2,323,200	
栗本鐵工所	700	1,876.00	1,313,200	
虹技	200	1,305.00	261,000	
日本鋳鉄管	200	1,188.00	237,600	
三菱製鋼	1,200	552.00	662,400	
日亜鋼業	2,300	295.00	678,500	
日本精線	200	3,285.00	657,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	549.00	384,300	
シンニッタン	2,500	200.00	500,000	
新家工業	400	1,144.00	457,600	
大紀アルミニウム工業所	2,500	626.00	1,565,000	
日本軽金属ホールディングス	3,700	1,762.00	6,519,400	
三井金属鉱業	3,900	2,744.00	10,701,600	
東邦亜鉛	800	2,318.00	1,854,400	
三菱マテリアル	9,600	1,996.00	19,161,600	
住友金属鉱山	18,700	3,430.00	64,141,000	
ＤＯＷＡホールディングス	3,700	3,225.00	11,932,500	
古河機械金属	2,600	1,129.00	2,935,400	
エス・サイエンス	6,900	46.00	317,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	870.00	1,392,000	

東邦チタニウム	2,600	662.00	1,721,200	
ＵＡＣＪ	2,200	1,763.00	3,878,600	
ＣＫサンエツ	300	3,670.00	1,101,000	
古河電気工業	4,500	2,616.00	11,772,000	
住友電気工業	54,600	1,192.00	65,083,200	
フジクラ	17,700	298.00	5,274,600	
昭和電線ホールディングス	1,700	1,177.00	2,000,900	
タツタ電線	2,900	612.00	1,774,800	
カナレ電気	300	1,718.00	515,400	
平河ヒューテック	800	1,150.00	920,000	
リョービ	1,800	1,268.00	2,282,400	
アーレスティ	2,000	330.00	660,000	
アサヒホールディングス	2,600	3,535.00	9,191,000	
稲葉製作所	800	1,347.00	1,077,600	
宮地エンジニアリンググループ	500	1,692.00	846,000	
トーカロ	4,000	1,070.00	4,280,000	
アルファＣｏ	600	961.00	576,600	
ＳＵＭＣＯ	18,700	1,632.00	30,518,400	
川田テクノロジーズ	300	4,525.00	1,357,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	500	3,610.00	1,805,000	
信和	900	682.00	613,800	
東洋製罐グループホールディングス	9,300	1,054.00	9,802,200	
ホッカンホールディングス	800	1,398.00	1,118,400	
コロナ	800	993.00	794,400	
横河ブリッジホールディングス	2,700	1,932.00	5,216,400	
駒井ハルテック	300	1,471.00	441,300	
高田機工	100	2,476.00	247,600	
三和ホールディングス	13,800	1,212.00	16,725,600	
文化シヤッター	4,300	843.00	3,624,900	
三協立山	1,900	964.00	1,831,600	
アルインコ	1,100	884.00	972,400	
東洋シヤッター	300	765.00	229,500	
ＬＩＸＩＬグループ	21,500	2,207.00	47,450,500	
日本フイルコン	1,000	540.00	540,000	
ノーリツ	3,000	1,522.00	4,566,000	
長府製作所	1,500	2,168.00	3,252,000	

リンナイ	2,800	10,370.00	29,036,000	
ダイニチ工業	800	709.00	567,200	
日東精工	1,800	452.00	813,600	
三洋工業	200	1,870.00	374,000	
岡部	3,000	795.00	2,385,000	
ジーテクト	1,800	1,256.00	2,260,800	
東プレ	2,700	1,140.00	3,078,000	
高周波熱錬	2,800	514.00	1,439,200	
東京製綱	1,100	508.00	558,800	
サンコール	1,200	415.00	498,000	
モリテック　スチール	1,200	296.00	355,200	
パイオラックス	2,200	1,594.00	3,506,800	
エイチワン	1,500	588.00	882,000	
日本発條	15,700	685.00	10,754,500	
中央発條	200	2,903.00	580,600	
アドバネクス	200	1,295.00	259,000	
立川ブラインド工業	700	1,267.00	886,900	
三益半導体工業	1,100	2,444.00	2,688,400	
日本ドライケミカル	400	1,391.00	556,400	
日本製鋼所	4,400	2,320.00	10,208,000	
三浦工業	6,300	4,765.00	30,019,500	
タクマ	5,000	1,595.00	7,975,000	
ツガミ	3,000	1,483.00	4,449,000	
オークマ	1,700	5,320.00	9,044,000	
芝浦機械	1,700	2,174.00	3,695,800	
アマダ	18,100	958.00	17,339,800	
アイダエンジニアリング	3,900	801.00	3,123,900	
滝澤鉄工所	500	1,007.00	503,500	
ＦＵＪＩ	6,300	2,076.00	13,078,800	
牧野フライス製作所	1,700	3,755.00	6,383,500	
オーエスジー	7,200	1,696.00	12,211,200	
ダイジェット工業	200	1,401.00	280,200	
旭ダイヤモンド工業	3,900	495.00	1,930,500	
ＤＭＧ森精機	9,200	1,528.00	14,057,600	
ソディック	3,200	797.00	2,550,400	
ディスコ	2,000	28,080.00	56,160,000	

日東工器	800	1,961.00	1,568,800	
日進工具	600	2,209.00	1,325,400	
パンチ工業	1,400	426.00	596,400	
冨士ダイス	700	630.00	441,000	
豊和工業	800	793.00	634,400	
ＯＫＫ	400	366.00	146,400	
東洋機械金属	1,100	403.00	443,300	
津田駒工業	300	891.00	267,300	
島精機製作所	2,300	1,748.00	4,020,400	
オプトラン	1,800	2,088.00	3,758,400	
ＮＣホールディングス	400	610.00	244,000	
イワキポンプ	900	837.00	753,300	
フリュー	1,400	1,286.00	1,800,400	
ヤマシンフィルタ	3,200	1,172.00	3,750,400	
日阪製作所	1,800	933.00	1,679,400	
やまびこ	2,800	1,405.00	3,934,000	
平田機工	700	6,600.00	4,620,000	
ペガサスミシン製造	1,500	288.00	432,000	
マルマエ	600	941.00	564,600	
タツモ	600	1,545.00	927,000	
ナブテスコ	8,600	3,985.00	34,271,000	
三井海洋開発	1,600	1,594.00	2,550,400	
レオン自動機	1,500	1,035.00	1,552,500	
ＳＭＣ	4,600	56,350.00	259,210,000	
ホソカワミクロン	500	5,300.00	2,650,000	
ユニオンツール	600	3,045.00	1,827,000	
オイレス工業	1,900	1,484.00	2,819,600	
日精エー・エス・ビー機械	400	4,290.00	1,716,000	
サトーホールディングス	2,100	2,152.00	4,519,200	
技研製作所	1,300	3,915.00	5,089,500	
日本エアーテック	500	1,653.00	826,500	
カワタ	400	873.00	349,200	
日精樹脂工業	1,200	871.00	1,045,200	
オカダアイヨン	500	1,004.00	502,000	
ワイエイシイホールディングス	600	653.00	391,800	
小松製作所	66,900	2,517.00	168,387,300	

住友重機械工業	8,500	2,474.00	21,029,000	
日立建機	5,900	3,075.00	18,142,500	
日工	2,000	671.00	1,342,000	
巴工業	600	2,051.00	1,230,600	
井関農機	1,500	1,399.00	2,098,500	
ＴＯＷＡ	1,500	1,263.00	1,894,500	
丸山製作所	300	1,255.00	376,500	
北川鉄工所	700	1,372.00	960,400	
ローツェ	600	4,810.00	2,886,000	
タカキタ	500	667.00	333,500	
クボタ	78,300	1,926.50	150,844,950	
荏原実業	400	3,200.00	1,280,000	
三菱化工機	500	1,929.00	964,500	
月島機械	2,700	1,260.00	3,402,000	
帝国電機製作所	1,200	1,043.00	1,251,600	
新東工業	3,600	728.00	2,620,800	
澁谷工業	1,300	3,260.00	4,238,000	
アイチ　コーポレーション	2,600	883.00	2,295,800	
小森コーポレーション	3,800	735.00	2,793,000	
鶴見製作所	1,100	1,783.00	1,961,300	
住友精密工業	200	2,020.00	404,000	
酒井重工業	300	2,388.00	716,400	
荏原製作所	6,100	2,967.00	18,098,700	
石井鐵工所	200	2,717.00	543,400	
酉島製作所	1,500	794.00	1,191,000	
北越工業	1,500	1,003.00	1,504,500	
ダイキン工業	18,800	19,460.00	365,848,000	
オルガノ	500	5,800.00	2,900,000	
トーヨーカネツ	700	2,274.00	1,591,800	
栗田工業	8,000	3,305.00	26,440,000	
椿本チエイン	2,100	2,434.00	5,111,400	
大同工業	700	606.00	424,200	
木村化工機	1,300	423.00	549,900	
アネスト岩田	2,300	850.00	1,955,000	
ダイフク	7,600	10,680.00	81,168,000	
サムコ	400	2,685.00	1,074,000	

加藤製作所	800	1,035.00	828,000	
油研工業	300	1,506.00	451,800	
タダノ	7,100	850.00	6,035,000	
フジテック	5,400	2,332.00	12,592,800	
ＣＫＤ	4,000	1,775.00	7,100,000	
キトー	1,100	1,281.00	1,409,100	
平和	4,100	1,707.00	6,998,700	
理想科学工業	1,300	1,321.00	1,717,300	
ＳＡＮＫＹＯ	3,300	2,720.00	8,976,000	
日本金銭機械	1,700	536.00	911,200	
マースグループホールディングス	900	1,626.00	1,463,400	
フクシマガリレイ	900	3,975.00	3,577,500	
オーイズミ	600	394.00	236,400	
ダイコク電機	700	953.00	667,100	
竹内製作所	2,500	2,372.00	5,930,000	
アマノ	3,900	2,480.00	9,672,000	
ＪＵＫＩ	2,100	456.00	957,600	
サンデンホールディングス	2,100	389.00	816,900	
蛇の目ミシン工業	1,400	577.00	807,800	
マックス	2,300	1,521.00	3,498,300	
グローリー	3,800	2,288.00	8,694,400	
新晃工業	1,400	1,498.00	2,097,200	
大和冷機工業	2,400	940.00	2,256,000	
セガサミーホールディングス	14,700	1,330.00	19,551,000	
日本ピストンリング	600	996.00	597,600	
リケン	700	2,647.00	1,852,900	
ＴＰＲ	2,000	1,358.00	2,716,000	
ツバキ・ナカシマ	2,900	844.00	2,447,600	
ホシザキ	4,700	8,570.00	40,279,000	
大豊工業	1,200	572.00	686,400	
日本精工	27,800	894.00	24,853,200	
ＮＴＮ	34,200	215.00	7,353,000	
ジェイテクト	14,200	907.00	12,879,400	
不二越	1,400	4,270.00	5,978,000	
日本トムソン	4,400	367.00	1,614,800	
ＴＨＫ	9,200	2,861.00	26,321,200	

ユーシン精機	1,200	701.00	841,200	
前澤給装工業	500	2,312.00	1,156,000	
イーグル工業	1,900	883.00	1,677,700	
前澤工業	1,100	440.00	484,000	
日本ピラー工業	1,500	1,467.00	2,200,500	
キッツ	6,000	582.00	3,492,000	
マキタ	19,300	4,750.00	91,675,000	
日立造船	11,700	430.00	5,031,000	
三菱重工業	24,700	2,361.00	58,316,700	
ＩＨＩ	10,600	1,393.00	14,765,800	
スター精密	2,300	1,439.00	3,309,700	
日清紡ホールディングス	9,000	746.00	6,714,000	
イビデン	9,000	4,055.00	36,495,000	
コニカミノルタ	32,300	270.00	8,721,000	
ブラザー工業	18,000	1,617.00	29,106,000	
ミネベアミツミ	27,400	1,989.00	54,498,600	
日立製作所	70,900	3,668.00	260,061,200	
三菱電機	147,600	1,367.50	201,843,000	
富士電機	8,900	3,420.00	30,438,000	
東洋電機製造	600	1,146.00	687,600	
安川電機	15,900	4,190.00	66,621,000	
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,151.00	2,186,900	
明電舎	2,700	1,543.00	4,166,100	
オリジン	400	1,398.00	559,200	
山洋電気	700	4,600.00	3,220,000	
デンヨー	1,300	2,327.00	3,025,100	
東芝テック	1,800	4,270.00	7,686,000	
芝浦メカトロニクス	300	3,155.00	946,500	
マブチモーター	4,100	4,460.00	18,286,000	
日本電産	35,500	10,650.00	378,075,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	323.00	323,000	
トレックス・セミコンダクター	900	1,269.00	1,142,100	
東光高岳	800	1,059.00	847,200	
ダイヘン	1,600	4,105.00	6,568,000	
ヤーマン	2,400	1,470.00	3,528,000	
ＪＶＣケンウッド	12,200	152.00	1,854,400	

ミマキエンジニアリング	1,400	412.00	576,800	
Ｉ－ＰＥＸ	700	1,955.00	1,368,500	
日新電機	3,500	1,092.00	3,822,000	
大崎電気工業	3,000	618.00	1,854,000	
オムロン	13,200	7,900.00	104,280,000	
日東工業	2,200	1,939.00	4,265,800	
ＩＤＥＣ	2,100	1,868.00	3,922,800	
正興電機製作所	400	1,504.00	601,600	
不二電機工業	300	1,300.00	390,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	4,900	1,945.00	9,530,500	
サクサホールディングス	400	1,364.00	545,600	
メルコホールディングス	500	2,440.00	1,220,000	
テクノメディカ	400	1,656.00	662,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	768.00	307,200	
日本電気	17,900	5,710.00	102,209,000	
富士通	14,200	13,545.00	192,339,000	
沖電気工業	6,000	1,105.00	6,630,000	
岩崎通信機	700	836.00	585,200	
電気興業	700	2,537.00	1,775,900	
サンケン電気	1,600	2,815.00	4,504,000	
ナカヨ	300	1,452.00	435,600	
アイホン	800	1,434.00	1,147,200	
ルネサスエレクトロニクス	63,000	889.00	56,007,000	
セイコーエプソン	18,300	1,120.00	20,496,000	
ワコム	9,900	662.00	6,553,800	
アルバック	2,700	3,765.00	10,165,500	
アクセル	600	924.00	554,400	
ＥＩＺＯ	1,100	3,990.00	4,389,000	
日本信号	3,800	962.00	3,655,600	
京三製作所	3,600	420.00	1,512,000	
能美防災	2,000	2,292.00	4,584,000	
ホーチキ	1,100	1,212.00	1,333,200	
星和電機	800	614.00	491,200	
エレコム	1,700	4,900.00	8,330,000	
パナソニック	168,600	907.50	153,004,500	

シャープ	17,100	1,292.00	22,093,200	
アンリツ	9,500	2,341.00	22,239,500	
富士通ゼネラル	4,000	2,937.00	11,748,000	
ソニー	92,500	8,017.00	741,572,500	
ＴＤＫ	7,100	12,470.00	88,537,000	
帝国通信工業	700	1,134.00	793,800	
タムラ製作所	5,000	542.00	2,710,000	
アルプスアルパイン	13,100	1,621.00	21,235,100	
池上通信機	500	809.00	404,500	
鈴木	800	684.00	547,200	
日本トリム	200	3,760.00	752,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	1,306.00	1,175,400	
フォスター電機	1,600	1,424.00	2,278,400	
ＳＭＫ	400	2,607.00	1,042,800	
ヨコオ	1,000	2,670.00	2,670,000	
ホシデン	4,100	956.00	3,919,600	
ヒロセ電機	2,300	14,950.00	34,385,000	
日本航空電子工業	3,400	1,654.00	5,623,600	
ＴＯＡ	1,600	818.00	1,308,800	
マクセルホールディングス	3,200	1,097.00	3,510,400	
古野電気	1,900	1,249.00	2,373,100	
ユニデンホールディングス	400	1,933.00	773,200	
スミダコーポレーション	1,300	895.00	1,163,500	
アイコム	800	2,788.00	2,230,400	
リオン	600	2,363.00	1,417,800	
本多通信工業	1,300	508.00	660,400	
船井電機	1,500	448.00	672,000	
横河電機	13,500	1,650.00	22,275,000	
新電元工業	500	2,034.00	1,017,000	
アズビル	9,300	4,205.00	39,106,500	
東亜ディーケーケー	800	830.00	664,000	
日本光電工業	6,100	3,325.00	20,282,500	
チノー	500	1,374.00	687,000	
共和電業	1,600	410.00	656,000	
日本電子材料	600	1,815.00	1,089,000	
堀場製作所	2,900	5,320.00	15,428,000	

アドバンテスト	11,000	5,490.00	60,390,000	
小野測器	700	521.00	364,700	
エスペック	1,300	1,767.00	2,297,100	
キーエンス	13,400	48,430.00	648,962,000	
日置電機	700	3,670.00	2,569,000	
シスメックス	10,600	9,929.00	105,247,400	
日本マイクロニクス	2,600	1,034.00	2,688,400	
メガチップス	1,400	2,886.00	4,040,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	900	3,760.00	3,384,000	
澤藤電機	200	1,801.00	360,200	
原田工業	700	875.00	612,500	
コーセル	2,000	1,034.00	2,068,000	
イリソ電子工業	1,200	4,375.00	5,250,000	
オプテックスグループ	2,400	1,618.00	3,883,200	
千代田インテグレ	600	1,571.00	942,600	
アイ・オー・データ機器	500	1,009.00	504,500	
レーザーテック	6,500	8,720.00	56,680,000	
スタンレー電気	10,300	3,165.00	32,599,500	
岩崎電気	600	1,407.00	844,200	
ウシオ電機	8,100	1,248.00	10,108,800	
岡谷電機産業	1,200	359.00	430,800	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,400	292.00	408,800	
エノモト	500	1,080.00	540,000	
日本セラミック	1,500	2,578.00	3,867,000	
遠藤照明	800	601.00	480,800	
古河電池	1,100	1,084.00	1,192,400	
双信電機	800	401.00	320,800	
山一電機	1,100	1,377.00	1,514,700	
図研	1,000	2,663.00	2,663,000	
日本電子	2,900	3,360.00	9,744,000	
カシオ計算機	13,000	1,631.00	21,203,000	
ファナック	13,900	21,580.00	299,962,000	
日本シイエムケイ	3,600	519.00	1,868,400	
エンプラス	800	2,361.00	1,888,800	
大真空	600	2,350.00	1,410,000	
ローム	6,100	8,700.00	53,070,000	

浜松ホトニクス	10,600	5,080.00	53,848,000	
三井ハイテック	1,600	2,168.00	3,468,800	
新光電気工業	5,000	1,910.00	9,550,000	
京セラ	20,800	6,251.00	130,020,800	
太陽誘電	6,600	3,970.00	26,202,000	
村田製作所	43,400	7,383.00	320,422,200	
双葉電子工業	2,400	917.00	2,200,800	
北陸電気工業	600	982.00	589,200	
ニチコン	5,000	900.00	4,500,000	
日本ケミコン	1,200	1,403.00	1,683,600	
ＫＯＡ	2,200	1,334.00	2,934,800	
市光工業	2,300	496.00	1,140,800	
小糸製作所	8,800	5,170.00	45,496,000	
ミツバ	2,800	439.00	1,229,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,600	5,710.00	14,846,000	
キヤノン電子	1,400	1,460.00	2,044,000	
キヤノン	73,300	1,788.00	131,060,400	代用有価証券 10,000株
リコー	37,500	700.00	26,250,000	
象印マホービン	4,000	1,878.00	7,512,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,507.00	301,400	
東京エレクトロン	9,400	28,415.00	267,101,000	
トヨタ紡織	4,300	1,582.00	6,802,600	
芦森工業	300	970.00	291,000	
ユニプレス	2,900	865.00	2,508,500	
豊田自動織機	12,000	6,730.00	80,760,000	
モリタホールディングス	2,600	1,919.00	4,989,400	
三櫻工業	1,900	631.00	1,198,900	
デンソー	32,500	4,940.00	160,550,000	
東海理化電機製作所	3,900	1,756.00	6,848,400	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	5,400	388.00	2,095,200	
川崎重工業	11,500	1,367.00	15,720,500	
名村造船所	5,000	157.00	785,000	
サノヤスホールディングス	1,900	170.00	323,000	
日本車輌製造	600	2,633.00	1,579,800	
三菱ロジスネクスト	2,000	960.00	1,920,000	

近畿車輛	200	1,307.00	261,400	
日産自動車	174,200	391.00	68,112,200	
いすゞ自動車	42,800	915.00	39,162,000	
トヨタ自動車	164,700	6,990.00	1,151,253,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,400	818.00	15,051,200	
三菱自動車工業	54,600	213.00	11,629,800	
エフテック	1,100	545.00	599,500	
レシップホールディングス	600	552.00	331,200	
ＧＭＢ	300	623.00	186,900	
ファルテック	300	612.00	183,600	
武蔵精密工業	3,300	1,212.00	3,999,600	
日産車体	2,900	925.00	2,682,500	
新明和工業	4,000	870.00	3,480,000	
極東開発工業	2,800	1,386.00	3,880,800	
日信工業	3,000	2,246.00	6,738,000	
トピー工業	1,200	1,138.00	1,365,600	
ティラド	600	1,245.00	747,000	
タチエス	2,500	1,151.00	2,877,500	
ＮＯＫ	7,900	1,286.00	10,159,400	
フタバ産業	4,200	590.00	2,478,000	
ＫＹＢ	1,700	2,277.00	3,870,900	
大同メタル工業	2,900	529.00	1,534,100	
プレス工業	7,500	297.00	2,227,500	
ミクニ	1,900	270.00	513,000	
太平洋工業	3,100	1,039.00	3,220,900	
ケーヒン	3,400	2,592.00	8,812,800	
河西工業	2,000	384.00	768,000	
アイシン精機	12,100	3,520.00	42,592,000	
マツダ	43,400	619.00	26,864,600	
今仙電機製作所	1,400	632.00	884,800	
本田技研工業	116,200	2,585.00	300,377,000	
スズキ	29,300	4,621.00	135,395,300	
ＳＵＢＡＲＵ	45,800	2,090.00	95,722,000	
安永	700	1,141.00	798,700	
ヤマハ発動機	20,800	1,593.00	33,134,400	

ショーワ	3,500	2,292.00	8,022,000	
ＴＢＫ	1,900	430.00	817,000	
エクセディ	2,000	1,322.00	2,644,000	
豊田合成	4,800	2,645.00	12,696,000	
愛三工業	2,400	498.00	1,195,200	
盟和産業	200	880.00	176,000	
日本プラスト	1,200	418.00	501,600	
ヨロズ	1,400	1,167.00	1,633,800	
エフ・シー・シー	2,400	2,090.00	5,016,000	
シマノ	5,500	20,090.00	110,495,000	
テイ・エス　テック	3,400	3,040.00	10,336,000	
ジャムコ	800	652.00	521,600	
テルモ	41,800	3,878.00	162,100,400	
クリエートメディック	500	1,032.00	516,000	
日機装	4,700	1,066.00	5,010,200	
日本エム・ディ・エム	800	2,065.00	1,652,000	
島津製作所	17,600	3,035.00	53,416,000	
ＪＭＳ	1,200	867.00	1,040,400	
長野計器	1,100	805.00	885,500	
ブイ・テクノロジー	700	4,665.00	3,265,500	
東京計器	900	891.00	801,900	
愛知時計電機	200	4,405.00	881,000	
インターアクション	800	1,664.00	1,331,200	
オーバル	1,300	222.00	288,600	
東京精密	2,700	3,495.00	9,436,500	
マニー	5,900	2,645.00	15,605,500	
ニコン	22,400	658.00	14,739,200	
トプコン	7,400	1,102.00	8,154,800	
オリンパス	81,700	1,990.00	162,583,000	
理研計器	1,300	2,736.00	3,556,800	
タムロン	1,200	1,548.00	1,857,600	
ＨＯＹＡ	29,300	11,785.00	345,300,500	
シード	600	636.00	381,600	
ノーリツ鋼機	1,000	2,062.00	2,062,000	
エー・アンド・デイ	1,300	636.00	826,800	
朝日インテック	16,700	3,100.00	51,770,000	

シチズン時計	17,200	293.00	5,039,600	
リズム	500	618.00	309,000	
大研医器	1,100	518.00	569,800	
メニコン	2,100	7,200.00	15,120,000	
シンシア	200	394.00	78,800	
松風	700	1,430.00	1,001,000	
セイコーホールディングス	2,100	1,416.00	2,973,600	
ニプロ	10,200	1,107.00	11,291,400	
中本パックス	300	1,561.00	468,300	
スノーピーク	900	1,821.00	1,638,900	
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,185.00	6,277,500	
トランザクション	700	920.00	644,000	
粧美堂	400	355.00	142,000	
ニホンフラッシュ	1,300	1,267.00	1,647,100	
前田工繊	1,600	2,798.00	4,476,800	
永大産業	1,800	311.00	559,800	
アートネイチャー	1,500	609.00	913,500	
バンダイナムコホールディングス	15,300	7,912.00	121,053,600	
アイフィスジャパン	400	723.00	289,200	
共立印刷	2,800	129.00	361,200	
ＳＨＯＥＩ	1,300	3,125.00	4,062,500	
フランスベッドホールディングス	2,100	869.00	1,824,900	
パイロットコーポレーション	2,600	3,030.00	7,878,000	
萩原工業	800	1,590.00	1,272,000	
トッパン・フォームズ	3,100	1,051.00	3,258,100	
フジシールインターナショナル	3,300	2,054.00	6,778,200	
タカラトミー	6,500	971.00	6,311,500	
廣済堂	900	635.00	571,500	
エステールホールディングス	500	593.00	296,500	
タカノ	700	601.00	420,700	
プロネクサス	1,200	1,106.00	1,327,200	
ホクシン	700	116.00	81,200	
ウッドワン	500	1,174.00	587,000	
大建工業	1,000	1,878.00	1,878,000	
凸版印刷	20,700	1,416.00	29,311,200	
大日本印刷	19,300	2,086.00	40,259,800	

共同印刷	400	2,504.00	1,001,600	
ＮＩＳＳＨＡ	2,900	1,298.00	3,764,200	
光村印刷	100	1,691.00	169,100	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	700	2,004.00	1,402,800	
アシックス	13,000	1,424.00	18,512,000	
ツツミ	400	2,298.00	919,200	
小松ウオール工業	400	1,710.00	684,000	
ヤマハ	8,800	5,010.00	44,088,000	
河合楽器製作所	400	2,534.00	1,013,600	
クリナップ	1,300	498.00	647,400	
ピジョン	9,500	4,650.00	44,175,000	
オリバー	300	2,456.00	736,800	
兼松サステック	100	1,600.00	160,000	
キングジム	1,100	873.00	960,300	
リンテック	3,500	2,364.00	8,274,000	
イトーキ	2,700	346.00	934,200	
任天堂	9,100	55,090.00	501,319,000	
三菱鉛筆	2,400	1,361.00	3,266,400	
タカラスタンダード	3,000	1,408.00	4,224,000	
コクヨ	7,000	1,313.00	9,191,000	
ナカバヤシ	1,400	626.00	876,400	
グローブライド	600	3,265.00	1,959,000	
オカムラ	5,100	720.00	3,672,000	
美津濃	1,300	1,842.00	2,394,600	
東京電力ホールディングス	117,700	288.00	33,897,600	
中部電力	45,100	1,220.00	55,022,000	
関西電力	55,900	1,003.00	56,067,700	
中国電力	21,300	1,330.00	28,329,000	
北陸電力	13,500	754.00	10,179,000	
東北電力	36,800	961.00	35,364,800	
四国電力	13,300	777.00	10,334,100	
九州電力	30,400	903.00	27,451,200	
北海道電力	13,800	445.00	6,141,000	
沖縄電力	2,900	1,566.00	4,541,400	
電源開発	11,700	1,532.00	17,924,400	
エフオン	800	806.00	644,800	

イーレックス	2,100	1,276.00	2,679,600	
レノバ	2,500	1,638.00	4,095,000	
東京瓦斯	28,400	2,330.00	66,172,000	
大阪瓦斯	28,600	1,962.00	56,113,200	
東邦瓦斯	7,300	5,190.00	37,887,000	
北海道瓦斯	800	1,516.00	1,212,800	
広島ガス	3,000	356.00	1,068,000	
西部瓦斯	1,700	2,518.00	4,280,600	
静岡ガス	4,200	913.00	3,834,600	
メタウォーター	1,400	2,317.00	3,243,800	
ＳＢＳホールディングス	1,100	2,384.00	2,622,400	
東武鉄道	15,400	3,025.00	46,585,000	
相鉄ホールディングス	4,700	2,663.00	12,516,100	
東急	37,200	1,284.00	47,764,800	
京浜急行電鉄	19,000	1,503.00	28,557,000	
小田急電鉄	21,900	2,508.00	54,925,200	
京王電鉄	7,700	6,020.00	46,354,000	
京成電鉄	10,300	3,010.00	31,003,000	
富士急行	2,000	4,500.00	9,000,000	
東日本旅客鉄道	26,000	5,843.00	151,918,000	
西日本旅客鉄道	13,200	4,854.00	64,072,800	
東海旅客鉄道	12,300	13,775.00	169,432,500	
西武ホールディングス	19,300	1,135.00	21,905,500	
鴻池運輸	2,400	1,123.00	2,695,200	
西日本鉄道	4,100	2,757.00	11,303,700	
ハマキョウレックス	1,100	3,125.00	3,437,500	
サカイ引越センター	800	4,905.00	3,924,000	
近鉄グループホールディングス	14,000	4,235.00	59,290,000	
阪急阪神ホールディングス	18,600	3,240.00	60,264,000	
南海電気鉄道	6,600	2,250.00	14,850,000	
京阪ホールディングス	6,200	4,060.00	25,172,000	
神戸電鉄	300	3,525.00	1,057,500	
名古屋鉄道	11,500	2,778.00	31,947,000	
山陽電気鉄道	1,000	2,070.00	2,070,000	
日本通運	4,800	6,030.00	28,944,000	
ヤマトホールディングス	24,500	2,759.00	67,595,500	

山九	3,900	4,085.00	15,931,500	
丸運	1,000	243.00	243,000	
丸全昭和運輸	1,100	3,265.00	3,591,500	
センコーグループホールディングス	7,700	960.00	7,392,000	
トナミホールディングス	300	5,500.00	1,650,000	
ニッコンホールディングス	5,000	2,140.00	10,700,000	
日本石油輸送	200	2,644.00	528,800	
福山通運	1,800	4,600.00	8,280,000	
セイノーホールディングス	10,500	1,395.00	14,647,500	
エスライン	500	975.00	487,500	
神奈川中央交通	300	3,750.00	1,125,000	
日立物流	2,600	3,405.00	8,853,000	
丸和運輸機関	1,500	4,295.00	6,442,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,400	1,708.00	2,391,200	
九州旅客鉄道	12,300	2,275.00	27,982,500	
ＳＧホールディングス	14,700	5,160.00	75,852,000	
日本郵船	11,700	2,006.00	23,470,200	
商船三井	8,800	2,474.00	21,771,200	
川崎汽船	4,300	1,380.00	5,934,000	
ＮＳユナイテッド海運	800	1,509.00	1,207,200	
明治海運	1,600	398.00	636,800	
飯野海運	6,700	372.00	2,492,400	
共栄タンカー	200	757.00	151,400	
乾汽船	800	934.00	747,200	
日本航空	24,700	2,036.00	50,289,200	
ＡＮＡホールディングス	25,600	2,365.00	60,544,000	
パスコ	300	1,309.00	392,700	
トランコム	400	7,750.00	3,100,000	
日新	1,200	1,505.00	1,806,000	
三菱倉庫	4,400	2,908.00	12,795,200	
三井倉庫ホールディングス	1,600	1,905.00	3,048,000	
住友倉庫	5,000	1,274.00	6,370,000	
澁澤倉庫	800	2,103.00	1,682,400	
東陽倉庫	2,500	336.00	840,000	
日本トランスシティ	3,100	536.00	1,661,600	
ケイヒン	300	1,376.00	412,800	

中央倉庫	800	1,166.00	932,800	
川西倉庫	300	1,051.00	315,300	
安田倉庫	1,100	946.00	1,040,600	
ファイズホールディングス	300	1,050.00	315,000	
東洋埠頭	400	1,419.00	567,600	
宇徳	1,200	494.00	592,800	
上組	7,800	1,927.00	15,030,600	
サンリツ	300	652.00	195,600	
キムラユニティー	400	1,042.00	416,800	
キユーソー流通システム	400	1,712.00	684,800	
近鉄エクスプレス	2,900	2,336.00	6,774,400	
東海運	800	309.00	247,200	
エーアイテイー	1,000	999.00	999,000	
内外トランスライン	500	1,235.00	617,500	
日本コンセプト	400	1,490.00	596,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	4,100	1,920.00	7,872,000	
クロスキャット	400	1,361.00	544,400	
システナ	5,200	1,822.00	9,474,400	
デジタルアーツ	700	7,190.00	5,033,000	
日鉄ソリューションズ	2,200	3,120.00	6,864,000	
キューブシステム	800	1,325.00	1,060,000	
エイジア	300	2,009.00	602,700	
コア	600	1,476.00	885,600	
ラクーンホールディングス	700	2,000.00	1,400,000	
ソリトンシステムズ	700	1,977.00	1,383,900	
ソフトクリエイトホールディングス	600	4,150.00	2,490,000	
ＴＩＳ	14,500	2,087.00	30,261,500	
ＪＮＳホールディングス	600	656.00	393,600	
電算システム	500	3,540.00	1,770,000	
グリー	8,900	518.00	4,610,200	
コーエーテクモホールディングス	3,000	4,835.00	14,505,000	
三菱総合研究所	600	4,025.00	2,415,000	
ボルテージ	400	575.00	230,000	
電算	200	2,370.00	474,000	
ＡＧＳ	900	904.00	813,600	
ファインデックス	1,300	1,305.00	1,696,500	

ブレインパッド	400	4,050.00	1,620,000	
ＫＬａｂ	2,700	877.00	2,367,900	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	951.00	1,711,800	
イーブックイニシアティブジャパン	200	3,070.00	614,000	
ネクソン	36,600	2,817.00	103,102,200	
アイスタイル	4,200	407.00	1,709,400	
エムアップホールディングス	400	2,661.00	1,064,400	
エイチーム	1,000	834.00	834,000	
エニグモ	1,400	1,374.00	1,923,600	
テクノスジャパン	1,200	793.00	951,600	
コロプラ	4,800	905.00	4,344,000	
ブロードリーフ	7,300	540.00	3,942,000	
クロス・マーケティンググループ	700	345.00	241,500	
デジタルハーツホールディングス	800	1,032.00	825,600	
システム情報	1,100	1,206.00	1,326,600	
メディアドゥ	500	7,490.00	3,745,000	
じげん	3,700	329.00	1,217,300	
ブイキューブ	800	2,375.00	1,900,000	
エンカレッジ・テクノロジ	300	815.00	244,500	
サイバーリンクス	300	3,470.00	1,041,000	
フィックスターズ	1,600	1,034.00	1,654,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,308.00	784,800	
オプティム	800	2,948.00	2,358,400	
セレス	500	2,013.00	1,006,500	
ＳＨＩＦＴ	600	13,450.00	8,070,000	
ティーガイア	1,300	1,970.00	2,561,000	
セック	200	2,905.00	581,000	
日本アジアグループ	1,600	334.00	534,400	
テクマトリックス	2,000	2,200.00	4,400,000	
プロシップ	500	1,393.00	696,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,500	2,477.00	8,669,500	
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	11,940.00	37,014,000	
ザッパラス	700	432.00	302,400	
システムリサーチ	400	1,724.00	689,600	
インターネットイニシアティブ	2,100	4,715.00	9,901,500	

さくらインターネット	1,600	722.00	1,155,200	
ヴィンクス	400	1,216.00	486,400	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	11,280.00	3,384,000	
ＳＲＡホールディングス	800	2,301.00	1,840,800	
システムインテグレータ	500	703.00	351,500	
朝日ネット	1,100	970.00	1,067,000	
ｅＢＡＳＥ	1,800	1,148.00	2,066,400	
アバント	1,400	1,141.00	1,597,400	
アドソル日進	500	2,558.00	1,279,000	
フリービット	800	887.00	709,600	
コムチュア	1,600	2,666.00	4,265,600	
サイバーコム	300	1,778.00	533,400	
アステリア	1,000	769.00	769,000	
アイル	800	1,392.00	1,113,600	
マークラインズ	600	2,245.00	1,347,000	
メディカル・データ・ビジョン	1,700	2,461.00	4,183,700	
ｇｕｍｉ	1,900	865.00	1,643,500	
ショーケース	300	805.00	241,500	
モバイルファクトリー	400	1,033.00	413,200	
テラスカイ	500	4,745.00	2,372,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,391.00	834,600	
ＰＣＩホールディングス	600	1,130.00	678,000	
パイプドＨＤ	200	1,812.00	362,400	
アイビーシー	200	1,051.00	210,200	
ネオジャパン	300	2,375.00	712,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	300	3,615.00	1,084,500	
ランドコンピュータ	200	1,110.00	222,000	
ダブルスタンダード	200	4,675.00	935,000	
オープンドア	700	1,277.00	893,900	
マイネット	500	1,107.00	553,500	
アカツキ	500	4,700.00	2,350,000	
ベネフィットジャパン	100	1,724.00	172,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	300	2,546.00	763,800	
ＬＩＮＥ	3,300	5,360.00	17,688,000	
カナミックネットワーク	1,400	790.00	1,106,000	

ノムラシステムコーポレーション	700	425.00	297,500	
チェンジ	1,000	8,210.00	8,210,000	
シンクロ・フード	700	307.00	214,900	
オークネット	800	1,451.00	1,160,800	
セグエグループ	400	1,407.00	562,800	
エイトレッド	300	2,515.00	754,500	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,600	413.00	660,800	
マクロミル	3,000	708.00	2,124,000	
ビーグリー	300	2,066.00	619,800	
オロ	500	3,280.00	1,640,000	
ユーザーローカル	200	4,570.00	914,000	
テモナ	300	1,265.00	379,500	
サインポスト	300	1,007.00	302,100	
ソルクシーズ	600	1,096.00	657,600	
フェイス	600	915.00	549,000	
プロトコーポレーション	1,300	1,233.00	1,602,900	
ハイマックス	400	1,157.00	462,800	
野村総合研究所	20,600	2,946.00	60,687,600	
サイバネットシステム	1,100	923.00	1,015,300	
ＣＥホールディングス	800	619.00	495,200	
日本システム技術	200	1,795.00	359,000	
インテージホールディングス	1,900	957.00	1,818,300	
東邦システムサイエンス	400	946.00	378,400	
ソースネクスト	7,100	303.00	2,151,300	
インフォコム	1,600	3,715.00	5,944,000	
ＨＥＲＯＺ	200	3,070.00	614,000	
ラクスル	1,200	4,710.00	5,652,000	
ＦＩＧ	1,700	257.00	436,900	
システムサポート	300	1,607.00	482,100	
イーソル	800	1,238.00	990,400	
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,687.00	2,699,200	
東海ソフト	100	1,136.00	113,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,416.00	424,800	
トビラシステムズ	100	1,715.00	171,500	
フォーカスシステムズ	900	930.00	837,000	

クレスコ	900	1,245.00	1,120,500	
フジ・メディア・ホールディングス	13,900	1,049.00	14,581,100	
オービック	5,000	17,340.00	86,700,000	
ジャストシステム	2,400	6,750.00	16,200,000	
ＴＤＣソフト	1,300	1,015.00	1,319,500	
Ｚホールディングス	199,000	699.00	139,101,000	
トレンドマイクロ	7,700	6,050.00	46,585,000	
ＩＤホールディングス	600	1,360.00	816,000	
日本オラクル	2,900	10,500.00	30,450,000	
アルファシステムズ	500	3,210.00	1,605,000	
フューチャー	1,800	2,130.00	3,834,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,000	1,363.00	1,363,000	
ＳＢテクノロジー	500	3,445.00	1,722,500	
トーセ	400	850.00	340,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,500	5,230.00	7,845,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,600	3,575.00	23,595,000	
アイティフォー	1,800	874.00	1,573,200	
東計電算	200	4,440.00	888,000	
エックスネット	200	1,049.00	209,800	
大塚商会	7,800	4,910.00	38,298,000	
サイボウズ	1,700	3,060.00	5,202,000	
ソフトブレーン	1,200	869.00	1,042,800	
電通国際情報サービス	900	6,580.00	5,922,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,400	800.00	1,120,000	
デジタルガレージ	2,600	3,795.00	9,867,000	
ＥＭシステムズ	2,100	799.00	1,677,900	
ウェザーニューズ	500	5,460.00	2,730,000	
ＣＩＪ	1,000	913.00	913,000	
ビジネスエンジニアリング	200	3,900.00	780,000	
日本エンタープライズ	1,600	240.00	384,000	
ＷＯＷＯＷ	700	2,837.00	1,985,900	
スカラ	1,000	923.00	923,000	
インテリジェント　ウェイブ	900	746.00	671,400	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,300	387.00	503,100	
ネットワンシステムズ	5,500	4,170.00	22,935,000	
システムソフト	3,300	98.00	323,400	

アルゴグラフィックス	1,200	3,205.00	3,846,000	
マーベラス	2,300	767.00	1,764,100	
エイベックス	2,500	1,029.00	2,572,500	
日本ユニシス	4,500	3,030.00	13,635,000	
兼松エレクトロニクス	800	4,305.00	3,444,000	
都築電気	500	1,598.00	799,000	
ＴＢＳホールディングス	8,800	1,720.00	15,136,000	
日本テレビホールディングス	12,100	1,141.00	13,806,100	
朝日放送グループホールディングス	1,500	686.00	1,029,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,000	1,641.00	6,564,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	9,500	456.00	4,332,000	
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,328.00	2,793,600	
日本ＢＳ放送	500	1,075.00	537,500	
ビジョン	1,900	1,005.00	1,909,500	
スマートバリュー	400	1,143.00	457,200	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,421.00	852,600	
コネクシオ	800	1,275.00	1,020,000	
クロップス	300	779.00	233,700	
日本電信電話	193,600	2,230.00	431,728,000	
ＫＤＤＩ	105,600	2,798.00	295,468,800	
ソフトバンク	131,700	1,217.50	160,344,750	
光通信	1,500	24,150.00	36,225,000	
ＮＴＴドコモ	103,600	3,889.00	402,900,400	
エムティーアイ	1,400	888.00	1,243,200	
GMOインターネット	5,200	2,713.00	14,107,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	400	408.00	163,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	3,900	2,747.00	10,713,300	
学研ホールディングス	2,000	1,426.00	2,852,000	
ゼンリン	2,900	1,242.00	3,601,800	
昭文社ホールディングス	700	482.00	337,400	
インプレスホールディングス	1,300	184.00	239,200	
アイネット	800	1,482.00	1,185,600	
松竹	1,000	12,510.00	12,510,000	
東宝	8,500	4,450.00	37,825,000	
東映	500	16,030.00	8,015,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	38,600	1,276.00	49,253,600	

ピー・シー・エー	300	4,610.00	1,383,000	
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,504.00	752,000	
ＤＴＳ	3,200	2,185.00	6,992,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,200	6,080.00	37,696,000	
シーイーシー	1,600	1,599.00	2,558,400	
カプコン	6,800	5,820.00	39,576,000	
アイ・エス・ビー	300	2,730.00	819,000	
ジャステック	1,000	1,447.00	1,447,000	
ＳＣＳＫ	3,300	5,350.00	17,655,000	
日本システムウエア	500	2,095.00	1,047,500	
アイネス	1,500	1,545.00	2,317,500	
ＴＫＣ	1,200	6,490.00	7,788,000	
富士ソフト	1,500	5,700.00	8,550,000	
ＮＳＤ	4,700	1,806.00	8,488,200	
コナミホールディングス	5,300	4,115.00	21,809,500	
福井コンピュータホールディングス	600	3,250.00	1,950,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,000	1,539.00	1,539,000	
ミロク情報サービス	1,300	2,181.00	2,835,300	
ソフトバンクグループ	114,900	6,888.00	791,431,200	
ホウスイ	200	915.00	183,000	
高千穂交易	600	952.00	571,200	
カワニシホールディングス	200	1,436.00	287,200	
伊藤忠食品	400	5,230.00	2,092,000	
エレマテック	1,400	966.00	1,352,400	
ＪＡＬＵＸ	400	1,468.00	587,200	
あらた	1,200	4,935.00	5,922,000	
トーメンデバイス	200	3,915.00	783,000	
東京エレクトロン　デバイス	500	3,135.00	1,567,500	
フィールズ	1,200	330.00	396,000	
双日	80,400	242.00	19,456,800	
アルフレッサ　ホールディングス	16,200	1,992.00	32,270,400	
横浜冷凍	3,900	859.00	3,350,100	
神栄	300	612.00	183,600	
ラサ商事	800	911.00	728,800	
アルコニックス	1,600	1,551.00	2,481,600	
神戸物産	5,000	5,490.00	27,450,000	

ハイパー	300	562.00	168,600	
あい　ホールディングス	2,100	1,937.00	4,067,700	
ディーブイエックス	600	1,008.00	604,800	
ダイワボウホールディングス	1,200	6,820.00	8,184,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	1,891.00	6,618,500	
ラクト・ジャパン	600	3,290.00	1,974,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	1,006.00	2,816,800	
八洲電機	1,200	917.00	1,100,400	
メディアスホールディングス	900	853.00	767,700	
レスターホールディングス	1,500	2,249.00	3,373,500	
ジューテックホールディングス	400	1,003.00	401,200	
大光	700	703.00	492,100	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,686.00	843,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,700	1,087.00	8,369,900	
黒谷	500	510.00	255,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	721.00	216,300	
三洋貿易	1,500	1,004.00	1,506,000	
ビューティガレージ	300	2,650.00	795,000	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,082.00	1,190,200	
ミタチ産業	500	616.00	308,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,300	5,070.00	11,661,000	
明治電機工業	500	1,319.00	659,500	
デリカフーズホールディングス	600	609.00	365,400	
スターティアホールディングス	400	692.00	276,800	
コメダホールディングス	3,200	1,927.00	6,166,400	
ピーバンドットコム	200	924.00	184,800	
アセンテック	400	2,032.00	812,800	
富士興産	500	914.00	457,000	
協栄産業	200	1,381.00	276,200	
小野建	1,300	1,169.00	1,519,700	
南陽	400	1,768.00	707,200	
佐鳥電機	1,100	814.00	895,400	
エコートレーディング	400	612.00	244,800	
伯東	900	1,151.00	1,035,900	
コンドーテック	1,200	1,044.00	1,252,800	
中山福	900	488.00	439,200	

ナガイレーベン	1,900	2,537.00	4,820,300	
三菱食品	1,600	2,795.00	4,472,000	
松田産業	1,100	1,480.00	1,628,000	
第一興商	2,200	3,825.00	8,415,000	
メディパルホールディングス	15,700	1,936.00	30,395,200	
ＳＰＫ	600	1,288.00	772,800	
萩原電気ホールディングス	600	2,260.00	1,356,000	
アズワン	900	14,570.00	13,113,000	
スズデン	500	1,180.00	590,000	
シモジマ	900	1,377.00	1,239,300	
ドウシシャ	1,400	2,009.00	2,812,600	
小津産業	300	1,767.00	530,100	
高速	900	1,506.00	1,355,400	
たけびし	500	1,546.00	773,000	
リックス	400	1,604.00	641,600	
丸文	1,400	509.00	712,600	
ハピネット	1,300	1,412.00	1,835,600	
橋本総業ホールディングス	300	2,260.00	678,000	
日本ライフライン	4,300	1,338.00	5,753,400	
タカショー	1,000	672.00	672,000	
マルカ	500	2,202.00	1,101,000	
ＩＤＯＭ	4,000	629.00	2,516,000	
進和	900	1,900.00	1,710,000	
エスケイジャパン	500	675.00	337,500	
ダイトロン	600	1,542.00	925,200	
シークス	1,900	1,323.00	2,513,700	
田中商事	500	690.00	345,000	
オーハシテクニカ	800	1,427.00	1,141,600	
白銅	600	1,322.00	793,200	
ダイコー通産	100	1,369.00	136,900	
伊藤忠商事	99,200	2,554.50	253,406,400	
丸紅	151,500	588.50	89,157,750	
高島	300	1,866.00	559,800	
長瀬産業	8,200	1,420.00	11,644,000	
蝶理	1,000	1,652.00	1,652,000	
豊田通商	16,200	3,010.00	48,762,000	

三共生興	2,300	421.00	968,300	
兼松	5,400	1,266.00	6,836,400	
ツカモトコーポレーション	300	1,239.00	371,700	
三井物産	125,900	1,791.50	225,549,850	
日本紙パルプ商事	800	3,705.00	2,964,000	
カメイ	1,900	1,110.00	2,109,000	
東都水産	200	3,915.00	783,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,821.00	564,200	
スターゼン	600	3,995.00	2,397,000	
山善	5,700	1,082.00	6,167,400	
椿本興業	300	3,215.00	964,500	
住友商事	91,800	1,235.00	113,373,000	
内田洋行	600	5,450.00	3,270,000	
三菱商事	95,400	2,443.50	233,109,900	
第一実業	700	3,760.00	2,632,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	2,212.00	7,963,200	
西華産業	800	1,372.00	1,097,600	
佐藤商事	1,200	944.00	1,132,800	
菱洋エレクトロ	1,500	2,837.00	4,255,500	
東京産業	1,400	531.00	743,400	
ユアサ商事	1,400	3,175.00	4,445,000	
神鋼商事	400	1,872.00	748,800	
トルク	1,000	288.00	288,000	
阪和興業	2,700	2,148.00	5,799,600	
正栄食品工業	900	3,915.00	3,523,500	
カナデン	1,200	1,380.00	1,656,000	
菱電商事	1,100	1,520.00	1,672,000	
フルサト工業	800	1,372.00	1,097,600	
岩谷産業	3,300	4,770.00	15,741,000	
ナイス	700	1,283.00	898,100	
昭光通商	500	614.00	307,000	
ニチモウ	200	1,863.00	372,600	
極東貿易	400	1,388.00	555,200	
イワキ	2,000	521.00	1,042,000	
三愛石油	3,700	1,053.00	3,896,100	
稲畑産業	3,200	1,275.00	4,080,000	

ＧＳＩクレオス	400	1,873.00	749,200	
明和産業	1,500	408.00	612,000	
クワザワホールディングス	600	563.00	337,800	
ヤマエ久野	1,100	1,204.00	1,324,400	
ワキタ	3,200	1,090.00	3,488,000	
東邦ホールディングス	4,700	1,960.00	9,212,000	
サンゲツ	3,900	1,512.00	5,896,800	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,284.00	2,824,800	
シナネンホールディングス	600	3,120.00	1,872,000	
伊藤忠エネクス	3,300	988.00	3,260,400	
サンリオ	4,100	1,991.00	8,163,100	
サンワテクノス	1,100	849.00	933,900	
リョーサン	1,600	2,023.00	3,236,800	
新光商事	2,200	862.00	1,896,400	
トーホー	700	1,819.00	1,273,300	
三信電気	800	2,039.00	1,631,200	
東陽テクニカ	1,600	968.00	1,548,800	
モスフードサービス	1,900	2,849.00	5,413,100	
加賀電子	1,500	2,167.00	3,250,500	
ソーダニッカ	1,600	554.00	886,400	
立花エレテック	1,100	1,734.00	1,907,400	
フォーバル	700	936.00	655,200	
ＰＡＬＴＡＣ	2,300	5,720.00	13,156,000	
三谷産業	2,100	415.00	871,500	
太平洋興発	600	623.00	373,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	300	1,805.00	541,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,401.00	280,200	
コーア商事ホールディングス	100	2,738.00	273,800	
国際紙パルプ商事	3,600	267.00	961,200	
ヤマタネ	700	1,370.00	959,000	
丸紅建材リース	200	1,735.00	347,000	
日鉄物産	1,100	3,155.00	3,470,500	
泉州電業	400	3,090.00	1,236,000	
トラスコ中山	3,300	2,765.00	9,124,500	
オートバックスセブン	5,400	1,375.00	7,425,000	
モリト	1,100	667.00	733,700	

加藤産業	2,100	3,525.00	7,402,500	
北恵	400	1,010.00	404,000	
イノテック	800	965.00	772,000	
イエローハット	2,800	1,796.00	5,028,800	
ＪＫホールディングス	1,400	792.00	1,108,800	
日伝	1,300	2,188.00	2,844,400	
北沢産業	1,200	289.00	346,800	
杉本商事	800	1,855.00	1,484,000	
因幡電機産業	4,100	2,572.00	10,545,200	
東テク	500	2,413.00	1,206,500	
ミスミグループ本社	18,200	2,998.00	54,563,600	
アルテック	1,100	312.00	343,200	
タキヒヨー	500	1,752.00	876,000	
蔵王産業	300	1,415.00	424,500	
スズケン	6,200	3,750.00	23,250,000	
ジェコス	1,000	939.00	939,000	
グローセル	1,600	405.00	648,000	
ローソン	3,700	5,000.00	18,500,000	
サンエー	1,200	4,270.00	5,124,000	
カワチ薬品	1,100	2,948.00	3,242,800	
エービーシー・マート	2,300	5,230.00	12,029,000	
ハードオフコーポレーション	600	666.00	399,600	
アスクル	1,500	4,075.00	6,112,500	
ゲオホールディングス	2,600	1,575.00	4,095,000	
アダストリア	2,000	1,883.00	3,766,000	
ジーフット	1,000	458.00	458,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	422.00	126,600	
くら寿司	900	6,490.00	5,841,000	
キャンドゥ	700	1,875.00	1,312,500	
パルグループホールディングス	1,500	1,242.00	1,863,000	
エディオン	6,700	1,051.00	7,041,700	
サーラコーポレーション	3,000	581.00	1,743,000	
ワッツ	700	810.00	567,000	
ハローズ	600	3,415.00	2,049,000	
フジオフードグループ本社	1,200	1,423.00	1,707,600	
あみやき亭	300	2,869.00	860,700	

ひらまつ	2,900	200.00	580,000	
大黒天物産	400	5,380.00	2,152,000	
ハニーズホールディングス	1,300	1,000.00	1,300,000	
ファーマライズホールディングス	400	772.00	308,800	
アルペン	1,100	2,026.00	2,228,600	
ハブ	400	615.00	246,000	
クオールホールディングス	2,200	1,194.00	2,626,800	
ジンズホールディングス	800	7,590.00	6,072,000	
ビックカメラ	8,600	1,181.00	10,156,600	
ＤＣＭホールディングス	8,800	1,293.00	11,378,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	10,300	5,150.00	53,045,000	
東京一番フーズ	400	570.00	228,000	
きちりホールディングス	400	643.00	257,200	
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,000.00	2,400,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	17,400	873.00	15,190,200	
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,555.00	3,265,500	
マツモトキヨシホールディングス	6,000	3,960.00	23,760,000	
ブロンコビリー	800	2,332.00	1,865,600	
ＺＯＺＯ	10,000	2,696.00	26,960,000	
トレジャー・ファクトリー	400	692.00	276,800	
物語コーポレーション	400	10,850.00	4,340,000	
ココカラファイン	1,500	7,030.00	10,545,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	568.00	14,484,000	
Ｈａｍｅｅ	500	1,905.00	952,500	
ウエルシアホールディングス	8,600	3,985.00	34,271,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,500	3,345.00	8,362,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,800	374.00	673,200	
ミサワ	300	738.00	221,400	
ティーライフ	200	1,120.00	224,000	
チムニー	500	1,317.00	658,500	
シュッピン	1,100	883.00	971,300	
オイシックス・ラ・大地	1,400	3,060.00	4,284,000	
ネクステージ	2,500	1,377.00	3,442,500	
ジョイフル本田	4,300	1,579.00	6,789,700	
鳥貴族	400	1,628.00	651,200	
キリン堂ホールディングス	600	3,480.00	2,088,000	

ホットランド	1,100	1,225.00	1,347,500	
すかいらーくホールディングス	16,300	1,551.00	25,281,300	
ＳＦＰホールディングス	800	1,391.00	1,112,800	
綿半ホールディングス	1,100	1,364.00	1,500,400	
ヨシックス	200	1,742.00	348,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,200	1,072.00	4,502,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	881.00	704,800	
ＢＥＥＮＯＳ	700	1,658.00	1,160,600	
あさひ	1,100	1,708.00	1,878,800	
日本調剤	900	1,771.00	1,593,900	
コスモス薬品	1,300	17,160.00	22,308,000	
トーエル	700	797.00	557,900	
オンリー	300	493.00	147,900	
セブン&アイ・ホールディングス	56,900	3,404.00	193,687,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,800	599.00	4,672,200	
ツルハホールディングス	3,200	14,390.00	46,048,000	
サンマルクホールディングス	1,200	1,568.00	1,881,600	
フェリシモ	300	1,357.00	407,100	
トリドールホールディングス	3,600	1,381.00	4,971,600	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,400	367.00	513,800	
ウイルプラスホールディングス	200	583.00	116,600	
ＪＭホールディングス	1,100	2,383.00	2,621,300	
サツドラホールディングス	200	2,012.00	402,400	
アレンザホールディングス	700	1,367.00	956,900	
串カツ田中ホールディングス	400	1,820.00	728,000	
バロックジャパンリミテッド	1,000	673.00	673,000	
クスリのアオキホールディングス	1,300	8,300.00	10,790,000	
力の源ホールディングス	700	601.00	420,700	
スシローグローバルホールディングス	8,000	2,790.00	22,320,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	466.00	699,000	
はるやまホールディングス	700	669.00	468,300	
ノジマ	2,600	2,975.00	7,735,000	
カッパ・クリエイト	2,100	1,443.00	3,030,300	
ライトオン	1,100	624.00	686,400	
ジーンズメイト	600	344.00	206,400	

良品計画	19,300	2,341.00	45,181,300	
三城ホールディングス	1,600	265.00	424,000	
アドヴァン	2,300	1,301.00	2,992,300	
アルビス	600	2,488.00	1,492,800	
コナカ	1,900	251.00	476,900	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,634.00	326,800	
Ｇ－７ホールディングス	900	2,400.00	2,160,000	
イオン北海道	1,900	870.00	1,653,000	
コジマ	2,600	659.00	1,713,400	
ヒマラヤ	600	841.00	504,600	
コーナン商事	2,100	3,470.00	7,287,000	
エコス	500	2,293.00	1,146,500	
ワタミ	1,700	1,002.00	1,703,400	
マルシェ	400	542.00	216,800	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	32,000	2,262.00	72,384,000	
西松屋チェーン	3,200	1,644.00	5,260,800	
ゼンショーホールディングス	7,000	2,440.00	17,080,000	
幸楽苑ホールディングス	900	1,671.00	1,503,900	
ハークスレイ	300	930.00	279,000	
サイゼリヤ	2,200	1,946.00	4,281,200	
ＶＴホールディングス	6,200	388.00	2,405,600	
魚力	400	1,700.00	680,000	
フジ・コーポレーション	400	2,213.00	885,200	
ユナイテッドアローズ	1,500	1,479.00	2,218,500	
ハイデイ日高	2,100	1,702.00	3,574,200	
京都きもの友禅	1,000	235.00	235,000	
コロワイド	4,800	1,643.00	7,886,400	
ピーシーデポコーポレーション	1,900	642.00	1,219,800	
壱番屋	1,000	5,280.00	5,280,000	
ＰＬＡＮＴ	400	842.00	336,800	
スギホールディングス	2,900	6,850.00	19,865,000	
薬王堂ホールディングス	600	2,434.00	1,460,400	
スクロール	2,300	915.00	2,104,500	
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,841.00	2,761,500	
ファミリーマート	11,600	2,289.00	26,552,400	

木曽路	1,900	2,513.00	4,774,700	
ＳＲＳホールディングス	1,700	907.00	1,541,900	
千趣会	2,700	370.00	999,000	
タカキュー	1,300	141.00	183,300	
リテールパートナーズ	1,900	1,386.00	2,633,400	
ケーヨー	3,000	746.00	2,238,000	
上新電機	1,700	2,708.00	4,603,600	
日本瓦斯	2,300	4,830.00	11,109,000	
ロイヤルホールディングス	2,500	1,883.00	4,707,500	
東天紅	100	985.00	98,500	
いなげや	1,800	1,807.00	3,252,600	
島忠	2,700	4,730.00	12,771,000	
チヨダ	1,600	945.00	1,512,000	
ライフコーポレーション	1,100	3,665.00	4,031,500	
リンガーハット	1,800	2,231.00	4,015,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,000	746.00	1,492,000	
テンアライド	1,500	345.00	517,500	
ＡＯＫＩホールディングス	2,900	494.00	1,432,600	
オークワ	2,300	1,458.00	3,353,400	
コメリ	2,300	2,947.00	6,778,100	
青山商事	3,000	544.00	1,632,000	
しまむら	1,700	11,200.00	19,040,000	
はせがわ	400	286.00	114,400	
高島屋	10,600	881.00	9,338,600	
松屋	3,000	702.00	2,106,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	6,900	747.00	5,154,300	
近鉄百貨店	600	3,230.00	1,938,000	
丸井グループ	13,300	1,979.00	26,320,700	
アクシアル　リテイリング	1,200	4,375.00	5,250,000	
イオン	56,000	2,690.50	150,668,000	
イズミ	3,000	3,685.00	11,055,000	
平和堂	3,000	2,168.00	6,504,000	
フジ	1,800	1,931.00	3,475,800	
ヤオコー	1,700	7,250.00	12,325,000	
ゼビオホールディングス	1,800	720.00	1,296,000	
ケーズホールディングス	14,000	1,363.00	19,082,000	

Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	800	931.00	744,800	
日産東京販売ホールディングス	2,300	246.00	565,800	
シルバーライフ	200	2,081.00	416,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	600	4,255.00	2,553,000	
ナルミヤ・インターナショナル	400	790.00	316,000	
ブックオフグループホールディングス	900	848.00	763,200	
アインホールディングス	1,800	7,490.00	13,482,000	
元気寿司	400	2,344.00	937,600	
ヤマダホールディングス	44,300	508.00	22,504,400	
アークランドサカモト	2,300	2,064.00	4,747,200	
ニトリホールディングス	6,300	20,940.00	131,922,000	
愛眼	1,200	224.00	268,800	
ケーユーホールディングス	800	773.00	618,400	
吉野家ホールディングス	4,800	1,903.00	9,134,400	
松屋フーズホールディングス	700	3,510.00	2,457,000	
サガミホールディングス	2,000	1,272.00	2,544,000	
関西スーパーマーケット	1,200	1,210.00	1,452,000	
王将フードサービス	1,100	5,810.00	6,391,000	
プレナス	1,600	1,743.00	2,788,800	
ミニストップ	1,100	1,387.00	1,525,700	
アークス	3,000	2,300.00	6,900,000	
バローホールディングス	3,200	2,597.00	8,310,400	
藤久	400	1,002.00	400,800	
ベルク	700	6,350.00	4,445,000	
大庄	800	1,144.00	915,200	
ファーストリテイリング	1,900	73,650.00	139,935,000	
サンドラッグ	5,500	3,905.00	21,477,500	
サックスバー　ホールディングス	1,300	557.00	724,100	
ヤマザワ	400	1,726.00	690,400	
やまや	300	2,103.00	630,900	
ベルーナ	3,200	970.00	3,104,000	
島根銀行	400	631.00	252,400	
じもとホールディングス	1,000	958.00	958,000	
めぶきフィナンシャルグループ	75,600	212.00	16,027,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	1,139.00	2,278,000	
九州フィナンシャルグループ	31,800	491.00	15,613,800	

ゆうちょ銀行	41,200	831.00	34,237,200	
富山第一銀行	3,500	290.00	1,015,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,100	362.00	30,082,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,600	728.00	6,988,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,600	418.00	3,594,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,315.00	1,709,500	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,052.00	5,130,000	
ひろぎんホールディングス	21,400	586.00	12,540,400	
新生銀行	10,700	1,360.00	14,552,000	
あおぞら銀行	8,700	1,808.00	15,729,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	995,900	423.40	421,664,060	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	158,200	355.40	56,224,280	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,500	2,886.50	79,378,750	
三井住友フィナンシャルグループ	100,700	2,980.50	300,136,350	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	48,600	561.00	27,264,600	
群馬銀行	27,900	340.00	9,486,000	
武蔵野銀行	2,200	1,588.00	3,493,600	
千葉興業銀行	4,000	247.00	988,000	
筑波銀行	6,000	185.00	1,110,000	
七十七銀行	4,900	1,526.00	7,477,400	
青森銀行	1,100	2,307.00	2,537,700	
秋田銀行	900	1,472.00	1,324,800	
山形銀行	1,600	1,303.00	2,084,800	
岩手銀行	1,000	2,378.00	2,378,000	
東邦銀行	13,100	229.00	2,999,900	
東北銀行	700	1,125.00	787,500	
みちのく銀行	900	1,240.00	1,116,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,300	1,797.00	22,103,100	
静岡銀行	35,400	717.00	25,381,800	
十六銀行	1,800	1,942.00	3,495,600	
スルガ銀行	14,800	366.00	5,416,800	
八十二銀行	35,100	396.00	13,899,600	
山梨中央銀行	1,700	855.00	1,453,500	
大垣共立銀行	2,900	2,323.00	6,736,700	
福井銀行	1,300	1,862.00	2,420,600	

北國銀行	1,400	2,964.00	4,149,600	
清水銀行	600	1,706.00	1,023,600	
富山銀行	300	2,971.00	891,300	
滋賀銀行	2,900	2,289.00	6,638,100	
南都銀行	2,400	1,903.00	4,567,200	
百五銀行	13,000	319.00	4,147,000	
京都銀行	5,200	4,720.00	24,544,000	
紀陽銀行	5,100	1,544.00	7,874,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	1,004.00	9,738,800	
山陰合同銀行	8,600	536.00	4,609,600	
中国銀行	12,500	920.00	11,500,000	
鳥取銀行	500	1,115.00	557,500	
伊予銀行	20,700	666.00	13,786,200	
百十四銀行	1,600	1,720.00	2,752,000	
四国銀行	2,300	726.00	1,669,800	
阿波銀行	2,400	2,515.00	6,036,000	
大分銀行	800	2,521.00	2,016,800	
宮崎銀行	1,000	2,272.00	2,272,000	
佐賀銀行	900	1,312.00	1,180,800	
沖縄銀行	1,300	2,944.00	3,827,200	
琉球銀行	3,400	870.00	2,958,000	
セブン銀行	48,600	245.00	11,907,000	
みずほフィナンシャルグループ	197,800	1,311.00	259,315,800	
高知銀行	500	762.00	381,000	
山口フィナンシャルグループ	18,100	697.00	12,615,700	
長野銀行	500	1,398.00	699,000	
名古屋銀行	1,100	2,707.00	2,977,700	
北洋銀行	21,800	227.00	4,948,600	
愛知銀行	500	2,855.00	1,427,500	
中京銀行	600	2,098.00	1,258,800	
大光銀行	500	1,234.00	617,000	
愛媛銀行	2,000	1,146.00	2,292,000	
トマト銀行	600	1,004.00	602,400	
京葉銀行	6,300	475.00	2,992,500	
栃木銀行	7,000	193.00	1,351,000	
北日本銀行	500	1,929.00	964,500	

東和銀行	2,600	715.00	1,859,000	
福島銀行	1,400	237.00	331,800	
大東銀行	800	612.00	489,600	
トモニホールディングス	11,300	324.00	3,661,200	
フィデアホールディングス	14,200	103.00	1,462,600	
池田泉州ホールディングス	16,800	162.00	2,721,600	
ＦＰＧ	4,600	530.00	2,438,000	
マーキュリアインベストメント	600	645.00	387,000	
ＳＢＩホールディングス	16,500	2,587.00	42,685,500	
ジャフコ　グループ	2,200	5,050.00	11,110,000	
大和証券グループ本社	116,800	456.80	53,354,240	
野村ホールディングス	256,300	490.80	125,792,040	
岡三証券グループ	12,400	367.00	4,550,800	
丸三証券	4,400	505.00	2,222,000	
東洋証券	5,500	121.00	665,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,800	298.00	5,006,400	
光世証券	400	701.00	280,400	
水戸証券	4,200	228.00	957,600	
いちよし証券	2,800	450.00	1,260,000	
松井証券	8,300	927.00	7,694,100	
マネックスグループ	10,800	301.00	3,250,800	
極東証券	2,000	718.00	1,436,000	
岩井コスモホールディングス	1,400	1,321.00	1,849,400	
藍澤證券	2,700	692.00	1,868,400	
マネーパートナーズグループ	1,600	204.00	326,400	
スパークス・グループ	6,900	243.00	1,676,700	
かんぽ生命保険	5,100	1,775.00	9,052,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	27,400	4,019.00	110,120,600	
アニコム　ホールディングス	4,800	1,188.00	5,702,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	38,100	2,979.50	113,518,950	
第一生命ホールディングス	82,400	1,662.00	136,948,800	
東京海上ホールディングス	51,500	4,930.00	253,895,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	43,400	1,126.00	48,868,400	
アドバンスクリエイト	300	1,992.00	597,600	
全国保証	4,100	4,200.00	17,220,000	

ジェイリース	400	720.00	288,000	
イントラスト	500	874.00	437,000	
日本モーゲージサービス	600	1,025.00	615,000	
Ｃａｓａ	500	1,279.00	639,500	
アルヒ	2,300	1,938.00	4,457,400	
プレミアグループ	800	2,030.00	1,624,000	
クレディセゾン	10,200	1,223.00	12,474,600	
芙蓉総合リース	1,500	6,180.00	9,270,000	
みずほリース	2,200	2,722.00	5,988,400	
東京センチュリー	2,900	5,540.00	16,066,000	
日本証券金融	6,500	496.00	3,224,000	
アイフル	22,300	309.00	6,890,700	
リコーリース	1,200	2,824.00	3,388,800	
イオンフィナンシャルサービス	8,900	1,127.00	10,030,300	
アコム	29,300	476.00	13,946,800	
ジャックス	1,600	1,742.00	2,787,200	
オリエントコーポレーション	39,500	118.00	4,661,000	
日立キャピタル	3,400	2,337.00	7,945,800	
アプラスフィナンシャル	7,400	79.00	584,600	
オリックス	90,400	1,316.50	119,011,600	
三菱ＵＦＪリース	37,000	468.00	17,316,000	
九州リースサービス	800	608.00	486,400	
日本取引所グループ	41,800	2,560.00	107,008,000	
イー・ギャランティ	1,700	2,149.00	3,653,300	
アサックス	800	717.00	573,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	600	1,794.00	1,076,400	
いちご	18,700	322.00	6,021,400	
日本駐車場開発	15,000	132.00	1,980,000	
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,388.00	1,110,400	
ＡＤワークスグループ	3,200	155.00	496,000	
ヒューリック	30,900	1,019.00	31,487,100	
三栄建築設計	600	1,809.00	1,085,400	
野村不動産ホールディングス	8,900	1,960.00	17,444,000	
三重交通グループホールディングス	3,100	462.00	1,432,200	
サムティ	2,100	1,722.00	3,616,200	
ディア・ライフ	2,200	395.00	869,000	

コーセーアールイー	600	556.00	333,600	
日本商業開発	1,000	1,750.00	1,750,000	
プレサンスコーポレーション	2,500	1,522.00	3,805,000	
ＴＨＥグローバル社	1,000	224.00	224,000	
ハウスコム	300	1,285.00	385,500	
日本管理センター	800	1,335.00	1,068,000	
サンセイランディック	600	730.00	438,000	
エストラスト	300	761.00	228,300	
フージャースホールディングス	3,000	673.00	2,019,000	
オープンハウス	4,600	3,585.00	16,491,000	
東急不動産ホールディングス	39,700	486.00	19,294,200	
飯田グループホールディングス	12,200	1,992.00	24,302,400	
イーグランド	300	790.00	237,000	
ムゲンエステート	1,000	529.00	529,000	
ビーロット	800	793.00	634,400	
ファーストブラザーズ	300	968.00	290,400	
ハウスドゥ	800	1,332.00	1,065,600	
シーアールイー	400	1,300.00	520,000	
プロパティエージェント	300	1,470.00	441,000	
ケイアイスター不動産	500	2,622.00	1,311,000	
アグレ都市デザイン	400	669.00	267,600	
グッドコムアセット	400	3,170.00	1,268,000	
ジェイ・エス・ビー	300	2,951.00	885,300	
テンポイノベーション	400	771.00	308,400	
グローバル・リンク・マネジメント	400	728.00	291,200	
パーク２４	7,800	1,591.00	12,409,800	
パラカ	400	1,567.00	626,800	
三井不動産	70,800	1,893.00	134,024,400	
三菱地所	102,100	1,600.00	163,360,000	
平和不動産	2,700	3,075.00	8,302,500	
東京建物	14,400	1,282.00	18,460,800	
ダイビル	3,800	1,237.00	4,700,600	
京阪神ビルディング	2,400	1,912.00	4,588,800	
住友不動産	32,800	2,969.00	97,383,200	
テーオーシー	3,000	668.00	2,004,000	
東京楽天地	300	4,145.00	1,243,500	

スターツコーポレーション	2,000	2,497.00	4,994,000	
フジ住宅	1,900	548.00	1,041,200	
空港施設	1,700	462.00	785,400	
明和地所	1,000	462.00	462,000	
ゴールドクレスト	1,200	1,323.00	1,587,600	
エスリード	600	1,341.00	804,600	
日神グループホールディングス	2,400	407.00	976,800	
日本エスコン	2,700	951.00	2,567,700	
タカラレーベン	6,900	304.00	2,097,600	
ＡＶＡＮＴＩＡ	900	885.00	796,500	
イオンモール	7,300	1,715.00	12,519,500	
毎日コムネット	500	710.00	355,000	
ファースト住建	700	1,008.00	705,600	
カチタス	3,600	2,917.00	10,501,200	
トーセイ	2,100	1,094.00	2,297,400	
サンフロンティア不動産	2,100	883.00	1,854,300	
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	942.00	1,224,600	
インテリックス	600	531.00	318,600	
ランドビジネス	700	346.00	242,200	
グランディハウス	1,300	367.00	477,100	
日本空港ビルデング	4,700	4,840.00	22,748,000	
明豊ファシリティワークス	700	608.00	425,600	
日本工営	1,000	2,768.00	2,768,000	
ＬＩＦＵＬＬ	4,900	419.00	2,053,100	
ミクシィ	2,700	2,780.00	7,506,000	
ジェイエイシーリクルートメント	900	1,379.00	1,241,100	
日本M&Aセンター	10,800	6,040.00	65,232,000	
メンバーズ	400	1,821.00	728,400	
中広	200	469.00	93,800	
ＵＴグループ	2,200	3,495.00	7,689,000	
アイティメディア	600	2,364.00	1,418,400	
タケエイ	1,400	1,031.00	1,443,400	
Ｅ・Ｊホールディングス	300	2,240.00	672,000	
ビーネックスグループ	1,800	1,096.00	1,972,800	
コシダカホールディングス	3,400	465.00	1,581,000	
アルトナー	300	866.00	259,800	

パソナグループ	1,500	1,702.00	2,553,000	
ＣＤＳ	400	1,308.00	523,200	
リンクアンドモチベーション	2,600	416.00	1,081,600	
ＧＣＡ	1,800	690.00	1,242,000	
エス・エム・エス	4,400	3,040.00	13,376,000	
サニーサイドアップグループ	500	660.00	330,000	
パーソルホールディングス	14,100	1,736.00	24,477,600	
リニカル	700	774.00	541,800	
クックパッド	4,400	377.00	1,658,800	
エスクリ	500	336.00	168,000	
アイ・ケイ・ケイ	700	640.00	448,000	
学情	500	1,102.00	551,000	
スタジオアリス	700	1,978.00	1,384,600	
シミックホールディングス	700	1,329.00	930,300	
エプコ	300	1,018.00	305,400	
ＮＪＳ	300	1,868.00	560,400	
綜合警備保障	5,600	5,040.00	28,224,000	
カカクコム	10,400	2,702.00	28,100,800	
アイロムグループ	500	1,802.00	901,000	
セントケア・ホールディング	900	716.00	644,400	
サイネックス	300	846.00	253,800	
ルネサンス	800	886.00	708,800	
ディップ	1,900	2,203.00	4,185,700	
デジタルホールディングス	1,000	1,293.00	1,293,000	
新日本科学	1,500	701.00	1,051,500	
ツクイホールディングス	3,300	534.00	1,762,200	
キャリアデザインセンター	300	1,002.00	300,600	
ベネフィット・ワン	5,100	2,588.00	13,198,800	
エムスリー	31,100	6,700.00	208,370,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	268.00	294,800	
ブラス	200	417.00	83,400	
アウトソーシング	8,100	1,112.00	9,007,200	
ウェルネット	1,400	567.00	793,800	
ワールドホールディングス	500	2,248.00	1,124,000	
ディー・エヌ・エー	5,900	1,845.00	10,885,500	
博報堂ＤＹホールディングス	19,600	1,462.00	28,655,200	

ぐるなび	2,500	763.00	1,907,500	
タカミヤ	1,500	540.00	810,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	1,086.00	1,194,600	
ファンコミュニケーションズ	3,900	485.00	1,891,500	
ライク	500	2,122.00	1,061,000	
ビジネス・ブレークスルー	400	392.00	156,800	
エスプール	3,600	741.00	2,667,600	
ＷＤＢホールディングス	600	3,065.00	1,839,000	
手間いらず	100	5,200.00	520,000	
ティア	800	400.00	320,000	
ＣＤＧ	100	1,645.00	164,500	
バリューコマース	1,000	3,285.00	3,285,000	
インフォマート	14,200	863.00	12,254,600	
ＪＰホールディングス	4,400	306.00	1,346,400	
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	961.00	1,825,900	
レッグス	400	1,481.00	592,400	
プレステージ・インターナショナル	5,200	852.00	4,430,400	
アミューズ	800	2,637.00	2,109,600	
ドリームインキュベータ	400	1,488.00	595,200	
クイック	900	1,085.00	976,500	
ＴＡＣ	900	217.00	195,300	
ケネディクス	12,100	544.00	6,582,400	
電通グループ	15,800	3,190.00	50,402,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	573.00	286,500	
ぴあ	400	3,050.00	1,220,000	
イオンファンタジー	500	2,291.00	1,145,500	
シーティーエス	1,600	924.00	1,478,400	
ネクシィーズグループ	400	1,002.00	400,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	3,900	2,754.00	10,740,600	
アルプス技研	1,200	2,090.00	2,508,000	
ダイオーズ	300	940.00	282,000	
日本空調サービス	1,500	751.00	1,126,500	
オリエンタルランド	15,000	15,350.00	230,250,000	
ダスキン	3,500	2,667.00	9,334,500	
明光ネットワークジャパン	1,800	646.00	1,162,800	

ファルコホールディングス	800	1,417.00	1,133,600	
秀英予備校	300	447.00	134,100	
ラウンドワン	4,000	932.00	3,728,000	
リゾートトラスト	6,500	1,702.00	11,063,000	
ビー・エム・エル	1,800	3,015.00	5,427,000	
ワタベウェディング	200	294.00	58,800	
りらいあコミュニケーションズ	2,500	1,239.00	3,097,500	
リソー教育	6,600	317.00	2,092,200	
早稲田アカデミー	600	935.00	561,000	
ユー・エス・エス	15,800	1,959.00	30,952,200	
東京個別指導学院	500	617.00	308,500	
サイバーエージェント	8,700	6,440.00	56,028,000	
楽天	65,700	1,048.00	68,853,600	
クリーク・アンド・リバー社	700	1,048.00	733,600	
テー・オー・ダブリュー	2,400	304.00	729,600	
山田コンサルティンググループ	900	1,086.00	977,400	
セントラルスポーツ	500	2,267.00	1,133,500	
フルキャストホールディングス	1,200	1,756.00	2,107,200	
エン・ジャパン	2,500	2,591.00	6,477,500	
リソルホールディングス	200	3,675.00	735,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,800	6,900.00	19,320,000	
アトラ	400	282.00	112,800	
インターワークス	300	333.00	99,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	11,100.00	6,660,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,000	1,384.00	1,384,000	
ファーストロジック	300	821.00	246,300	
三機サービス	300	979.00	293,700	
Ｇｕｎｏｓｙ	900	769.00	692,100	
デザインワン・ジャパン	500	232.00	116,000	
イー・ガーディアン	600	3,180.00	1,908,000	
リブセンス	800	275.00	220,000	
ジャパンマテリアル	4,300	1,323.00	5,688,900	
ベクトル	1,800	986.00	1,774,800	
ウチヤマホールディングス	700	303.00	212,100	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,201.00	1,441,200	
キャリアリンク	500	1,464.00	732,000	

ＩＢＪ	1,100	973.00	1,070,300	
アサンテ	600	1,530.00	918,000	
Ｎ・フィールド	1,000	663.00	663,000	
バリューＨＲ	600	1,635.00	981,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,100	4,805.00	5,285,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	2,208.00	1,104,000	
ＥＲＩホールディングス	400	627.00	250,800	
アビスト	200	2,715.00	543,000	
シグマクシス	1,000	1,576.00	1,576,000	
ウィルグループ	900	847.00	762,300	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,100	311.00	653,100	
リクルートホールディングス	101,000	4,151.00	419,251,000	
エラン	1,000	2,415.00	2,415,000	
土木管理総合試験所	700	400.00	280,000	
ネットマーケティング	600	598.00	358,800	
日本郵政	115,600	751.20	86,838,720	
ベルシステム２４ホールディングス	2,300	1,584.00	3,643,200	
鎌倉新書	1,100	1,132.00	1,245,200	
ＳＭＮ	300	944.00	283,200	
一蔵	200	435.00	87,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	500	2,902.00	1,451,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	300	771.00	231,300	
エアトリ	700	1,420.00	994,000	
ハイアス・アンド・カンパニー	900	177.00	159,300	
アトラエ	400	2,665.00	1,066,000	
ストライク	500	6,040.00	3,020,000	
ソラスト	3,900	1,288.00	5,023,200	
セラク	400	2,312.00	924,800	
インソース	600	2,925.00	1,755,000	
ベイカレント・コンサルティング	900	15,010.00	13,509,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	2,178.00	653,400	
アイモバイル	500	1,292.00	646,000	
キャリアインデックス	600	531.00	318,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	500	811.00	405,500	
船場	300	916.00	274,800	
グレイステクノロジー	700	5,280.00	3,696,000	

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,600	3,935.00	6,296,000	
フルテック	200	1,421.00	284,200	
グリーンズ	400	497.00	198,800	
ツナググループ・ホールディングス	300	405.00	121,500	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	400	567.00	226,800	
ソウルドアウト	300	1,503.00	450,900	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	618.00	185,400	
エル・ティー・エス	100	4,465.00	446,500	
ミダック	200	2,490.00	498,000	
日総工産	1,000	830.00	830,000	
キュービーネットホールディングス	600	1,695.00	1,017,000	
ＲＰＡホールディングス	1,100	744.00	818,400	
スプリックス	400	947.00	378,800	
マネジメントソリューションズ	700	1,483.00	1,038,100	
プロレド・パートナーズ	200	4,495.00	899,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	100	903.00	90,300	
ギークス	100	1,205.00	120,500	
カーブスホールディングス	3,900	646.00	2,519,400	
フォーラムエンジニアリング	700	818.00	572,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	705.00	493,500	
リログループ	7,700	2,588.00	19,927,600	
東祥	900	1,371.00	1,233,900	
エイチ・アイ・エス	2,200	1,656.00	3,643,200	
ラックランド	400	2,227.00	890,800	
共立メンテナンス	2,300	4,055.00	9,326,500	
イチネンホールディングス	1,600	1,274.00	2,038,400	
建設技術研究所	900	1,873.00	1,685,700	
スペース	900	765.00	688,500	
長大	600	1,216.00	729,600	
燦ホールディングス	600	1,210.00	726,000	
スバル興業	100	7,830.00	783,000	
東京テアトル	600	1,246.00	747,600	
タナベ経営	300	1,409.00	422,700	
ナガワ	500	7,200.00	3,600,000	
よみうりランド	300	4,325.00	1,297,500	

東京都競馬	900	5,250.00	4,725,000	
常磐興産	600	1,426.00	855,600	
カナモト	2,500	2,326.00	5,815,000	
東京ドーム	5,700	841.00	4,793,700	
西尾レントオール	1,300	2,133.00	2,772,900	
トランス・コスモス	1,300	2,847.00	3,701,100	
乃村工藝社	6,000	711.00	4,266,000	
藤田観光	600	1,577.00	946,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	900	1,083.00	974,700	
日本管財	1,500	2,056.00	3,084,000	
トーカイ	1,400	2,063.00	2,888,200	
白洋舎	200	2,272.00	454,400	
セコム	15,000	9,008.00	135,120,000	
セントラル警備保障	700	3,460.00	2,422,000	
丹青社	2,700	765.00	2,065,500	
メイテック	1,700	5,380.00	9,146,000	
応用地質	1,700	1,223.00	2,079,100	
船井総研ホールディングス	2,900	2,337.00	6,777,300	
進学会ホールディングス	200	443.00	88,600	
オオバ	1,100	731.00	804,100	
いであ	300	1,811.00	543,300	
学究社	400	1,054.00	421,600	
ベネッセホールディングス	4,700	2,560.00	12,032,000	
イオンディライト	1,700	2,891.00	4,914,700	
ナック	800	916.00	732,800	
ダイセキ	2,400	2,832.00	6,796,800	
ステップ	500	1,455.00	727,500	
合　　計	15,558,400		33,489,436,240	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	202,582,188	811,466,919
コール・ローン	2,384,831,451	1,426,733,123
出資金	12,296,456	-
株式	177,647,670,078	223,415,541,666
投資証券	5,136,934,798	5,334,508,523
派生商品評価勘定	69,237,470	60,104,909
未収入金	-	39,451,273
未収配当金	148,294,724	164,265,623
差入委託証拠金	494,738,908	522,276,550
流動資産合計	186,096,586,073	231,774,348,586
資産合計	186,096,586,073	231,774,348,586
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,167,670	26,849,511
未払金	153,638,635	20,085,890
未払解約金	251,643,763	51,950,784
未払利息	653	398
流動負債合計	406,450,721	98,886,583
負債合計	406,450,721	98,886,583
純資産の部		
元本等		
元本	70,689,493,098	81,609,225,737
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	115,000,642,254	150,066,236,266
元本等合計	185,690,135,352	231,675,462,003
純資産合計	185,690,135,352	231,675,462,003
負債純資産合計	186,096,586,073	231,774,348,586

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	出資金、株式、新株予約権証券、オプション証券等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）

		2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
1．	期首	2018年10月27日	2019年10月29日
	期首元本額	37,961,659,533円	70,689,493,098円
	期首からの追加設定元本額	36,194,127,723円	33,463,538,387円
	期首からの一部解約元本額	3,466,294,158円	22,543,805,748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）	18,485,318,413円	21,291,664,890円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	110,473,619円	125,790,854円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	288,784,765円	326,099,287円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	556,652,830円	617,768,856円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	572,308,634円	633,127,496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	2,058,555,229円	1,788,005,391円
	日興五大陸株式ファンド	5,072,486,309円	4,619,536,139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）	76,673,267円	60,652,390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）	141,714,299円	128,258,002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）	6,832,365,259円	6,659,771,936円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	27,719,286,275円	37,356,692,620円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,902,712円	4,543,408円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,164,660円	3,735,838円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	7,452,502円	5,328,950円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	5,933,515円	4,847,044円

	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,144,203,181円	3,412,350,660円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	27,756,246円	26,570,843円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	78,838,200円	72,789,091円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	115,217,010円	108,320,390円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	110,705,145円	101,730,297円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,275,701,028円	4,261,641,355円
	計	70,689,493,098円	81,609,225,737円
２．	受益権の総数	70,689,493,098口	81,609,225,737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 2018年10月27日 至 2019年10月28日	自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	△1,200,668
株式	12,825,500,893
投資証券	574,300,033
合計	13,398,600,258

（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	18,727,141,737
投資証券	△798,775,961
合計	17,928,365,776

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

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

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,874,303,434	－	2,916,807,732	42,504,298
合計		2,874,303,434	－	2,916,807,732	42,504,298

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	3,178,621,600	－	3,197,724,000	19,102,400
	米ドル	2,595,425,300	－	2,612,990,000	17,564,700
	ユーロ	583,196,300	－	584,734,000	1,537,700
合計		3,178,621,600	－	3,197,724,000	19,102,400

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,560,728,900	－	1,551,480,000	△9,248,900
	米ドル	1,275,820,800	－	1,266,193,000	△9,627,800
	ユーロ	284,908,100	－	285,287,000	378,900
合計		1,560,728,900	－	1,551,480,000	△9,248,900

（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）

2019年10月28日現在		2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.6268円	1口当たり純資産額	2.8388円
(1万口当たり純資産額)	(26,268円)	(1万口当たり純資産額)	(28,388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	40,745	14.29	582,246.05	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,070	19.68	454,017.60	
	CHENIERE ENERGY INC	12,390	48.70	603,393.00	
	CHEVRON CORP	98,441	72.57	7,143,863.37	
	CONCHO RESOURCES INC	11,125	46.97	522,541.25	
	CONOCOPHILLIPS	53,210	32.54	1,731,453.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,850	29.03	198,855.50	
	EOG RESOURCES INC	30,042	37.51	1,126,875.42	
	EXXON MOBIL CORP	215,831	34.16	7,372,786.96	
	HALLIBURTON CO	47,837	13.31	636,710.47	
	HESS CORP	16,170	39.37	636,612.90	
	KINDER MORGAN INC	108,650	12.78	1,388,547.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	34,972	29.89	1,045,313.08	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,851	9.19	210,000.69	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,231	10.02	513,334.62	
	ONEOK INC	22,780	30.55	695,929.00	
	PHILLIPS 66	21,765	50.48	1,098,697.20	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,810	85.54	668,067.40	
	SCHLUMBERGER LTD	68,001	15.40	1,047,215.40	
	VALERO ENERGY CORP	22,292	41.97	935,595.24	
	WILLIAMS COS INC	56,454	19.96	1,126,821.84	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,245	294.00	3,306,030.00	
	ALBEMARLE CORP	5,730	96.48	552,830.40	
	AMCOR PLC	86,480	10.97	948,685.60	
	AVERY DENNISON CORP	4,640	141.74	657,673.60	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,010	26.77	267,967.70	
	BALL CORP	17,440	92.72	1,617,036.80	
	CELANESE CORP	5,120	120.18	615,321.60	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,140	27.58	334,821.20	
CORTEVA INC	37,162	33.17	1,232,663.54	
CROWN HOLDINGS INC	5,715	90.38	516,521.70	
DOW INC	36,435	48.53	1,768,190.55	
DUPONT DE NEMOURS INC	38,992	59.82	2,332,501.44	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,115	87.32	708,601.80	
ECOLAB INC	13,150	204.87	2,694,040.50	
FMC CORP	6,990	107.78	753,382.20	
FREEPORT-MCMORAN INC	69,008	18.36	1,266,986.88	
INTERNATIONAL PAPER CO	20,830	46.40	966,512.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,715	110.57	410,767.55	
LINDE PLC	26,910	234.27	6,304,205.70	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,030	76.90	1,002,007.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,895	262.41	759,676.95	
MOSAIC CO/THE	17,190	18.70	321,453.00	
NEWMONT CORP	39,342	60.47	2,379,010.74	
NUCOR CORP	17,449	50.19	875,765.31	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,220	119.20	622,224.00	
PPG INDUSTRIES INC	12,704	134.27	1,705,766.08	
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	89.70	501,423.00	
SEALED AIR CORP	7,116	41.29	293,819.64	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,257	683.31	2,908,850.67	
STEEL DYNAMICS INC	12,240	32.58	398,779.20	
VULCAN MATERIALS CO	6,303	145.41	916,519.23	
WESTROCK CO	13,449	40.24	541,187.76	
3M CO	29,386	169.80	4,989,742.80	
AERCAP HOLDINGS NV	6,440	30.12	193,972.80	
ALLEGION PLC	3,850	102.88	396,088.00	
AMETEK INC	12,693	107.76	1,367,797.68	
BOEING CO/THE	27,442	167.36	4,592,693.12	
CARRIER GLOBAL CORP	41,688	34.93	1,456,161.84	
CATERPILLAR INC	27,686	168.59	4,667,582.74	
CUMMINS INC	7,205	226.28	1,630,347.40	
DEERE & CO	15,120	239.53	3,621,693.60	
DOVER CORP	8,100	116.27	941,787.00	

EATON CORP PLC	20,866	109.81	2,291,295.46	
EMERSON ELECTRIC CO	29,590	70.02	2,071,891.80	
FASTENAL CO	28,226	45.00	1,270,170.00	
FORTIVE CORP	16,594	66.50	1,103,501.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,000	85.47	598,290.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,972	140.70	1,825,160.40	
GENERAL ELECTRIC CO	445,493	7.63	3,399,111.59	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	42.58	381,091.00	
HEICO CORP	2,000	114.08	228,160.00	
HEICO CORP-CLASS A	4,130	99.79	412,132.70	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	35,906	175.54	6,302,939.24	
HOWMET AEROSPACE INC	20,893	18.95	395,922.35	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,230	152.82	340,788.60	
IDEX CORP	3,890	191.63	745,440.70	
ILLINOIS TOOL WORKS	16,175	206.70	3,343,372.50	
INGERSOLL-RAND INC	16,138	38.27	617,601.26	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,640	99.21	559,544.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,370	44.00	500,280.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	13,200	21.68	286,176.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,654	44.40	1,716,237.60	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,525	171.80	1,979,995.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	288.09	403,326.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,886	374.33	4,823,616.38	
MASCO CORP	11,689	54.76	640,089.64	
NORDSON CORP	3,030	207.56	628,906.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,034	308.43	2,477,926.62	
OTIS WORLDWIDE CORP	20,494	63.45	1,300,344.30	
OWENS CORNING	6,290	71.00	446,590.00	
PACCAR INC	18,394	92.64	1,704,020.16	
PARKER HANNIFIN CORP	6,240	226.16	1,411,238.40	
PENTAIR PLC	8,438	51.97	438,522.86	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	77,096	62.57	4,823,896.72	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,273	243.10	1,524,966.30	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,100	428.60	2,185,860.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,000	48.90	489,000.00	

SMITH (A.O.) CORP	7,970	54.93	437,792.10	
SNAP-ON INC	3,080	169.39	521,721.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,946	178.01	1,414,467.46	
SUNRUN INC	6,000	56.03	336,180.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,600	340.46	544,736.00	
TEXTRON INC	11,916	35.19	419,324.04	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,636	129.22	1,632,823.92	
TRANSDIGM GROUP INC	2,500	501.97	1,254,925.00	
UNITED RENTALS INC	3,570	188.24	672,016.80	
WABTEC CORP	8,020	62.06	497,721.20	
WW GRAINGER INC	2,127	361.03	767,910.81	
XYLEM INC	8,028	91.59	735,284.52	
CINTAS CORP	4,457	338.07	1,506,777.99	
COPART INC	11,450	114.29	1,308,620.50	
COSTAR GROUP INC	1,945	819.81	1,594,530.45	
EQUIFAX INC	6,004	152.95	918,311.80	
IHS MARKIT LTD	20,423	82.99	1,694,904.77	
NIELSEN HOLDINGS PLC	20,905	14.18	296,432.90	
REPUBLIC SERVICES INC	10,230	92.87	950,060.10	
ROBERT HALF INTL INC	4,405	51.67	227,606.35	
ROLLINS INC	8,030	60.20	483,406.00	
TRANSUNION	8,490	86.05	730,564.50	
VERISK ANALYTICS INC	8,390	189.25	1,587,807.50	
WASTE CONNECTIONS INC	12,786	103.62	1,324,885.32	
WASTE MANAGEMENT INC	21,294	116.70	2,485,009.80	
AMERCO	375	368.79	138,296.25	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,210	100.54	724,893.40	
CSX CORP	38,913	81.29	3,163,237.77	
DELTA AIR LINES INC	8,455	34.00	287,470.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,507	95.20	714,666.40	
FEDEX CORP	12,728	283.56	3,609,151.68	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	128.97	580,365.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	5,040	184.46	929,678.40	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,140	39.33	280,816.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,080	215.40	2,817,432.00	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,575	200.62	917,836.50	
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,120	42.79	347,454.80	
UBER TECHNOLOGIES INC	48,720	36.75	1,790,460.00	
UNION PACIFIC CORP	34,766	188.14	6,540,875.24	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,177	171.90	6,218,826.30	
XPO LOGISTICS INC	4,830	95.35	460,540.50	
APTIV PLC	14,350	100.29	1,439,161.50	
AUTOLIV INC	4,250	84.94	360,995.00	
BORGWARNER INC	9,890	39.75	393,127.50	
FORD MOTOR COMPANY	198,895	8.16	1,622,983.20	
GENERAL MOTORS CORP	64,025	36.83	2,358,040.75	
LEAR CORP	2,710	134.51	364,522.10	
TESLA INC	38,025	420.63	15,994,455.75	
DR HORTON INC	16,856	73.06	1,231,499.36	
GARMIN LTD	7,065	100.84	712,434.60	
HASBRO INC	6,698	92.00	616,216.00	
LENNAR CORP-CL A	14,960	78.27	1,170,919.20	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,240	333.92	2,083,660.80	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,268	104.68	342,094.24	
NEWELL BRANDS INC	16,126	18.00	290,268.00	
NIKE INC -CL B	63,438	129.99	8,246,305.62	
NVR INC	160	4,205.99	672,958.40	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,000	122.53	1,225,300.00	
PULTE GROUP INC	15,390	43.99	677,006.10	
RALPH LAUREN CORP	2,895	77.39	224,044.05	
VF CORP	17,460	74.83	1,306,531.80	
WHIRLPOOL CORP	2,864	198.11	567,387.04	
ARAMARK	10,720	30.27	324,494.40	
CARNIVAL CORP	23,087	15.36	354,616.32	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,435	1,339.08	1,921,579.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,553	99.53	652,220.09	
DOMINO'S PIZZA INC	2,090	394.10	823,669.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,270	94.61	1,255,474.70	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,060	50.68	864,600.80	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,583	101.76	1,483,966.08	

MCDONALD'S CORP	37,981	228.71	8,686,634.51	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	13,580	16.06	218,094.80	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,070	23.36	515,555.20	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,248	64.48	467,351.04	
STARBUCKS CORP	59,604	90.80	5,412,043.20	
VAIL RESORTS INC	2,220	250.01	555,022.20	
WYNN RESORTS LTD	5,560	76.56	425,673.60	
YUM! BRANDS INC	15,314	101.28	1,551,001.92	
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,190	81.04	3,175,957.60	
ALPHABET INC-CL A	15,355	1,632.98	25,074,407.90	
ALPHABET INC-CL C	15,512	1,641.00	25,455,192.00	
ALTICE USA INC- A	16,770	27.64	463,522.80	
CABLE ONE INC	250	1,907.25	476,812.50	
CHARTER COMMUNICATION-A	7,376	593.28	4,376,033.28	
COMCAST CORP-CLASS A	233,694	45.06	10,530,251.64	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,520	21.10	200,872.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	19.11	237,155.10	
DISH NETWORK CORP-A	12,729	27.24	346,737.96	
ELECTRONIC ARTS INC	14,674	126.77	1,860,222.98	
FACEBOOK INC-CLASS A	123,200	284.79	35,086,128.00	
FOX CORP - CLASS A	17,524	27.08	474,549.92	
FOX CORP- CLASS B	7,486	26.93	201,635.41	
IAC/INTERACTIVECORP	4,350	129.31	562,498.50	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	23,496	19.34	454,412.64	
LIBERTY BROADBAND-A	1,280	138.60	177,408.00	
LIBERTY BROADBAND-C	4,920	139.99	688,750.80	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	5,555	37.07	205,923.85	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	9,296	36.85	342,557.60	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,160	37.26	378,561.60	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,820	57.16	446,991.20	
MATCH GROUP INC	12,562	120.30	1,511,208.60	
NETFLIX INC	22,560	488.28	11,015,596.80	
NEWS CORP - CLASS A	18,680	13.98	261,146.40	
OMNICOM GROUP	11,727	52.72	618,247.44	
PINTEREST INC- CLASS A	18,920	53.00	1,002,760.00	

ROKU INC	4,850	223.96	1,086,206.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	5.98	282,495.20	
SNAP INC - A	47,130	43.17	2,034,602.10	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	5,740	164.43	943,828.20	
THE WALT DISNEY CO.	92,662	128.35	11,893,167.70	
TWITTER INC	40,760	50.44	2,055,934.40	
VIACOMCBS INC - CLASS B	31,833	29.28	932,070.24	
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	96.16	651,003.20	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,278	154.72	507,172.16	
AMAZON.COM INC	21,710	3,204.40	69,567,524.00	
AUTOZONE INC	1,147	1,183.16	1,357,084.52	
BEST BUY CO INC	12,554	118.21	1,484,008.34	
BOOKING HOLDINGS INC	2,083	1,823.55	3,798,454.65	
BURLINGTON STORES INC	3,120	208.01	648,991.20	
CARMAX INC	7,819	90.95	711,138.05	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	13,000	215.44	2,800,720.00	
DOLLAR TREE INC	11,976	95.47	1,143,348.72	
EBAY INC	37,547	53.79	2,019,653.13	
EXPEDIA INC	7,412	102.72	761,360.64	
GENUINE PARTS CO	7,831	98.78	773,546.18	
HOME DEPOT INC	55,130	283.00	15,601,790.00	
LKQ CORP	16,840	32.88	553,699.20	
LOWE'S COS INC	38,762	172.14	6,672,490.68	
MERCADOLIBRE INC	2,290	1,312.16	3,004,846.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,685	466.43	1,718,794.55	
ROSS STORES INC	17,422	95.43	1,662,581.46	
TARGET CORP	25,620	160.23	4,105,092.60	
TIFFANY & CO	5,820	123.54	719,002.80	
TJX COMPANIES INC	61,176	57.02	3,488,255.52	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,990	139.82	837,521.80	
ULTA BEAUTY INC	3,150	235.11	740,596.50	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,350	265.85	890,597.50	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,579	374.60	8,458,093.40	
KROGER CO	42,890	32.76	1,405,076.40	
SYSCO CORP	24,036	64.80	1,557,532.80	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,972	38.04	1,368,374.88	
WALMART INC	72,632	143.85	10,448,113.20	
ALTRIA GROUP INC	94,588	39.08	3,696,499.04	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,963	51.87	1,502,310.81	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,270	74.40	1,136,088.00	
BUNGE LTD	5,457	56.02	305,701.14	
CAMPBELL SOUP CO	8,995	48.55	436,707.25	
COCA-COLA CO/THE	208,612	50.52	10,539,078.24	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,620	39.03	414,498.60	
CONAGRA BRANDS INC	27,710	38.00	1,052,980.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,700	179.46	1,561,302.00	
GENERAL MILLS INC	29,749	61.78	1,837,893.22	
HERSHEY CO/THE	6,795	146.34	994,380.30	
HORMEL FOODS CORP	13,870	49.61	688,090.70	
INGREDION INC	3,120	76.61	239,023.20	
JM SMUCKER CO/THE	6,390	115.54	738,300.60	
KELLOGG CO	14,738	66.76	983,908.88	
KEURIG DR PEPPER INC	19,450	29.21	568,134.50	
KRAFT HEINZ CO/THE	36,031	31.37	1,130,292.47	
LAMB WESTON HOLDING INC	8,960	72.11	646,105.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,035	196.46	1,185,636.10	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,590	35.68	413,531.20	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	72,705	56.61	4,115,830.05	
MONSTER BEVERAGE CORP	20,350	80.39	1,635,936.50	
PEPSICO INC	70,881	139.56	9,892,152.36	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	79,538	74.45	5,921,604.10	
TYSON FOODS INC-CL A	14,326	60.05	860,276.30	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,740	91.91	1,079,023.40	
CLOROX COMPANY	6,206	211.14	1,310,334.84	
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,380	79.34	3,283,089.20	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,390	235.23	2,679,269.70	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,353	136.88	2,375,278.64	
PROCTER & GAMBLE CO	126,909	142.38	18,069,303.42	
ABBOTT LABORATORIES	90,936	107.79	9,801,991.44	
ABIOMED INC	2,390	281.42	672,593.80	

ALIGN TECHNOLOGY INC	3,960	469.56	1,859,457.60	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,934	99.38	689,100.92	
ANTHEM INC	12,821	310.76	3,984,253.96	
BAXTER INTERNATIONAL INC	25,169	81.09	2,040,954.21	
BECTON DICKINSON AND CO	14,777	240.28	3,550,617.56	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,578	37.17	2,660,554.26	
CARDINAL HEALTH INC	13,565	49.34	669,297.10	
CENTENE CORP	30,987	67.42	2,089,143.54	
CERNER CORP	16,450	73.72	1,212,694.00	
CIGNA CORP	18,770	184.49	3,462,877.30	
COOPER COS INC/THE	2,840	356.45	1,012,318.00	
CVS HEALTH CORP	66,548	60.25	4,009,517.00	
DANAHER CORP	32,629	232.66	7,591,463.14	
DAVITA INC	3,068	91.05	279,341.40	
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	49.15	565,323.30	
DEXCOM INC	5,010	411.00	2,059,110.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	31,100	80.41	2,500,751.00	
HCA HEALTHCARE INC	13,815	136.59	1,886,990.85	
HENRY SCHEIN INC	8,370	67.79	567,402.30	
HOLOGIC INC	11,868	67.91	805,955.88	
HUMANA INC	6,815	444.31	3,027,972.65	
IDEXX LABORATORIES INC	4,270	429.66	1,834,648.20	
INSULET CORP	3,390	249.39	845,432.10	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,940	735.48	4,368,751.20	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,815	207.49	999,064.35	
MASIMO CORP	2,870	244.77	702,489.90	
MCKESSON CORP	7,824	156.41	1,223,751.84	
MEDTRONIC PLC	68,478	111.42	7,629,818.76	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,380	212.55	718,419.00	
QUEST DIAGNOSTICS	6,396	127.13	813,123.48	
RESMED INC	7,260	183.03	1,328,797.80	
STERIS PLC	4,210	187.54	789,543.40	
STRYKER CORP	17,243	221.90	3,826,221.70	
TELADOC HEALTH INC	3,930	216.32	850,137.60	
TELEFLEX INC	2,650	366.24	970,536.00	

UNITEDHEALTH GROUP INC	48,530	330.60	16,044,018.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,440	115.58	513,175.20	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,944	172.56	853,136.64	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,900	296.85	2,048,265.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,640	281.93	1,026,225.20	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,062	142.71	1,578,658.02	
ABBVIE INC	90,166	84.34	7,604,600.44	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,720	106.17	1,775,162.40	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,740	121.61	1,306,091.40	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,580	131.84	867,507.20	
AMGEN INC	30,091	227.16	6,835,471.56	
AVANTOR INC	22,000	24.90	547,800.00	
BEIGENE LTD-ADR	2,040	299.00	609,960.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,150	581.71	668,966.50	
BIOGEN INC	8,153	265.00	2,160,545.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,200	77.53	713,276.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	115,265	60.13	6,930,884.45	
CATALENT INC	8,690	94.02	817,033.80	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,836	31.38	653,833.68	
ELI LILLY & CO	44,244	142.38	6,299,460.72	
EXACT SCIENCES CORP	8,580	109.70	941,226.00	
GILEAD SCIENCES INC	63,884	60.79	3,883,508.36	
ILLUMINA INC	7,780	323.55	2,517,219.00	
INCYTE CORP	8,950	89.69	802,725.50	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,080	47.34	240,487.20	
IQVIA HOLDINGS INC	9,503	167.47	1,591,467.41	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,140	150.26	471,816.40	
JOHNSON & JOHNSON	134,821	145.24	19,581,402.04	
MERCK & CO. INC.	128,953	79.83	10,294,317.99	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,275	1,053.20	1,342,830.00	
MODERNA INC	15,100	70.53	1,065,003.00	
MYLAN NV	26,285	15.69	412,411.65	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,230	99.01	418,812.30	
PERKINELMER INC	6,460	124.45	803,947.00	
PERRIGO CO PLC	7,139	45.62	325,681.18	

PFIZER INC	283,760	38.18	10,833,956.80	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,150	579.81	2,986,021.50	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,730	137.73	513,732.90	
SEAGEN INC	6,080	196.92	1,197,273.60	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	59,050	9.35	552,117.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,234	480.17	9,715,759.78	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,190	211.58	2,790,740.20	
WATERS CORP	3,036	221.95	673,840.20	
ZOETIS INC	24,180	163.49	3,953,188.20	
BANK OF AMERICA CORP	398,809	24.90	9,930,344.10	
CITIGROUP INC	106,077	43.95	4,662,084.15	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,680	29.13	689,798.40	
COMERICA INC	7,850	46.39	364,161.50	
EAST WEST BANCORP INC	7,460	38.36	286,165.60	
FIFTH THIRD BANCORP	34,439	24.42	841,000.38	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,440	130.98	1,105,471.20	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	50,560	10.47	529,363.20	
JPMORGAN CHASE & CO	155,760	103.81	16,169,445.60	
KEYCORP	41,558	13.45	558,955.10	
M & T BANK CORP	7,243	106.12	768,627.16	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	16,310	11.44	186,586.40	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,600	114.81	2,594,706.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	41,044	13.78	565,586.32	
SIGNATURE BANK	3,150	84.57	266,395.50	
SVB FINANCIAL GROUP	2,420	296.38	717,239.60	
TRUIST FINANCIAL CORP	68,460	43.94	3,008,132.40	
US BANCORP	67,861	40.66	2,759,228.26	
WELLS FARGO & CO	198,780	23.28	4,627,598.40	
ZIONS BANCORP NA	9,240	33.20	306,768.00	
ALLY FINANCIAL INC	20,430	29.08	594,104.40	
AMERICAN EXPRESS CO	34,974	100.98	3,531,674.52	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,520	170.39	1,110,942.80	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,500	41.15	390,925.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	42,962	37.67	1,618,378.54	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,810	212.71	15,061,995.10	

BLACKROCK INC	7,760	637.31	4,945,525.60	
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	36,200	54.64	1,977,968.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,715	77.99	1,849,532.85	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,170	27.46	196,888.20	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,300	81.72	514,836.00	
CME GROUP INC	18,230	163.86	2,987,167.80	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,630	68.00	994,840.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	23,170	20.59	477,070.30	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	328.48	525,568.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	15,725	23.22	365,134.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,618	205.04	3,407,354.72	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,430	98.95	2,813,148.50	
INVESCO LTD	22,157	13.98	309,754.86	
KKR & CO INC -A	28,560	37.40	1,068,144.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,060	558.91	1,151,354.60	
MOODY'S CORP	8,267	271.88	2,247,631.96	
MORGAN STANLEY	68,913	51.87	3,574,517.31	
MSCI INC	4,540	350.55	1,591,497.00	
NASDAQ INC	5,835	129.12	753,415.20	
NORTHERN TRUST CORP	10,690	84.41	902,342.90	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,360	81.11	434,749.60	
S&P GLOBAL INC	12,272	337.43	4,140,940.96	
SCHWAB (CHARLES) CORP	76,473	40.35	3,085,685.55	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,725	52.03	401,931.75	
STATE STREET CORP	18,797	65.31	1,227,632.07	
SYNCHRONY FINANCIAL	28,380	27.75	787,545.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,015	148.10	1,779,421.50	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	60.48	263,692.80	
VOYA FINANCIAL INC	5,580	52.54	293,173.20	
AFLAC INC	35,714	37.85	1,351,774.90	
ALLEGHANY CORP	820	596.89	489,449.80	
ALLSTATE CORP	16,523	91.25	1,507,723.75	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,850	75.81	367,678.50	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,685	32.38	1,446,900.30	
AON PLC	12,042	207.31	2,496,427.02	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,685	31.81	689,799.85	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,000	107.92	1,079,200.00	
ASSURANT INC	3,300	125.99	415,767.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,360	34.24	217,766.40	
BROWN & BROWN INC	10,380	46.72	484,953.60	
CHUBB LTD	23,905	129.02	3,084,223.10	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,940	77.40	691,956.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	231.00	274,890.00	
EVEREST RE GROUP LTD	2,314	214.02	495,242.28	
FNF GROUP	15,131	32.94	498,415.14	
GLOBE LIFE INC	5,426	86.14	467,395.64	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,482	40.61	628,724.02	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,243	37.05	305,403.15	
LOEWS CORP	10,835	36.23	392,552.05	
MARKEL CORP	795	1,027.00	816,465.00	
MARSH & MCLENNAN COS	25,933	113.70	2,948,582.10	
METLIFE INC	41,615	40.94	1,703,718.10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,700	43.52	683,264.00	
PROGRESSIVE CORP	29,580	94.62	2,798,859.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,602	68.73	1,415,975.46	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,610	108.30	390,963.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,437	178.22	434,322.14	
TRAVELERS COS INC/THE	13,654	125.97	1,719,994.38	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,918	209.75	1,451,050.50	
WR BERKLEY CORP	7,264	65.72	477,390.08	
CBRE GROUP INC - A	16,420	46.66	766,157.20	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	3.77	185,484.00	
JONES LANG LASALLE INC	2,800	111.86	313,208.00	
ACCENTURE PLC-CL A	32,708	229.70	7,513,027.60	
ADOBE INC	24,709	488.50	12,070,346.50	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,840	106.75	943,670.00	
ANSYS INC	4,560	330.22	1,505,803.20	
AUTODESK INC	11,180	254.42	2,844,415.60	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21,851	149.20	3,260,169.20	
AVALARA INC	4,050	154.51	625,765.50	

BLACK KNIGHT INC	6,530	93.31	609,314.30	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,490	79.05	592,084.50	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	6,100	145.73	888,953.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	13,940	112.05	1,561,977.00	
CDK GLOBAL INC	5,890	46.41	273,354.90	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,170	120.47	743,299.90	
CITRIX SYSTEMS INC	6,348	122.71	778,994.82	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	27,918	74.12	2,069,282.16	
COUPA SOFTWARE INC	3,410	302.00	1,029,820.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,680	135.42	769,185.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,090	108.44	226,639.60	
DATADOG INC-CLASS A	5,760	102.08	587,980.80	
DOCUSIGN INC	8,840	219.82	1,943,208.80	
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	19.72	211,201.20	
DYNATRACE INC	6,630	43.32	287,211.60	
EPAM SYSTEMS INC	3,010	339.05	1,020,540.50	
FAIR ISAAC CORP	1,620	435.60	705,672.00	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	31,478	144.40	4,545,423.20	
FISERV INC	28,924	101.18	2,926,530.32	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,540	259.20	1,176,768.00	
FORTINET INC	6,710	130.38	874,849.80	
GARTNER INC	4,890	128.13	626,555.70	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,359	176.99	2,718,389.41	
GODADDY INC-CLASS A	9,240	74.87	691,798.80	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,370	101.74	444,603.80	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,282	116.00	5,252,712.00	
INTUIT INC	13,356	334.42	4,466,513.52	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,240	158.31	671,234.40	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,620	85.80	567,996.00	
MASTERCARD INC	45,820	329.61	15,102,730.20	
MICROSOFT CORP	369,044	216.23	79,798,384.12	
MONGODB INC	2,470	248.00	612,560.00	
NORTONLIFELOCK INC	28,405	20.84	591,960.20	
OKTA INC	5,930	219.51	1,301,694.30	
ORACLE CORP	105,213	59.90	6,302,258.70	

PALO ALTO NETWORKS INC	5,080	236.54	1,201,623.20	
PAYCHEX INC	17,382	85.03	1,477,991.46	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,590	388.65	1,006,603.50	
PAYPAL HOLDINGS INC	57,227	203.04	11,619,370.08	
PTC INC	5,940	89.25	530,145.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,000	284.75	1,139,000.00	
SALESFORCE.COM INC	46,135	250.52	11,557,740.20	
SERVICENOW INC	9,850	514.01	5,062,998.50	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	17,030	28.76	489,782.80	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,300	265.05	344,565.00	
SPLUNK INC	8,490	216.51	1,838,169.90	
SQUARE INC - A	18,530	176.77	3,275,548.10	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,900	65.19	710,571.00	
SYNOPSYS INC	7,237	226.74	1,640,917.38	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,080	619.91	1,289,412.80	
TWILIO INC - A	6,210	306.10	1,900,881.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,030	404.40	820,932.00	
VERISIGN INC	4,860	200.80	975,888.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	86,362	198.01	17,100,539.62	
VMWARE INC	4,435	149.20	661,702.00	
WESTERN UNION CO	24,501	21.97	538,286.97	
WIX.COM LTD	2,700	271.87	734,049.00	
WORKDAY INC-CLASS A	8,880	224.14	1,990,363.20	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,195	511.52	4,191,906.40	
ZSCALER INC	3,600	147.05	529,380.00	
AMPHENOL CORP-CL A	15,980	119.75	1,913,605.00	
APPLE INC	887,768	115.04	102,128,830.72	
ARISTA NETWORKS INC	2,870	214.11	614,495.70	
ARROW ELECTRONICS INC	3,370	83.49	281,361.30	
CDW CORP/DE	6,680	130.00	868,400.00	
CISCO SYSTEMS INC	215,600	38.82	8,369,592.00	
COGNEX CORP	8,920	69.93	623,775.60	
CORNING INC	36,448	35.56	1,296,090.88	
DELL TECHNOLOGIES -C	10,272	68.18	700,344.96	
F5 NETWORKS INC	2,385	128.36	306,138.60	

FLIR SYSTEMS INC	8,145	36.16	294,523.20	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	71,155	9.48	674,549.40	
HP INC	78,505	19.12	1,501,015.60	
IPG PHOTONICS CORP	1,840	200.18	368,331.20	
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	22.29	411,317.37	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,550	107.88	1,030,254.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,195	174.78	1,607,102.10	
NETAPP INC	10,616	46.89	497,784.24	
SEAGATE TECHNOLOGY	9,694	50.74	491,873.56	
TE CONNECTIVITY LTD	15,865	106.30	1,686,449.50	
TRIMBLE INC	13,610	50.08	681,588.80	
WESTERN DIGITAL CORP	17,778	41.72	741,698.16	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,910	303.72	883,825.20	
AT&T INC	363,987	27.82	10,126,118.34	
CENTURYLINK INC	39,606	9.61	380,613.66	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	20.65	156,630.25	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,111	20.35	409,258.85	
T-MOBILE US INC	28,329	112.38	3,183,613.02	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	211,157	57.96	12,238,659.72	
AES CORP	34,668	20.65	715,894.20	
ALLIANT ENERGY CORP	12,340	56.67	699,307.80	
AMEREN CORPORATION	12,032	83.39	1,003,348.48	
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,748	91.88	2,365,726.24	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,345	154.08	1,439,877.60	
ATMOS ENERGY CORP	7,060	97.69	689,691.40	
CENTERPOINT ENERGY INC	24,962	22.23	554,905.26	
CMS ENERGY CORP	16,110	65.85	1,060,843.50	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,076	81.60	1,311,801.60	
DOMINION ENERGY INC	42,691	81.14	3,463,947.74	
DTE ENERGY COMPANY	9,308	125.15	1,164,896.20	
DUKE ENERGY CORP	37,386	92.78	3,468,673.08	
EDISON INTERNATIONAL	20,859	60.49	1,261,760.91	
ENTERGY CORP	9,367	108.95	1,020,534.65	
ESSENTIAL UTILITIES INC	14,140	44.50	629,230.00	
EVERGY INC	12,630	56.37	711,953.10	

EVERSOURCE ENERGY	17,950	91.97	1,650,861.50	
EXELON CORP	52,046	42.20	2,196,341.20	
FIRSTENERGY CORP	26,905	33.30	895,936.50	
NEXTERA ENERGY INC	24,925	303.07	7,554,019.75	
NISOURCE INC	19,580	24.31	475,989.80	
NRG ENERGY INC	10,000	33.67	336,700.00	
OGE ENERGY CORP	12,270	33.16	406,873.20	
P G & E CORP	54,000	10.25	553,500.00	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	86.73	384,127.17	
PPL CORP	36,218	28.67	1,038,370.06	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	26,338	60.92	1,604,510.96	
SEMPRA ENERGY	14,107	133.86	1,888,363.02	
SOUTHERN CO	53,665	60.85	3,265,515.25	
UGI CORP	12,640	35.86	453,270.40	
VISTRA CORP	20,980	19.28	404,494.40	
WEC ENERGY GROUP INC	15,380	102.16	1,571,220.80	
XCEL ENERGY INC	26,384	71.47	1,885,664.48	
ADVANCED MICRO DEVICES	60,100	81.96	4,925,796.00	
ANALOG DEVICES INC	18,340	124.20	2,277,828.00	
APPLIED MATERIALS INC	45,953	60.95	2,800,835.35	
BROADCOM INC	20,360	372.72	7,588,579.20	
INTEL CORP	216,462	48.20	10,433,468.40	
KLA CORP	8,429	203.17	1,712,519.93	
LAM RESEARCH CORP	7,567	353.92	2,678,112.64	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,974	41.43	1,490,402.82	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,220	72.87	1,036,211.40	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,844	112.52	1,332,686.88	
MICRON TECHNOLOGY INC	58,507	52.85	3,092,094.95	
NVIDIA CORP	31,510	543.61	17,129,151.10	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,917	137.18	2,046,314.06	
ON SEMICONDUCTOR CORP	21,090	26.16	551,714.40	
QORVO INC	6,090	135.70	826,413.00	
QUALCOMM INC	57,622	128.88	7,426,323.36	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,320	149.76	1,246,003.20	
TERADYNE INC	8,220	92.00	756,240.00	

	TEXAS INSTRUMENTS INC	46,902	149.96	7,033,423.92	
	XILINX INC	11,675	116.82	1,363,873.50	
米ドル小計		15,789,921		1,542,802,997.86 (161,531,473,875)	
加ドル	CAMECO CORP	19,892	12.76	253,821.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	57,384	22.43	1,287,123.12	
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	4.88	269,293.04	
	ENBRIDGE INC	102,937	37.99	3,910,576.63	
	IMPERIAL OIL LTD	16,232	17.71	287,468.72	
	INTER PIPELINE LTD	24,540	12.76	313,130.40	
	KEYERA CORP	12,200	20.33	248,026.00	
	PARKLAND CORP	7,370	37.01	272,763.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,932	28.55	826,008.60	
	SUNCOR ENERGY INC	80,249	16.49	1,323,306.01	
	TC ENERGY CORP	49,663	55.36	2,749,343.68	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,625	104.10	1,210,162.50	
	B2GOLD CORP	55,700	8.84	492,388.00	
	BARRICK GOLD CORP	94,134	35.21	3,314,458.14	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	54.75	438,000.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	9,775	181.22	1,771,425.50	
	KINROSS GOLD CORP	61,865	11.28	697,837.20	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,580	61.26	770,650.80	
	LUNDIN MINING CORP	35,450	8.29	293,880.50	
	NUTRIEN LTD	28,588	54.57	1,560,047.16	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,120	43.71	486,055.20	
	SSR MINING INC	10,000	25.26	252,600.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	18.19	461,571.25	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,945	63.76	1,590,493.20	
	YAMANA GOLD INC	50,700	7.62	386,334.00	
	CAE INC	14,195	24.01	340,821.95	
	WSP GLOBAL INC	5,830	88.78	517,587.40	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,810	81.16	471,539.60	
	THOMSON REUTERS CORP	8,516	107.63	916,577.08	
	AIR CANADA	7,190	16.99	122,158.10	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,608	137.98	5,051,171.84	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,915	413.50	2,859,352.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,248	71.95	953,193.60	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	29.59	294,420.50	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,698	74.58	1,170,756.84	
QUEBECOR INC -CL B	10,270	32.40	332,748.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	29,755	23.24	691,506.20	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,110	154.82	481,490.20	
DOLLARAMA INC	15,530	49.70	771,841.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	43,680	43.05	1,880,424.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	37.57	311,455.30	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,209	67.57	622,252.13	
METRO INC	12,590	62.65	788,763.50	
WESTON (GEORGE) LTD	4,918	96.09	472,570.62	
SAPUTO INC	9,620	34.68	333,621.60	
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	24.12	305,938.08	
CANOPY GROWTH CORP	11,710	25.94	303,757.40	
CRONOS GROUP INC	7,240	7.64	55,313.60	
BANK OF MONTREAL	33,551	84.09	2,821,303.59	
BANK OF NOVA SCOTIA	60,449	57.18	3,456,473.82	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,025	102.50	2,257,562.50	
NATIONAL BANK OF CANADA	18,230	67.03	1,221,956.90	
ROYAL BANK OF CANADA	72,539	96.29	6,984,780.31	
TORONTO-DOMINION BANK	92,380	60.53	5,591,761.40	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	66,629	44.52	2,966,323.08	
CI FINANCIAL CORP	9,990	17.65	176,323.50	
IGM FINANCIAL INC	3,335	32.50	108,387.50	
ONEX CORPORATION	4,665	61.79	288,250.35	
TMX GROUP LTD	3,030	134.31	406,959.30	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,460	370.21	540,506.60	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,894	28.28	421,202.32	
IA FINANCIAL CORP INC	6,525	49.05	320,051.25	
INTACT FINANCIAL CORP	8,055	143.80	1,158,309.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	106,081	19.21	2,037,816.01	
POWER CORP OF CANADA	23,289	26.77	623,446.53	
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,274	55.68	1,797,016.32	

	BLACKBERRY LTD	27,808	6.71	186,591.68	
	CGI INC	10,430	87.33	910,851.90	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	990	1,460.76	1,446,152.40	
	OPEN TEXT CORP	13,750	53.52	735,900.00	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	5,500	1,348.76	7,418,180.00	
	BCE INC	5,900	56.20	331,580.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,575	57.92	902,104.00	
	TELUS CORP	21,332	24.13	514,741.16	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	20.66	559,472.80	
	ALTAGAS LTD	11,770	17.22	202,679.40	
	ATCO LTD -CLASS I	4,130	39.93	164,910.90	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,320	33.80	247,416.00	
	EMERA INC	12,030	56.08	674,642.40	
	FORTIS INC	24,915	54.58	1,359,860.70	
	HYDRO ONE LTD	19,820	29.89	592,419.80	
加ドル小計		1,984,756		94,941,959.73 (7,562,127,092)	
ユーロ	ENI SPA	139,816	6.44	900,974.30	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	8.14	173,426.48	
	NESTE OYJ	22,830	49.00	1,118,670.00	
	OMV AG	7,890	22.00	173,580.00	
	REPSOL SA	81,149	5.82	472,611.77	
	TENARIS SA	19,915	4.42	88,203.53	
	TOTAL SE	125,907	28.08	3,535,468.56	
	VOPAK	3,530	46.53	164,250.90	
	AIR LIQUIDE SA	24,100	133.35	3,213,735.00	
	AKZO NOBEL	10,697	85.86	918,444.42	
	ARCELORMITTAL	35,962	12.45	447,798.82	
	ARKEMA	3,045	89.72	273,197.40	
	BASF SE	46,685	52.27	2,440,224.95	
	COVESTRO AG	9,190	43.98	404,176.20	
	CRH PLC	42,390	31.29	1,326,383.10	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,440	22.27	254,768.80	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	46.18	133,922.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	53.94	406,977.30	

KONINKLIJKE DSM NV	9,082	141.30	1,283,286.60	
LANXESS AG	5,195	48.33	251,074.35	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,840	34.48	408,243.20	
SOLVAY SA	3,231	76.72	247,882.32	
STORA ENSO OYJ-R SHS	29,305	13.07	383,162.87	
SYMRISE AG	6,400	114.05	729,920.00	
THYSSENKRUPP AG	19,305	4.67	90,231.57	
UMICORE	10,350	34.78	359,973.00	
UPM-KYMMENE OYJ	29,468	25.81	760,569.08	
VOESTALPINE AG	7,119	25.20	179,398.80	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	22.90	240,129.40	
AIRBUS GROUP SE	28,718	68.03	1,953,685.54	
ALSTOM	8,950	41.35	370,082.50	
ANDRITZ AG	3,810	29.84	113,690.40	
BOUYGUES SA	11,990	30.77	368,932.30	
BRENNTAG AG	6,735	55.20	371,772.00	
CNH INDUSTRIAL NV	61,720	7.26	448,580.96	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	28,726	35.37	1,016,038.62	
DASSAULT AVIATION SA	135	769.00	103,815.00	
EIFFAGE	3,250	70.18	228,085.00	
FERROVIAL SA	23,315	20.66	481,687.90	
GEA GROUP AG	6,680	30.12	201,201.60	
HOCHTIEF AG	1,490	70.50	105,045.00	
KINGSPAN GROUP PLC	7,880	76.00	598,880.00	
KION GROUP AG	3,820	71.68	273,817.60	
KNORR-BREMSE AG	2,970	102.60	304,722.00	
KONE OYJ-B	16,134	71.52	1,153,903.68	
LEGRAND SA	13,818	68.60	947,914.80	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	22,040	4.76	105,042.64	
MTU AERO ENGINES AG	2,510	169.30	424,943.00	
PRYSMIAN SPA	13,115	24.96	327,350.40	
SAFRAN SA	16,840	96.58	1,626,407.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,138	110.20	3,100,807.60	
SIEMENS AG-REG	38,976	109.66	4,274,108.16	
SIEMENS ENERGY AG	20,123	20.42	410,911.66	

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	25.34	297,998.40	
THALES SA	5,655	64.30	363,616.50	
VINCI SA	26,050	72.84	1,897,482.00	
WARTSILA OYJ ABP	21,180	7.43	157,536.84	
BUREAU VERITAS SA	14,440	20.46	295,442.40	
RANDSTAD NV	4,965	48.63	241,447.95	
TELEPERFORMANCE	2,760	263.50	727,260.00	
WOLTERS KLUWER	13,177	71.34	940,047.18	
ADP	1,740	89.20	155,208.00	
AENA SA	3,970	125.40	497,838.00	
ATLANTIA SPA	30,320	14.45	438,124.00	
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	8.49	101,418.36	
DEUTSCHE POST AG-REG	50,843	40.61	2,064,734.23	
FRAPORT AG	2,750	35.94	98,835.00	
GETLINK	24,830	12.85	319,065.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,335	63.93	1,108,226.55	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	48.46	139,564.80	
CONTINENTAL AG	5,955	101.15	602,348.25	
DAIMLER AG	42,742	48.40	2,068,712.80	
FAURECIA	4,660	37.88	176,520.80	
FERRARI NV	6,584	160.50	1,056,732.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	60,657	11.10	673,292.70	
MICHELIN (CGDE)-B	8,259	98.18	810,868.62	
PEUGEOT SA	27,870	16.50	459,855.00	
PIRELLI & C SPA	24,100	4.11	99,051.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	8,230	50.14	412,652.20	
RENAULT SA	10,857	24.77	268,927.89	
VALEO SA	12,380	28.01	346,763.80	
VOLKSWAGEN AG	1,951	147.10	286,992.10	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,153	139.06	1,272,816.18	
ADIDAS AG	9,631	281.80	2,714,015.80	
ESSILORLUXOTTICA	15,065	115.70	1,743,020.50	
HERMES INTERNATIONAL	1,587	825.00	1,309,275.00	
KERING	3,717	556.00	2,066,652.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,164	428.00	6,062,192.00	

MONCLER SPA	12,280	38.94	478,183.20	
PUMA SE	4,530	82.00	371,460.00	
SEB SA	1,300	149.00	193,700.00	
ACCOR SA	7,646	24.28	185,644.88	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,866	140.05	1,101,633.30	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	32.82	127,998.00	
SODEXO	4,090	61.68	252,271.20	
BOLLORE	47,430	3.20	151,965.72	
JC DECAUX SA	5,130	14.01	71,871.30	
PUBLICIS GROUPE	8,645	32.16	278,023.20	
SCOUT24 AG	5,880	72.25	424,830.00	
SES	21,670	7.21	156,284.04	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,110	34.58	72,963.80	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,800	80.90	388,320.00	
VIVENDI	45,820	25.43	1,165,202.60	
DELIVERY HERO SE	6,940	91.66	636,120.40	
INDITEX	52,245	24.19	1,263,806.55	
JUST EAT TAKEAWAY	6,500	101.20	657,800.00	
PROSUS	24,410	79.40	1,938,154.00	
ZALANDO SE	7,390	82.56	610,118.40	
CARREFOUR SA	31,793	13.85	440,333.05	
COLRUYT SA	2,305	53.20	122,626.00	
JERONIMO MARTINS	15,165	14.44	218,982.60	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	57,488	24.31	1,397,533.28	
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	5,840	8.51	49,745.12	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	37,201	48.51	1,804,620.51	
DANONE	32,214	51.12	1,646,779.68	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	31,170	9.26	288,758.88	
HEINEKEN HOLDING NV	6,325	71.15	450,023.75	
HEINEKEN NV	12,123	81.16	983,902.68	
KERRY GROUP PLC-A	8,460	108.40	917,064.00	
PERNOD-RICARD SA	11,126	147.90	1,645,535.40	
REMY COINTREAU	1,360	153.40	208,624.00	
BEIERSDORF AG	5,415	99.32	537,817.80	
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	83.25	373,792.50	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	9,853	90.62	892,878.86	
L'OREAL	12,816	288.60	3,698,697.60	
UNILEVER NV	74,335	51.10	3,798,518.50	
BIOMERIEUX	2,140	126.00	269,640.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	118.70	225,530.00	
DIASORIN SPA	1,330	188.00	250,040.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,483	68.64	788,193.12	
FRESENIUS SE & CO KGAA	22,885	34.37	786,557.45	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	46,220	42.16	1,948,866.30	
ORPEA	2,780	91.66	254,814.80	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,810	383.40	693,954.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,200	38.13	465,247.00	
ARGENX SE	2,260	209.00	472,340.00	
BAYER AG-REG	51,024	42.42	2,164,693.20	
EUROFINS SCIENTIFIC	595	694.80	413,406.00	
GALAPAGOS NV	2,690	107.75	289,847.50	
GRIFOLS SA	16,550	25.09	415,239.50	
IPSEN	2,270	80.00	181,600.00	
MERCK KGAA	6,090	131.85	802,966.50	
ORION OYJ-CLASS B	5,150	38.07	196,060.50	
QIAGEN N.V.	12,144	41.95	509,440.80	
RECORDATI SPA	6,540	47.75	312,285.00	
SANOFI	57,496	82.94	4,768,718.24	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,710	328.00	560,880.00	
UCB SA	6,838	90.48	618,702.24	
ABN AMRO BANK NV-CVA	22,380	7.62	170,535.60	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	309,673	2.49	772,634.13	
BANCO SANTANDER SA	844,049	1.74	1,472,021.45	
BANKINTER SA	40,610	3.42	138,967.42	
BNP PARIBAS	59,472	33.50	1,992,312.00	
CAIXABANK S.A	150,050	1.71	257,635.85	
COMMERZBANK AG	48,544	4.57	222,040.25	
CREDIT AGRICOLE SA	70,292	7.51	528,314.67	
ERSTE GROUP BANK AG	12,928	18.34	237,099.52	
FINECOBANK SPA	26,120	11.56	301,947.20	

ING GROEP NV-CVA	193,135	6.59	1,272,952.78	
INTESA SANPAOLO	829,593	1.56	1,295,160.59	
KBC GROEP NV	14,349	45.68	655,462.32	
MEDIOBANCA SPA	33,950	6.56	222,983.60	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	13.34	103,518.40	
SOCIETE GENERALE	41,059	12.75	523,502.25	
UNICREDIT SPA	113,836	6.94	790,818.69	
AMUNDI SA	3,300	61.65	203,445.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	106,645	8.12	865,957.40	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,350	137.75	1,425,712.50	
EURAZEO SE	1,877	43.54	81,724.58	
EXOR NV	5,564	48.65	270,688.60	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,252	76.42	477,777.84	
NATIXIS	49,540	2.10	104,281.70	
SOFINA	800	235.50	188,400.00	
WENDEL	1,690	83.00	140,270.00	
AEGON NV	77,949	2.49	194,794.55	
AGEAS	9,104	37.00	336,848.00	
ALLIANZ SE-REG	21,248	163.42	3,472,348.16	
ASSICURAZIONI GENERALI	49,048	12.06	591,518.88	
AXA SA	103,232	14.97	1,545,589.50	
CNP ASSURANCES	10,340	10.75	111,155.00	
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	129.60	395,928.00	
MAPFRE SA	59,864	1.34	80,756.53	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,896	211.50	1,458,504.00	
NN GROUP NV	14,100	32.55	458,955.00	
POSTE ITALIANE SPA	25,780	7.59	195,721.76	
SAMPO OYJ-A SHS	24,259	35.39	858,526.01	
SCOR SE	7,452	23.68	176,463.36	
AROUNDTOWN SA	56,420	4.43	249,940.60	
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,170	43.58	704,688.60	
LEG IMMOBILIEN AG	3,800	120.06	456,228.00	
VONOVIA SE	27,608	56.52	1,560,404.16	
ADYEN NV	900	1,568.50	1,411,650.00	
AMADEUS IT GROUP SA	23,150	46.66	1,080,179.00	

ATOS SE	5,240	65.20	341,648.00	
CAP GEMINI SA	8,799	105.80	930,934.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,260	148.15	1,075,569.00	
EDENRED	13,336	42.30	564,112.80	
NEMETSCHEK SE	3,020	60.15	181,653.00	
NEXI SPA	20,200	14.92	301,384.00	
SAP SE	53,272	124.90	6,653,672.80	
TEAMVIEWER AG	7,050	40.19	283,339.50	
WORLDLINE SA	10,250	69.88	716,270.00	
NOKIA OYJ	301,566	3.60	1,085,939.16	
ALTICE EUROPE NV	34,400	4.23	145,684.00	
CELLNEX TELECOM SA	15,470	53.06	820,838.20	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	176,266	13.46	2,373,421.69	
ELISA OYJ	5,465	44.85	245,105.25	
ILIAD SA	566	164.05	92,852.30	
KONINKLIJKE KPN NV	194,906	2.40	468,164.21	
ORANGE S.A.	111,554	9.51	1,061,770.97	
PROXIMUS	8,290	16.33	135,417.15	
TELECOM ITALIA SPA	535,213	0.31	170,625.90	
TELECOM ITALIA-RSP	334,757	0.33	111,808.83	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	54,770	2.22	121,644.17	
TELEFONICA SA	267,639	3.07	822,989.92	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,700	32.26	216,142.00	
E.ON SE	119,489	9.52	1,138,491.19	
EDF	32,475	10.43	338,876.62	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,171	4.37	666,356.80	
ELIA GROUP SA/NV	1,600	87.00	139,200.00	
ENAGAS SA	12,350	19.71	243,418.50	
ENDESA SA	16,390	24.11	395,162.90	
ENEL SPA	413,917	7.56	3,132,937.77	
ENGIE	89,854	11.36	1,021,190.71	
FORTUM OYJ	27,245	17.38	473,654.32	
IBERDROLA SA	302,352	10.70	3,236,678.16	
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	17.76	269,099.52	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	16.06	308,769.30	

	RWE AG	31,835	33.20	1,056,922.00	
	SNAM SPA	119,980	4.34	521,193.12	
	SUEZ	20,969	15.68	328,898.76	
	TERNA SPA	77,357	5.98	462,594.86	
	UNIPER SE	11,740	27.04	317,449.60	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,224	17.35	524,386.40	
	VERBUND AG	2,780	52.15	144,977.00	
	ASML HOLDING NV	21,732	316.60	6,880,351.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	65,425	26.80	1,753,390.00	
	STMICROELECTRONICS NV	32,603	28.61	932,771.83	
ユーロ小計		9,895,315		193,622,372.64 (24,013,046,654)	
英ポンド	BP PLC	1,024,538	2.05	2,105,425.59	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	201,658	9.71	1,959,712.44	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	184,849	9.40	1,738,689.69	
	ANGLO AMERICAN PLC	62,234	19.84	1,234,971.49	
	ANTOFAGASTA PLC	25,070	10.38	260,226.60	
	BHP GROUP PLC	105,851	16.08	1,702,930.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	62.64	345,835.44	
	EVRAZ PLC	27,180	3.84	104,425.56	
	GLENCORE PLC	540,713	1.67	905,586.13	
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,079	23.75	263,126.25	
	MONDI PLC	20,970	15.93	334,156.95	
	RIO TINTO PLC	57,805	45.78	2,646,312.90	
	ASHTEAD GROUP PLC	24,840	29.75	738,990.00	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	175,515	4.58	803,858.70	
	BUNZL PLC	13,836	24.66	341,195.76	
	DCC PLC	5,200	50.28	261,456.00	
	FERGUSON PLC	11,232	80.72	906,647.04	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	222,780	1.32	295,963.23	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	98,015	2.43	238,862.55	
	SMITHS GROUP PLC	21,173	14.23	301,397.65	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	114.65	451,721.00	
	EXPERIAN PLC	44,268	29.70	1,314,759.60	
	INTERTEK GROUP PLC	8,415	59.96	504,563.40	

RELX PLC	100,565	16.35	1,644,237.75	
RENTOKIL INITIAL PLC	94,500	5.54	523,530.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	5.41	220,295.20	
BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	42.68	285,102.40	
BURBERRY GROUP PLC	23,124	14.88	344,085.12	
PERSIMMON PLC	13,570	25.93	351,870.10	
TAYLOR WIMPEY PLC	207,190	1.19	247,384.86	
COMPASS GROUP PLC	91,108	11.50	1,047,742.00	
GVC HOLDINGS PLC	30,970	10.04	310,938.80	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,283	42.01	389,978.83	
WHITBREAD PLC	10,770	23.86	256,972.20	
AUTO TRADER GROUP PLC	48,880	5.91	288,880.80	
INFORMA PLC	72,880	4.49	327,231.20	
PEARSON PLC	44,059	5.12	225,758.31	
WPP PLC	50,104	6.65	333,392.01	
JD SPORTS FASHION PLC	22,530	8.22	185,286.72	
KINGFISHER PLC	114,937	3.20	367,913.33	
NEXT PLC	6,767	63.28	428,215.76	
OCADO GROUP PLC	24,680	23.13	570,848.40	
SAINSBURY (J) PLC	97,801	2.08	204,110.68	
TESCO PLC	462,864	2.14	990,991.82	
WM MORRISON SUPERMARKETS	129,955	1.72	224,497.26	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,905	17.32	327,434.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	116,837	25.72	3,005,047.64	
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	19.74	151,800.60	
DIAGEO PLC	119,042	26.28	3,129,018.97	
IMPERIAL BRANDS PLC	51,242	13.00	666,146.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,225	70.00	2,535,750.00	
UNILEVER PLC	59,477	46.94	2,791,850.38	
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—	
SMITH & NEPHEW PLC	45,766	14.56	666,581.79	
ASTRAZENECA PLC	67,113	79.43	5,330,785.59	
GLAXOSMITHKLINE PLC	255,491	13.43	3,433,288.05	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	25.49	196,018.10	
BARCLAYS PLC	881,851	1.11	983,616.60	

	HSBC HOLDINGS PLC	1,037,241	3.21	3,333,692.57	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,635,236	0.29	1,064,578.86	
	NATWEST GROUP PLC	302,430	1.22	371,384.04	
	STANDARD CHARTERED PLC	131,430	3.99	524,931.42	
	3I GROUP PLC	50,419	10.67	537,970.73	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	14.14	184,102.80	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,937	84.38	1,429,144.06	
	M&G PLC	134,322	1.68	226,735.53	
	SCHRODERS PLC	6,901	28.00	193,228.00	
	ST JAMES'S PLACE PLC	32,650	9.37	305,930.50	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	2.42	301,463.87	
	ADMIRAL GROUP PLC	10,865	27.80	302,047.00	
	AVIVA PLC	199,265	2.78	554,155.96	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	2.82	207,566.56	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	329,201	1.97	649,842.77	
	PRUDENTIAL PLC	126,302	10.79	1,362,798.58	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	4.43	244,592.16	
	AVEVA GROUP PLC	3,440	46.02	158,308.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	57,710	6.94	400,507.40	
	HALMA PLC	16,450	24.44	402,038.00	
	BT GROUP PLC	471,052	1.04	492,484.86	
	VODAFONE GROUP PLC	1,300,728	1.12	1,464,619.72	
	NATIONAL GRID PLC	188,078	9.45	1,777,337.10	
	SEVERN TRENT PLC	11,503	25.32	291,255.96	
	SSE PLC	50,927	13.37	680,893.99	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	37,015	8.90	329,581.56	
英ポンド小計		14,692,166		70,538,609.52 (9,639,100,990)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	12,660	17.22	218,005.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	460	837.00	385,020.00	
	GIVAUDAN-REG	468	3,874.00	1,813,032.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	26,539	42.49	1,127,642.11	
	SIKA AG-REG	7,250	231.20	1,676,200.00	
	ABB LTD-REG	97,725	23.61	2,307,287.25	
	GEBERIT AG-REG	1,920	543.40	1,043,328.00	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	248.00	260,400.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,220	248.30	551,226.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	8,977	50.96	457,467.92	
	SGS SA-REG	333	2,380.00	792,540.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,570	188.10	483,417.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	28,129	63.00	1,772,127.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,670	208.30	347,861.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,150	39.84	125,496.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	175	2,010.00	351,750.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	7,485.00	329,340.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	81,400.00	488,400.00	
	NESTLE SA-REG	152,023	106.56	16,199,570.88	
	ALCON INC	25,204	56.46	1,423,017.84	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,191	236.20	753,714.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	450	997.00	448,650.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,633	575.00	2,088,975.00	
	NOVARTIS AG-REG	113,413	76.48	8,673,826.24	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	35,868	297.40	10,667,143.20	
	VIFOR PHARMA AG	2,520	112.80	284,256.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,500	88.50	132,750.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	128,868	9.87	1,272,958.10	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,750	43.80	514,650.00	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	1,050	855.60	898,380.00	
	UBS GROUP AG-REG	187,122	11.26	2,106,993.72	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	132.00	328,680.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,510	337.10	509,021.00	
	SWISS RE AG	15,149	67.98	1,029,829.02	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,871	315.10	2,480,152.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,291	79.60	341,563.60	
	TEMENOS AG	3,470	106.65	370,075.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,070	78.98	716,348.60	
	SWISSCOM AG-REG	1,514	469.80	711,277.20	
スイスフラン小計		907,303		66,482,371.68 (7,694,669,698)	
スウェーデンク	LUNDIN ENERGY AB	10,270	178.65	1,834,735.50	

ローナ	BOLIDEN AB	14,670	261.10	3,830,337.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	32,900	118.35	3,893,715.00	
	ALFA LAVAL AB	17,850	192.75	3,440,587.50	
	ASSA ABLOY AB-B	51,380	206.20	10,594,556.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	33,225	406.90	13,519,252.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,120	352.50	6,739,800.00	
	EPIROC AB-A	38,955	135.75	5,288,141.25	
	EPIROC AB-B	15,450	131.60	2,033,220.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	211.60	1,438,880.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,840	220.80	3,718,272.00	
	SANDVIK AB	57,840	174.95	10,119,108.00	
	SKANSKA AB-B SHS	19,210	181.40	3,484,694.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	190.50	3,792,664.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	70,800	183.45	12,988,260.00	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	137.05	2,004,904.45	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,585	205.20	2,787,642.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,170	98.98	2,491,326.60	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,910	703.40	4,860,494.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	37,258	158.05	5,888,626.90	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	435.70	1,843,011.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,140	681.80	5,549,852.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	34,255	272.70	9,341,338.50	
	NORDEA BANK ABP	171,022	70.55	12,065,602.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	78,050	83.64	6,528,102.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	91,910	77.82	7,152,436.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	42,600	149.50	6,368,700.00	
	EQT AB	12,440	175.30	2,180,732.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,060	241.70	2,431,502.00	
	INVESTOR AB-B SHS	21,615	565.60	12,225,444.00	
	KINNEVIK AB - B	12,405	376.30	4,668,001.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	421.80	1,678,764.00	
	ERICSSON LM-B SHS	146,815	108.45	15,922,086.75	
	HEXAGON AB-B SHS	15,580	667.60	10,401,208.00	
	TELE2 AB-B SHS	31,215	109.90	3,430,528.50	
	TELIA CO AB	112,830	36.18	4,082,189.40	

スウェーデンクローナ小計		1,319,918		210,618,715.15 (2,518,999,833)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	50,344	131.65	6,627,787.60	
	NORSK HYDRO A S	62,840	28.00	1,759,520.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,470	345.60	3,272,832.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	159.70	1,820,580.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	364.20	1,871,988.00	
	MOWI ASA	25,740	164.05	4,222,647.00	
	ORKLA ASA	38,170	91.22	3,481,867.40	
	DNB ASA	49,935	140.00	6,990,900.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,470	191.40	2,195,358.00	
	TELENOR ASA	43,115	153.70	6,626,775.50	
ノルウェークローネ小計		307,624		38,870,255.50 (439,622,589)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,350	656.80	3,513,880.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,675	391.50	4,570,762.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	9,950	1,062.00	10,566,900.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	195	9,490.00	1,850,550.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	338	10,285.00	3,476,330.00	
	DSV PANALPINA A S	10,880	1,045.00	11,369,600.00	
	PANDORA A/S	4,490	534.00	2,397,660.00	
	CARLSBERG AS-B	5,350	854.00	4,568,900.00	
	AMBU A/S-B	8,710	193.10	1,681,901.00	
	COLOPLAST-B	5,385	973.80	5,243,913.00	
	DEMANT A/S	4,410	217.10	957,411.00	
	GN STORE NORD A/S	6,950	479.70	3,333,915.00	
	GENMAB A/S	3,150	2,210.00	6,961,500.00	
	H LUNDBECK A/S	4,200	193.40	812,280.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	87,835	445.25	39,108,533.75	
	DANSKE BANK A/S	31,805	93.76	2,982,036.80	
	TRYG A/S	6,075	190.00	1,154,250.00	
	ORSTED A/S	9,960	974.40	9,705,024.00	
デンマーククローネ小計		216,708		114,255,347.05 (1,904,636,635)	
豪ドル	AMPOL LTD	14,105	25.84	364,473.20	

OIL SEARCH LTD	77,602	2.90	225,045.80	
ORIGIN ENERGY LTD	89,820	4.36	391,615.20	
SANTOS LTD	94,995	5.28	501,573.60	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	52,353	18.48	967,483.44	
BHP GROUP LTD	151,006	36.00	5,436,216.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	30,460	15.92	484,923.20	
EVOLUTION MINING LTD	87,400	5.68	496,432.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	91,055	16.72	1,522,439.60	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	23,075	36.00	830,700.00	
NEWCREST MINING LTD	41,779	30.71	1,283,033.09	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	40,200	15.80	635,160.00	
ORICA LIMITED	20,325	16.00	325,200.00	
RIO TINTO LTD	20,558	95.40	1,961,233.20	
SOUTH32 LTD	255,347	2.22	566,870.34	
CIMIC GROUP LTD	4,887	22.43	109,615.41	
BRAMBLES LTD	78,698	10.26	807,441.48	
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	4.00	294,280.00	
QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.55	200,200.00	
SYDNEY AIRPORT	66,676	5.99	399,389.24	
TRANSURBAN GROUP	134,769	13.99	1,885,418.31	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,900	32.21	898,659.00	
CROWN RESORTS LTD	19,095	8.71	166,317.45	
TABCORP HOLDINGS LTD	97,874	3.46	338,644.04	
REA GROUP LTD	3,030	126.04	381,901.20	
SEEK LTD	17,930	23.01	412,569.30	
WESFARMERS LTD	59,585	46.92	2,795,728.20	
COLES GROUP LTD	62,585	17.19	1,075,836.15	
WOOLWORTHS GROUP LTD	68,372	38.82	2,654,201.04	
COCA-COLA AMATIL LTD	30,530	10.75	328,197.50	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,246	8.98	325,489.08	
COCHLEAR LTD	2,917	224.99	656,295.83	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,995	64.67	581,706.65	
SONIC HEALTHCARE LTD	26,720	36.40	972,608.00	
CSL LTD	23,252	294.82	6,855,154.64	
AUST AND NZ BANKING GROUP	137,689	19.78	2,723,488.42	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	90,157	69.90	6,301,974.30	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	156,893	19.53	3,064,120.29	
	WESTPAC BANKING CORP	186,991	18.78	3,511,690.98	
	AMP LTD	156,627	1.35	212,229.58	
	ASX LTD	10,195	81.32	829,057.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,714	136.18	2,276,112.52	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	7,680	59.27	455,193.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	106,375	4.84	514,855.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	142,760	2.67	381,169.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	68,340	8.86	605,492.40	
	SUNCORP GROUP LTD	70,376	8.75	615,790.00	
	AFTERPAY LTD	11,530	102.13	1,177,558.90	
	COMPUTERSHARE LTD	25,050	12.89	322,894.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,500	29.17	247,945.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	231,884	2.73	633,043.32	
	TPG TELECOM LTD	21,450	7.16	153,582.00	
	AGL ENERGY LTD	35,761	13.15	470,257.15	
	APA GROUP	66,218	10.72	709,856.96	
	AUSNET SERVICES	117,310	2.03	238,139.30	
豪ドル小計		3,646,211		63,576,502.01 (4,745,985,875)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	7.36	415,950.40	
	A2 MILK CO LTD	38,820	15.37	596,663.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,340	35.86	1,123,852.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	19,940	14.74	293,915.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.62	353,785.74	
	MERCURY NZ LTD	34,000	5.34	181,560.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	77,080	5.54	427,023.20	
ニュージーランドドル小計		334,272		3,392,750.74 (237,628,261)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,708	46.40	6,482,451.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	76,500	106.20	8,124,300.00	
	MTR CORP	82,000	39.05	3,202,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	120,000	54.25	6,510,000.00	
	SANDS CHINA LTD	130,600	29.35	3,833,110.00	

	SJM HOLDINGS LTD	91,000	8.52	775,320.00	
	WYNN MACAU LTD	93,800	11.70	1,097,460.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	24.65	1,673,735.00	
	WH GROUP LTD	530,500	6.33	3,358,065.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	30,000	29.55	886,500.00	
	BANK OF EAST ASIA	76,040	14.36	1,091,934.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	207,500	22.05	4,575,375.00	
	HANG SENG BANK LTD	44,700	121.70	5,439,990.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	60,400	368.00	22,227,200.00	
	AIA GROUP LTD	616,790	78.15	48,202,138.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	127,708	37.55	4,795,435.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	19.74	1,539,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	29.05	2,117,774.05	
	KERRY PROPERTIES LTD	31,950	19.64	627,498.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	38.20	2,775,841.20	
	SINO LAND CO	143,050	9.81	1,403,320.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	69,980	98.00	6,858,040.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,017	37.50	1,125,637.50	
	SWIRE PROPERTIES LTD	66,000	20.50	1,353,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	31.15	1,987,370.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	214,000	10.22	2,187,080.00	
	PCCW LTD	231,000	4.85	1,120,350.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	42,000	37.15	1,560,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	75,500	73.00	5,511,500.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	159,500	7.94	1,266,430.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	592,655	11.34	6,720,707.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	40.65	2,235,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,800	85.85	1,528,130.00	
香港ドル小計		4,510,965		164,193,563.45 (2,218,255,042)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	89,860	4.51	405,268.60	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	86,700	3.68	319,056.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	3.58	192,962.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	352,600	0.67	236,242.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	18.91	113,460.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	120,260	4.24	509,902.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	88,615	21.55	1,909,653.25	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	167,240	8.81	1,473,384.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,500	20.08	1,174,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,700	9.06	359,682.00	
	CAPITALAND LTD	145,700	2.71	394,847.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	28,900	7.04	203,456.00	
	UOL GROUP LTD	26,150	6.64	173,636.00	
	VENTURE CORP LTD	16,600	20.60	341,960.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	470,580	2.12	997,629.60	
シンガポールドル小計		1,751,305		8,805,819.25 (679,280,896)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	36,890	12.60	464,814.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	400.00	480,000.00	
	BANK HAPOALIM BM	60,335	20.75	1,251,951.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	16.84	959,964.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,400	10.10	650,440.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	69.99	573,918.00	
	AZRIELI GROUP LTD	2,740	168.40	461,416.00	
	NICE LTD	3,355	773.50	2,595,092.50	
イスラエルシュケル小計		234,125		7,437,595.95 (230,714,226)	
合　　計		55,590,589		223,415,541,666 (223,415,541,666)	

(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	453,654.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,530	1,048,326.20	
		AMERICAN TOWER CORP	22,659	5,386,497.48	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	440,307.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,785	989,185.15	

		BOSTON PROPERTIES INC	8,457	656,855.19	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,330	492,438.70	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,200	3,359,564.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,105	2,152,423.00	
		DUKE REALTY CORPORATION	19,465	758,161.75	
		EQUINIX INC	4,518	3,510,621.54	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,990	622,077.30	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,430	945,643.30	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,140	638,142.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,100	842,486.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,945	302,660.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,055	807,142.35	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	39,369	458,255.16	
		INVITATION HOMES INC	30,340	881,983.80	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	326,541.25	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,900	583,770.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,520	655,279.20	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,590	302,368.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	345,178.80	
		PROLOGIS INC	37,598	3,881,617.52	
		PUBLIC STORAGE	8,079	1,904,381.88	
		REALTY INCOME CORP	18,530	1,125,697.50	
		REGENCY CENTERS CORP	6,695	256,351.55	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,620	1,697,858.20	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,394	1,029,550.72	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	620,208.00	
		UDR INC	16,160	529,886.40	
		VENTAS INC	20,225	854,304.00	
		VEREIT INC	64,364	434,457.00	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	514,507.40	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	233,413.57	
		WELLTOWER INC	19,850	1,116,761.00	
		WEYERHAEUSER CO	36,698	1,080,022.14	
		WP CAREY INC	9,580	639,848.20	
			702,547	42,878,427.15	

米ドル小計				(4,489,371,322)	
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	4,700	208,445.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,760	85,784.40	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	143,260.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	36,943.40	
加ドル小計			22,650	474,432.80 (37,788,572)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	2,655	146,821.50	
		GECINA SA	2,350	260,145.00	
		ICADE	1,965	93,062.40	
		KLEPIERRE	10,512	130,348.80	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,700	292,600.00	
ユーロ小計			25,182	922,977.70 (114,467,694)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	49,131	186,796.06	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	189,511.96	
		SEGRO PLC	62,233	582,500.88	
英ポンド小計			145,498	958,808.90 (131,021,236)	
豪ドル	投資証券	DEXUS	57,587	532,103.88	
		GOODMAN GROUP	76,082	1,405,234.54	
		GPT GROUP	120,435	504,622.65	
		LENDLEASE GROUP	28,927	365,058.74	
		MIRVAC GROUP	208,775	459,305.00	
		SCENTRE GROUP	241,771	548,820.17	
		STOCKLAND	151,600	606,400.00	
		VICINITY CENTRES	191,002	253,077.65	
豪ドル小計			1,076,179	4,674,622.63 (348,960,579)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	101,800	6,306,510.00	
香港ドル小計			101,800	6,306,510.00 (85,200,950)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	160,312	493,760.96	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	162,540	268,191.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	132,400	248,912.00	

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,400	230,660.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	136,800	280,440.00	
		SUNTEC REIT	91,400	133,444.00	
シンガポールドル小計			804,852	1,655,407.96 (127,698,170)	
合計				5,334,508,523 (5,334,508,523)	

(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　590銘柄	97.3%	—	70.4%
	投資証券　39銘柄	—	2.7%	2.0%
加ドル	株式　81銘柄	99.5%	—	3.3%
	投資証券　4銘柄	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式　238銘柄	99.5%	—	10.5%
	投資証券　5銘柄	—	0.5%	0.1%
英ポンド	株式　84銘柄	98.7%	—	4.2%
	投資証券　3銘柄	—	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	3.4%
スウェーデンクローナ	株式　36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　55銘柄	93.2%	—	2.1%
	投資証券　8銘柄	—	6.8%	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	96.3%	—	1.0%
	投資証券　1銘柄	—	3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式　15銘柄	84.2%	—	0.3%
	投資証券　6銘柄	—	15.8%	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。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	46,217,539	33,915,362
コール・ローン	284,451,793	465,491,601
株式	8,158,784,232	10,325,179,492
投資証券	237,520,855	251,358,988
派生商品評価勘定	7,164,956	118,676,267
未収入金	-	2,071,276
未収配当金	7,140,505	7,424,886
差入委託証拠金	124,863,937	236,763,776
流動資産合計	8,866,143,817	11,440,881,648
資産合計	8,866,143,817	11,440,881,648
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	151,159,863	7,868,917
未払金	-	2,095,919
未払解約金	3,629,327	8,723,931
未払利息	77	129
流動負債合計	154,789,267	18,688,896
負債合計	154,789,267	18,688,896
純資産の部		
元本等		
元本	4,930,561,728	5,875,608,160
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,780,792,822	5,546,584,592
元本等合計	8,711,354,550	11,422,192,752
純資産合計	8,711,354,550	11,422,192,752
負債純資産合計	8,866,143,817	11,440,881,648

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、オプション証券等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）

		2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
1．	期首	2018年10月27日	2019年10月29日
	期首元本額	4,317,838,768円	4,930,561,728円
	期首からの追加設定元本額	1,023,341,795円	1,560,324,240円
	期首からの一部解約元本額	410,618,835円	615,277,808円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（ＤＣ専用）	3,346,675,760円	4,283,823,546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）	417,114,961円	379,820,199円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	7,150,113円	6,701,205円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	6,181,292円	5,505,090円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	11,011,206円	7,811,402円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	8,706,099円	7,110,060円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	41,252,581円	39,022,669円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	116,515,193円	106,946,295円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	169,068,988円	159,359,431円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	162,415,851円	149,373,199円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	644,469,684円	730,135,064円

	計	4,930,561,728円	5,875,608,160円
2．	受益権の総数	4,930,561,728口	5,875,608,160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 2018年10月27日 至 2019年10月28日	自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	799,877,998
投資証券	34,784,785
合計	834,662,783

（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,023,581,654
投資証券	△29,867,689
合計	993,713,965

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引 買建	382,035,109	－	387,190,445	5,155,336
合計		382,035,109	－	387,190,445	5,155,336

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	852,350,843	－	864,239,328	11,888,485
合計		852,350,843	－	864,239,328	11,888,485

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	8,335,107,087	－	8,484,257,330	△149,150,243
	米ドル	5,752,101,030	－	5,847,149,720	△95,048,690
	加ドル	302,831,255	－	311,532,840	△8,701,585
	ユーロ	992,907,287	－	1,005,609,220	△12,701,933
	英ポンド	485,234,154	－	508,489,470	△23,255,316
	スイスフラン	284,579,987	－	286,161,950	△1,581,963

	スウェーデンクローナ	79,723,849	－	80,945,610	△1,221,761
	ノルウェークローネ	19,831,201	－	19,703,550	127,651
	デンマーククローネ	55,130,495	－	55,758,370	△627,875
	豪ドル	215,860,434	－	219,616,680	△3,756,246
	ニュージーランドドル	5,314,567	－	5,445,400	△130,833
	香港ドル	101,287,680	－	102,670,600	△1,382,920
	シンガポールドル	32,588,206	－	33,332,470	△744,264
	イスラエルシュケル	7,716,942	－	7,841,450	△124,508
合計		8,335,107,087	－	8,484,257,330	△149,150,243

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	10,952,181,945	－	10,853,263,080	98,918,865
	米ドル	7,981,314,102	－	7,911,144,170	70,169,932
	加ドル	357,329,338	－	355,062,580	2,266,758
	ユーロ	1,166,592,763	－	1,157,627,920	8,964,843
	英ポンド	461,934,734	－	454,309,570	7,625,164
	スイスフラン	354,965,133	－	353,526,460	1,438,673
	スウェーデンクローナ	113,689,006	－	112,818,680	870,326
	ノルウェークローネ	18,455,613	－	17,731,820	723,793
	デンマーククローネ	89,286,932	－	88,639,280	647,652
	豪ドル	245,163,983	－	240,189,470	4,974,513
	ニュージーランドドル	9,866,552	－	9,800,270	66,282
	香港ドル	109,495,816	－	108,604,680	891,136
	シンガポールドル	35,262,440	－	35,063,360	199,080
	イスラエルシュケル	8,825,533	－	8,744,820	80,713

合計	10,952,181,945	－	10,853,263,080	98,918,865

（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）

2019年10月28日現在		2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.7668円	1口当たり純資産額	1.9440円
(1万口当たり純資産額)	(17,668円)	(1万口当たり純資産額)	(19,440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	1,970	14.29	28,151.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	880	19.68	17,318.40	
	CHENIERE ENERGY INC	484	48.70	23,570.80	
	CHEVRON CORP	4,432	72.57	321,630.24	
	CONCHO RESOURCES INC	524	46.97	24,612.28	
	CONOCOPHILLIPS	2,730	32.54	88,834.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	359	29.03	10,421.77	

EOG RESOURCES INC	1,391	37.51	52,176.41	
EXXON MOBIL CORP	10,041	34.16	343,000.56	
HALLIBURTON CO	2,829	13.31	37,653.99	
HESS CORP	622	39.37	24,488.14	
KINDER MORGAN INC	4,469	12.78	57,113.82	
MARATHON PETROLEUM CORP	1,556	29.89	46,508.84	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	795	9.19	7,306.05	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,930	10.02	19,338.60	
ONEOK INC	881	30.55	26,914.55	
PHILLIPS 66	1,038	50.48	52,398.24	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	356	85.54	30,452.24	
SCHLUMBERGER LTD	3,215	15.40	49,511.00	
VALERO ENERGY CORP	903	41.97	37,898.91	
WILLIAMS COS INC	3,189	19.96	63,652.44	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	541	294.00	159,054.00	
ALBEMARLE CORP	263	96.48	25,374.24	
AMCOR PLC	4,230	10.97	46,403.10	
AVERY DENNISON CORP	175	141.74	24,804.50	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	600	26.77	16,062.00	
BALL CORP	855	92.72	79,275.60	
CELANESE CORP	251	120.18	30,165.18	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	462	27.58	12,741.96	
CORTEVA INC	1,796	33.17	59,573.32	
CROWN HOLDINGS INC	274	90.38	24,764.12	
DOW INC	1,706	48.53	82,792.18	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,770	59.82	105,881.40	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	295	87.32	25,759.40	
ECOLAB INC	599	204.87	122,717.13	
FMC CORP	252	107.78	27,160.56	
FREEPORT-MCMORAN INC	3,981	18.36	73,091.16	
INTERNATIONAL PAPER CO	792	46.40	36,748.80	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	209	110.57	23,109.13	
LINDE PLC	1,265	234.27	296,351.55	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	557	76.90	42,833.30	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	144	262.41	37,787.04	

MOSAIC CO/THE	882	18.70	16,493.40	
NEWMONT CORP	2,128	60.47	128,680.16	
NUCOR CORP	732	50.19	36,739.08	
PACKAGING CORP OF AMERICA	192	119.20	22,886.40	
PPG INDUSTRIES INC	632	134.27	84,858.64	
RPM INTERNATIONAL INC	385	89.70	34,534.50	
SEALED AIR CORP	300	41.29	12,387.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	187	683.31	127,778.97	
STEEL DYNAMICS INC	428	32.58	13,944.24	
VULCAN MATERIALS CO	335	145.41	48,712.35	
WESTROCK CO	562	40.24	22,614.88	
3M CO	1,393	169.80	236,531.40	
AERCAP HOLDINGS NV	367	30.12	11,054.04	
ALLEGION PLC	231	102.88	23,765.28	
AMETEK INC	484	107.76	52,155.84	
BOEING CO/THE	1,251	167.36	209,367.36	
CARRIER GLOBAL CORP	1,767	34.93	61,721.31	
CATERPILLAR INC	1,319	168.59	222,370.21	
CUMMINS INC	417	226.28	94,358.76	
DEERE & CO	687	239.53	164,557.11	
DOVER CORP	354	116.27	41,159.58	
EATON CORP PLC	892	109.81	97,950.52	
EMERSON ELECTRIC CO	1,306	70.02	91,446.12	
FASTENAL CO	1,443	45.00	64,935.00	
FORTIVE CORP	784	66.50	52,136.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	347	85.47	29,658.09	
GENERAL DYNAMICS CORP	566	140.70	79,636.20	
GENERAL ELECTRIC CO	20,114	7.63	153,469.82	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	400	42.58	17,032.00	
HEICO CORP-CLASS A	253	99.79	25,246.87	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,695	175.54	297,540.30	
HOWMET AEROSPACE INC	740	18.95	14,023.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	152.82	17,879.94	
IDEX CORP	206	191.63	39,475.78	
ILLINOIS TOOL WORKS	774	206.70	159,985.80	

INGERSOLL-RAND INC	944	38.27	36,126.88	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	300	99.21	29,763.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	600	44.00	26,400.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,885	44.40	83,694.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	485	171.80	83,323.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	288.09	23,047.20	
LOCKHEED MARTIN CORP	589	374.33	220,480.37	
MASCO CORP	681	54.76	37,291.56	
NORDSON CORP	120	207.56	24,907.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	375	308.43	115,661.25	
OTIS WORLDWIDE CORP	883	63.45	56,026.35	
OWENS CORNING	340	71.00	24,140.00	
PACCAR INC	745	92.64	69,016.80	
PARKER HANNIFIN CORP	264	226.16	59,706.24	
PENTAIR PLC	320	51.97	16,630.40	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	3,666	62.57	229,381.62	
ROCKWELL AUTOMATION INC	283	243.10	68,797.30	
ROPER TECHNOLOGIES INC	241	428.60	103,292.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	48.90	17,506.20	
SNAP-ON INC	152	169.39	25,747.28	
STANLEY BLACK & DECKER INC	355	178.01	63,193.55	
SUNRUN INC	280	56.03	15,688.40	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	340.46	40,855.20	
TEXTRON INC	508	35.19	17,876.52	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	504	129.22	65,126.88	
TRANSDIGM GROUP INC	114	501.97	57,224.58	
UNITED RENTALS INC	194	188.24	36,518.56	
WABTEC CORP	412	62.06	25,568.72	
WW GRAINGER INC	99	361.03	35,741.97	
XYLEM INC	392	91.59	35,903.28	
CINTAS CORP	192	338.07	64,909.44	
COPART INC	420	114.29	48,001.80	
COSTAR GROUP INC	107	819.81	87,719.67	
EQUIFAX INC	272	152.95	41,602.40	
IHS MARKIT LTD	853	82.99	70,790.47	

NIELSEN HOLDINGS PLC	1,073	14.18	15,215.14	
REPUBLIC SERVICES INC	504	92.87	46,806.48	
ROBERT HALF INTL INC	290	51.67	14,984.30	
TRANSUNION	455	86.05	39,152.75	
VERISK ANALYTICS INC	325	189.25	61,506.25	
WASTE CONNECTIONS INC	580	103.62	60,099.60	
WASTE MANAGEMENT INC	925	116.70	107,947.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	378	100.54	38,004.12	
CSX CORP	1,882	81.29	152,987.78	
DELTA AIR LINES INC	342	34.00	11,628.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	427	95.20	40,650.40	
FEDEX CORP	566	283.56	160,494.96	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	176	128.97	22,698.72	
KANSAS CITY SOUTHERN	189	184.46	34,862.94	
NORFOLK SOUTHERN CORP	561	215.40	120,839.40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	216	200.62	43,333.92	
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	42.79	19,940.14	
UBER TECHNOLOGIES INC	2,290	36.75	84,157.50	
UNION PACIFIC CORP	1,609	188.14	302,717.26	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,700	171.90	292,230.00	
XPO LOGISTICS INC	212	95.35	20,214.20	
APTIV PLC	693	100.29	69,500.97	
AUTOLIV INC	130	84.94	11,042.20	
BORGWARNER INC	614	39.75	24,406.50	
FORD MOTOR COMPANY	8,108	8.16	66,161.28	
GENERAL MOTORS CORP	3,067	36.83	112,957.61	
LEAR CORP	167	134.51	22,463.17	
TESLA INC	1,775	420.63	746,618.25	
DR HORTON INC	927	73.06	67,726.62	
GARMIN LTD	290	100.84	29,243.60	
HASBRO INC	280	92.00	25,760.00	
LENNAR CORP-CL A	783	78.27	61,285.41	
LULULEMON ATHLETICA INC	307	333.92	102,513.44	
MOHAWK INDUSTRIES INC	184	104.68	19,261.12	
NEWELL BRANDS INC	1,116	18.00	20,088.00	

NIKE INC -CL B	2,929	129.99	380,740.71	
NVR INC	10	4,205.99	42,059.90	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	450	122.53	55,138.50	
PULTE GROUP INC	707	43.99	31,100.93	
VF CORP	800	74.83	59,864.00	
WHIRLPOOL CORP	131	198.11	25,952.41	
ARAMARK	646	30.27	19,554.42	
CARNIVAL CORP	1,425	15.36	21,888.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	74	1,339.08	99,091.92	
DARDEN RESTAURANTS INC	311	99.53	30,953.83	
DOMINO'S PIZZA INC	93	394.10	36,651.30	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	592	94.61	56,009.12	
LAS VEGAS SANDS CORP	718	50.68	36,388.24	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	723	101.76	73,572.48	
MCDONALD'S CORP	1,787	228.71	408,704.77	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,153	23.36	26,934.08	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	348	64.48	22,439.04	
STARBUCKS CORP	2,730	90.80	247,884.00	
VAIL RESORTS INC	76	250.01	19,000.76	
WYNN RESORTS LTD	211	76.56	16,154.16	
YUM! BRANDS INC	665	101.28	67,351.20	
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,813	81.04	146,925.52	
ALPHABET INC-CL A	705	1,632.98	1,151,250.90	
ALPHABET INC-CL C	721	1,641.00	1,183,161.00	
ALTICE USA INC- A	740	27.64	20,453.60	
CABLE ONE INC	10	1,907.25	19,072.50	
CHARTER COMMUNICATION-A	351	593.28	208,241.28	
COMCAST CORP-CLASS A	10,912	45.06	491,694.72	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	1,284	19.11	24,537.24	
DISH NETWORK CORP-A	595	27.24	16,207.80	
ELECTRONIC ARTS INC	662	126.77	83,921.74	
FACEBOOK INC-CLASS A	5,699	284.79	1,623,018.21	
FOX CORP - CLASS A	1,253	27.08	33,931.24	
IAC/INTERACTIVECORP	168	129.31	21,724.08	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	714	19.34	13,808.76	

LIBERTY BROADBAND-C	271	139.99	37,937.29	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	623	36.85	22,957.55	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	514	37.26	19,151.64	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	338	57.16	19,320.08	
MATCH GROUP INC	605	120.30	72,781.50	
NETFLIX INC	1,053	488.28	514,158.84	
OMNICOM GROUP	510	52.72	26,887.20	
PINTEREST INC- CLASS A	1,077	53.00	57,081.00	
ROKU INC	250	223.96	55,990.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,371	5.98	20,158.58	
SNAP INC - A	1,807	43.17	78,008.19	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	287	164.43	47,191.41	
THE WALT DISNEY CO.	4,321	128.35	554,600.35	
TWITTER INC	1,938	50.44	97,752.72	
VIACOMCBS INC - CLASS B	1,322	29.28	38,708.16	
ZILLOW GROUP INC - C	280	96.16	26,924.80	
ADVANCE AUTO PARTS INC	206	154.72	31,872.32	
AMAZON.COM INC	1,007	3,204.40	3,226,830.80	
AUTOZONE INC	53	1,183.16	62,707.48	
BEST BUY CO INC	559	118.21	66,079.39	
BOOKING HOLDINGS INC	98	1,823.55	178,707.90	
BURLINGTON STORES INC	158	208.01	32,865.58	
CARMAX INC	342	90.95	31,104.90	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	605	215.44	130,341.20	
DOLLAR TREE INC	576	95.47	54,990.72	
EBAY INC	1,767	53.79	95,046.93	
EXPEDIA INC	295	102.72	30,302.40	
GENUINE PARTS CO	327	98.78	32,301.06	
HOME DEPOT INC	2,560	283.00	724,480.00	
LKQ CORP	715	32.88	23,509.20	
LOWE'S COS INC	1,817	172.14	312,778.38	
MERCADOLIBRE INC	111	1,312.16	145,649.76	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	178	466.43	83,024.54	
ROSS STORES INC	766	95.43	73,099.38	
TARGET CORP	1,180	160.23	189,071.40	

TIFFANY & CO	227	123.54	28,043.58	
TJX COMPANIES INC	2,834	57.02	161,594.68	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	139.82	40,268.16	
ULTA BEAUTY INC	115	235.11	27,037.65	
WAYFAIR INC- CLASS A	166	265.85	44,131.10	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,060	374.60	397,076.00	
KROGER CO	2,119	32.76	69,418.44	
SYSCO CORP	1,145	64.80	74,196.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,794	38.04	68,243.76	
WALMART INC	3,397	143.85	488,658.45	
ALTRIA GROUP INC	4,523	39.08	176,758.84	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,304	51.87	67,638.48	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	679	74.40	50,517.60	
BUNGE LTD	384	56.02	21,511.68	
CAMPBELL SOUP CO	333	48.55	16,167.15	
COCA-COLA CO/THE	9,686	50.52	489,336.72	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	578	39.03	22,559.34	
CONAGRA BRANDS INC	1,140	38.00	43,320.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	358	179.46	64,246.68	
GENERAL MILLS INC	1,316	61.78	81,302.48	
HERSHEY CO/THE	319	146.34	46,682.46	
HORMEL FOODS CORP	696	49.61	34,528.56	
INGREDION INC	200	76.61	15,322.00	
JM SMUCKER CO/THE	281	115.54	32,466.74	
KELLOGG CO	581	66.76	38,787.56	
KEURIG DR PEPPER INC	780	29.21	22,783.80	
KRAFT HEINZ CO/THE	1,453	31.37	45,580.61	
LAMB WESTON HOLDING INC	369	72.11	26,608.59	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	265	196.46	52,061.90	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	389	35.68	13,879.52	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,441	56.61	194,795.01	
MONSTER BEVERAGE CORP	924	80.39	74,280.36	
PEPSICO INC	3,306	139.56	461,385.36	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,720	74.45	276,954.00	
TYSON FOODS INC-CL A	617	60.05	37,050.85	

CHURCH & DWIGHT CO INC	550	91.91	50,550.50	
CLOROX COMPANY	311	211.14	65,664.54	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,994	79.34	158,203.96	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	478	235.23	112,439.94	
KIMBERLY-CLARK CORP	872	136.88	119,359.36	
PROCTER & GAMBLE CO	5,885	142.38	837,906.30	
ABBOTT LABORATORIES	4,243	107.79	457,352.97	
ABIOMED INC	101	281.42	28,423.42	
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	469.56	88,746.84	
AMERISOURCEBERGEN CORP	353	99.38	35,081.14	
ANTHEM INC	586	310.76	182,105.36	
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,263	81.09	102,416.67	
BECTON DICKINSON AND CO	706	240.28	169,637.68	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,509	37.17	130,429.53	
CARDINAL HEALTH INC	648	49.34	31,972.32	
CENTENE CORP	1,288	67.42	86,836.96	
CERNER CORP	707	73.72	52,120.04	
CIGNA CORP	868	184.49	160,137.32	
COOPER COS INC/THE	111	356.45	39,565.95	
CVS HEALTH CORP	3,175	60.25	191,293.75	
DANAHER CORP	1,527	232.66	355,271.82	
DAVITA INC	260	91.05	23,673.00	
DENTSPLY SIRONA INC	429	49.15	21,085.35	
DEXCOM INC	236	411.00	96,996.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,371	80.41	110,242.11	
HCA HEALTHCARE INC	584	136.59	79,768.56	
HENRY SCHEIN INC	414	67.79	28,065.06	
HOLOGIC INC	727	67.91	49,370.57	
HUMANA INC	302	444.31	134,181.62	
IDEXX LABORATORIES INC	200	429.66	85,932.00	
INSULET CORP	145	249.39	36,161.55	
INTUITIVE SURGICAL INC	277	735.48	203,727.96	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	186	207.49	38,593.14	
MASIMO CORP	110	244.77	26,924.70	
MCKESSON CORP	399	156.41	62,407.59	

MEDTRONIC PLC	3,135	111.42	349,301.70	
MOLINA HEALTHCARE INC	130	212.55	27,631.50	
QUEST DIAGNOSTICS	309	127.13	39,283.17	
RESMED INC	402	183.03	73,578.06	
STERIS PLC	186	187.54	34,882.44	
STRYKER CORP	823	221.90	182,623.70	
TELADOC HEALTH INC	160	216.32	34,611.20	
TELEFLEX INC	102	366.24	37,356.48	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,264	330.60	748,478.40	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	115.58	21,266.72	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	234	172.56	40,379.04	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	293	296.85	86,977.05	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	160	281.93	45,108.80	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	542	142.71	77,348.82	
ABBVIE INC	4,184	84.34	352,878.56	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	774	106.17	82,175.58	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	480	121.61	58,372.80	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	289	131.84	38,101.76	
AMGEN INC	1,384	227.16	314,389.44	
AVANTOR INC	890	24.90	22,161.00	
BEIGENE LTD-ADR	100	299.00	29,900.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	50	581.71	29,085.50	
BIOGEN INC	398	265.00	105,470.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	77.53	37,834.64	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,425	60.13	326,205.25	
CATALENT INC	350	94.02	32,907.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	880	31.38	27,614.40	
ELI LILLY & CO	2,075	142.38	295,438.50	
EXACT SCIENCES CORP	296	109.70	32,471.20	
GILEAD SCIENCES INC	3,012	60.79	183,099.48	
ILLUMINA INC	361	323.55	116,801.55	
INCYTE CORP	431	89.69	38,656.39	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	353	47.34	16,711.02	
IQVIA HOLDINGS INC	490	167.47	82,060.30	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	125	150.26	18,782.50	

JOHNSON & JOHNSON	6,267	145.24	910,219.08	
MERCK & CO. INC.	5,972	79.83	476,744.76	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	51	1,053.20	53,713.20	
MODERNA INC	696	70.53	49,088.88	
MYLAN NV	1,474	15.69	23,127.06	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	99.01	21,782.20	
PERKINELMER INC	293	124.45	36,463.85	
PERRIGO CO PLC	266	45.62	12,134.92	
PFIZER INC	13,199	38.18	503,937.82	
REGENERON PHARMACEUTICALS	247	579.81	143,213.07	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	170	137.73	23,414.10	
SEAGEN INC	292	196.92	57,500.64	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	3,353	9.35	31,350.55	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	947	480.17	454,720.99	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	604	211.58	127,794.32	
WATERS CORP	172	221.95	38,175.40	
ZOETIS INC	1,154	163.49	188,667.46	
BANK OF AMERICA CORP	18,493	24.90	460,475.70	
CITIGROUP INC	4,814	43.95	211,575.30	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,341	29.13	39,063.33	
COMERICA INC	345	46.39	16,004.55	
EAST WEST BANCORP INC	327	38.36	12,543.72	
FIFTH THIRD BANCORP	1,569	24.42	38,314.98	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	438	130.98	57,369.24	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,332	10.47	24,416.04	
JPMORGAN CHASE & CO	7,210	103.81	748,470.10	
KEYCORP	2,531	13.45	34,041.95	
M & T BANK CORP	407	106.12	43,190.84	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,000	114.81	114,810.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	2,999	13.78	41,326.22	
SIGNATURE BANK	168	84.57	14,207.76	
SVB FINANCIAL GROUP	106	296.38	31,416.28	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,274	43.94	143,859.56	
US BANCORP	3,194	40.66	129,868.04	
WELLS FARGO & CO	9,373	23.28	218,203.44	

ZIONS BANCORP NA	517	33.20	17,164.40	
ALLY FINANCIAL INC	1,151	29.08	33,471.08	
AMERICAN EXPRESS CO	1,672	100.98	168,838.56	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	259	170.39	44,131.01	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	380	41.15	15,637.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,003	37.67	75,453.01	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,300	212.71	701,943.00	
BLACKROCK INC	361	637.31	230,068.91	
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	1,655	54.64	90,429.20	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,161	77.99	90,546.39	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	81.72	25,006.32	
CME GROUP INC	843	163.86	138,133.98	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	669	68.00	45,492.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	20.59	19,766.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	86	328.48	28,249.28	
FRANKLIN RESOURCES INC	1,042	23.22	24,195.24	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	752	205.04	154,190.08	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,347	98.95	133,285.65	
INVESCO LTD	990	13.98	13,840.20	
KKR & CO INC -A	1,194	37.40	44,655.60	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	558.91	52,537.54	
MOODY'S CORP	421	271.88	114,461.48	
MORGAN STANLEY	3,238	51.87	167,955.06	
MSCI INC	222	350.55	77,822.10	
NASDAQ INC	243	129.12	31,376.16	
NORTHERN TRUST CORP	437	84.41	36,887.17	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	332	81.11	26,928.52	
S&P GLOBAL INC	585	337.43	197,396.55	
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,291	40.35	132,791.85	
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	52.03	18,054.41	
STATE STREET CORP	955	65.31	62,371.05	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,373	27.75	38,100.75	
T ROWE PRICE GROUP INC	534	148.10	79,085.40	
VOYA FINANCIAL INC	316	52.54	16,602.64	
AFLAC INC	1,805	37.85	68,319.25	

ALLEGHANY CORP	27	596.89	16,116.03	
ALLSTATE CORP	680	91.25	62,050.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	150	75.81	11,371.50	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,820	32.38	58,931.60	
AON PLC	569	207.31	117,959.39	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	837	31.81	26,624.97	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	425	107.92	45,866.00	
ASSURANT INC	167	125.99	21,040.33	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	463	34.24	15,853.12	
BROWN & BROWN INC	595	46.72	27,798.40	
CHUBB LTD	1,106	129.02	142,696.12	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	77.40	29,566.80	
EVEREST RE GROUP LTD	83	214.02	17,763.66	
FNF GROUP	589	32.94	19,401.66	
GLOBE LIFE INC	215	86.14	18,520.10	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	959	40.61	38,944.99	
LINCOLN NATIONAL CORP	407	37.05	15,079.35	
LOEWS CORP	575	36.23	20,832.25	
MARKEL CORP	34	1,027.00	34,918.00	
MARSH & MCLENNAN COS	1,252	113.70	142,352.40	
METLIFE INC	1,756	40.94	71,890.64	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	796	43.52	34,641.92	
PROGRESSIVE CORP	1,278	94.62	120,924.36	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	914	68.73	62,819.22	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	154	108.30	16,678.20	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	119	178.22	21,208.18	
TRAVELERS COS INC/THE	627	125.97	78,983.19	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	289	209.75	60,617.75	
WR BERKLEY CORP	316	65.72	20,767.52	
CBRE GROUP INC - A	985	46.66	45,960.10	
JONES LANG LASALLE INC	136	111.86	15,212.96	
ACCENTURE PLC-CL A	1,499	229.70	344,320.30	
ADOBE INC	1,152	488.50	562,752.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	362	106.75	38,643.50	
ANSYS INC	202	330.22	66,704.44	

AUTODESK INC	549	254.42	139,676.58	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,047	149.20	156,212.40	
AVALARA INC	160	154.51	24,721.60	
BLACK KNIGHT INC	380	93.31	35,457.80	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	79.05	28,853.25	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	279	145.73	40,658.67	
CADENCE DESIGN SYS INC	601	112.05	67,342.05	
CDK GLOBAL INC	395	46.41	18,331.95	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	291	120.47	35,056.77	
CITRIX SYSTEMS INC	318	122.71	39,023.37	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,308	74.12	96,948.96	
COUPA SOFTWARE INC	150	302.00	45,300.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	388	135.42	52,542.96	
DATADOG INC-CLASS A	230	102.08	23,478.40	
DOCUSIGN INC	455	219.82	100,018.10	
EPAM SYSTEMS INC	131	339.05	44,415.55	
FAIR ISAAC CORP	60	435.60	26,136.00	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,499	144.40	216,455.60	
FISERV INC	1,357	101.18	137,301.26	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	192	259.20	49,766.40	
FORTINET INC	343	130.38	44,720.34	
GARTNER INC	246	128.13	31,519.98	
GLOBAL PAYMENTS INC	668	176.99	118,229.32	
GODADDY INC-CLASS A	443	74.87	33,167.41	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	175	101.74	17,804.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,110	116.00	244,760.00	
INTUIT INC	615	334.42	205,668.30	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	158.31	31,820.31	
LEIDOS HOLDINGS INC	309	85.80	26,512.20	
MASTERCARD INC	2,112	329.61	696,136.32	
MICROSOFT CORP	17,095	216.23	3,696,451.85	
MONGODB INC	100	248.00	24,800.00	
NORTONLIFELOCK INC	1,407	20.84	29,321.88	
OKTA INC	317	219.51	69,584.67	
ORACLE CORP	4,885	59.90	292,611.50	

PALO ALTO NETWORKS INC	237	236.54	56,059.98	
PAYCHEX INC	662	85.03	56,289.86	
PAYCOM SOFTWARE INC	111	388.65	43,140.15	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,671	203.04	542,319.84	
PTC INC	326	89.25	29,095.50	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	201	284.75	57,234.75	
SALESFORCE.COM INC	2,154	250.52	539,620.08	
SERVICENOW INC	445	514.01	228,734.45	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	1,056	28.76	30,370.56	
SPLUNK INC	362	216.51	78,376.62	
SQUARE INC - A	889	176.77	157,148.53	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	65.19	39,309.57	
SYNOPSYS INC	423	226.74	95,911.02	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	90	619.91	55,791.90	
TWILIO INC - A	319	306.10	97,645.90	
TYLER TECHNOLOGIES INC	99	404.40	40,035.60	
VERISIGN INC	250	200.80	50,200.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,982	198.01	788,475.82	
VMWARE INC	164	149.20	24,468.80	
WESTERN UNION CO	1,045	21.97	22,958.65	
WIX.COM LTD	150	271.87	40,780.50	
WORKDAY INC-CLASS A	398	224.14	89,207.72	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	401	511.52	205,119.52	
ZSCALER INC	160	147.05	23,528.00	
AMPHENOL CORP-CL A	673	119.75	80,591.75	
APPLE INC	41,148	115.04	4,733,665.92	
ARISTA NETWORKS INC	124	214.11	26,549.64	
CDW CORP/DE	335	130.00	43,550.00	
CISCO SYSTEMS INC	10,028	38.82	389,286.96	
COGNEX CORP	423	69.93	29,580.39	
CORNING INC	2,001	35.56	71,155.56	
DELL TECHNOLOGIES -C	631	68.18	43,021.58	
F5 NETWORKS INC	110	128.36	14,119.60	
FLIR SYSTEMS INC	335	36.16	12,113.60	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	2,722	9.48	25,804.56	

HP INC	3,088	19.12	59,042.56	
JUNIPER NETWORKS INC	802	22.29	17,876.58	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	408	107.88	44,015.04	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	391	174.78	68,338.98	
NETAPP INC	482	46.89	22,600.98	
SEAGATE TECHNOLOGY	608	50.74	30,849.92	
TE CONNECTIVITY LTD	750	106.30	79,725.00	
TRIMBLE INC	488	50.08	24,439.04	
WESTERN DIGITAL CORP	634	41.72	26,450.48	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	122	303.72	37,053.84	
AT&T INC	17,059	27.82	474,581.38	
CENTURYLINK INC	2,399	9.61	23,054.39	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,319	20.35	26,841.65	
T-MOBILE US INC	1,361	112.38	152,949.18	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	9,896	57.96	573,572.16	
AES CORP	1,319	20.65	27,237.35	
ALLIANT ENERGY CORP	481	56.67	27,258.27	
AMEREN CORPORATION	515	83.39	42,945.85	
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,101	91.88	101,159.88	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	373	154.08	57,471.84	
ATMOS ENERGY CORP	294	97.69	28,720.86	
CENTERPOINT ENERGY INC	1,225	22.23	27,231.75	
CMS ENERGY CORP	656	65.85	43,197.60	
CONSOLIDATED EDISON INC	822	81.60	67,075.20	
DOMINION ENERGY INC	1,962	81.14	159,196.68	
DTE ENERGY COMPANY	408	125.15	51,061.20	
DUKE ENERGY CORP	1,803	92.78	167,282.34	
EDISON INTERNATIONAL	770	60.49	46,577.30	
ENTERGY CORP	463	108.95	50,443.85	
ESSENTIAL UTILITIES INC	430	44.50	19,135.00	
EVERGY INC	456	56.37	25,704.72	
EVERSOURCE ENERGY	681	91.97	62,631.57	
EXELON CORP	2,221	42.20	93,726.20	
FIRSTENERGY CORP	1,252	33.30	41,691.60	
NEXTERA ENERGY INC	1,178	303.07	357,016.46	

	NISOURCE INC	783	24.31	19,034.73	
	NRG ENERGY INC	676	33.67	22,760.92	
	OGE ENERGY CORP	430	33.16	14,258.80	
	P G & E CORP	3,040	10.25	31,160.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	319	86.73	27,666.87	
	PPL CORP	1,563	28.67	44,811.21	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,079	60.92	65,732.68	
	SEMPRA ENERGY	630	133.86	84,331.80	
	SOUTHERN CO	2,475	60.85	150,603.75	
	UGI CORP	547	35.86	19,615.42	
	VISTRA CORP	921	19.28	17,756.88	
	WEC ENERGY GROUP INC	688	102.16	70,286.08	
	XCEL ENERGY INC	1,150	71.47	82,190.50	
	ADVANCED MICRO DEVICES	2,745	81.96	224,980.20	
	ANALOG DEVICES INC	858	124.20	106,563.60	
	APPLIED MATERIALS INC	2,091	60.95	127,446.45	
	BROADCOM INC	959	372.72	357,438.48	
	INTEL CORP	10,070	48.20	485,374.00	
	KLA CORP	338	203.17	68,671.46	
	LAM RESEARCH CORP	347	353.92	122,810.24	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,742	41.43	72,171.06	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	575	72.87	41,900.25	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	530	112.52	59,635.60	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,543	52.85	134,397.55	
	NVIDIA CORP	1,468	543.61	798,019.48	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	713	137.18	97,809.34	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,060	26.16	27,729.60	
	QORVO INC	316	135.70	42,881.20	
	QUALCOMM INC	2,690	128.88	346,687.20	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	371	149.76	55,560.96	
	TERADYNE INC	480	92.00	44,160.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,185	149.96	327,662.60	
	XILINX INC	546	116.82	63,783.72	
米ドル小計		727,777		71,385,509.27 (7,474,062,820)	

加ドル	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,103	22.43	69,600.29	
	CENOVUS ENERGY INC	2,415	4.88	11,785.20	
	ENBRIDGE INC	4,952	37.99	188,126.48	
	IMPERIAL OIL LTD	880	17.71	15,584.80	
	INTER PIPELINE LTD	1,244	12.76	15,873.44	
	KEYERA CORP	660	20.33	13,417.80	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,595	28.55	45,537.25	
	SUNCOR ENERGY INC	3,654	16.49	60,254.46	
	TC ENERGY CORP	2,189	55.36	121,183.04	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	725	104.10	75,472.50	
	BARRICK GOLD CORP	4,506	35.21	158,656.26	
	FRANCO-NEVADA CORP	507	181.22	91,878.54	
	KINROSS GOLD CORP	4,540	11.28	51,211.20	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	856	61.26	52,438.56	
	NUTRIEN LTD	1,495	54.57	81,582.15	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,347	63.76	85,884.72	
	CAE INC	753	24.01	18,079.53	
	WSP GLOBAL INC	385	88.78	34,180.30	
	THOMSON REUTERS CORP	413	107.63	44,451.19	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,734	137.98	239,257.32	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	322	413.50	133,147.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	674	71.95	48,494.30	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	660	29.59	19,529.40	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	708	74.58	52,802.64	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,223	23.24	28,422.52	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	154.82	21,519.98	
	DOLLARAMA INC	672	49.70	33,398.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	2,066	43.05	88,941.30	
	LOBLAW COMPANIES LTD	589	67.57	39,798.73	
	METRO INC	776	62.65	48,616.40	
	WESTON (GEORGE) LTD	240	96.09	23,061.60	
	SAPUTO INC	748	34.68	25,940.64	
	BAUSCH HEALTH COS INC	975	24.12	23,517.00	
	CANOPY GROWTH CORP	376	25.94	9,753.44	
	BANK OF MONTREAL	1,447	84.09	121,678.23	

	BANK OF NOVA SCOTIA	2,736	57.18	156,444.48	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,049	102.50	107,522.50	
	NATIONAL BANK OF CANADA	855	67.03	57,310.65	
	ROYAL BANK OF CANADA	3,319	96.29	319,586.51	
	TORONTO-DOMINION BANK	4,288	60.53	259,552.64	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	3,329	44.52	148,207.08	
	ONEX CORPORATION	270	61.79	16,683.30	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	78	370.21	28,876.38	
	GREAT-WEST LIFECO INC	917	28.28	25,932.76	
	IA FINANCIAL CORP INC	290	49.05	14,224.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	473	143.80	68,017.40	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	4,879	19.21	93,725.59	
	POWER CORP OF CANADA	1,536	26.77	41,118.72	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,366	55.68	76,058.88	
	CGI INC	605	87.33	52,834.65	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	57	1,460.76	83,263.32	
	OPEN TEXT CORP	973	53.52	52,074.96	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	259	1,348.76	349,328.84	
	BCE INC	435	56.20	24,447.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	57.92	56,240.32	
	TELUS CORP	1,220	24.13	29,438.60	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,915	20.66	39,563.90	
	EMERA INC	675	56.08	37,854.00	
	FORTIS INC	1,363	54.58	74,392.54	
	HYDRO ONE LTD	950	29.89	28,395.50	
加ドル小計		84,376		4,434,171.63 (353,181,770)	
ユーロ	ENI SPA	6,446	6.44	41,538.02	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,664	8.14	13,551.61	
	NESTE OYJ	854	49.00	41,846.00	
	OMV AG	339	22.00	7,458.00	
	REPSOL SA	4,851	5.82	28,252.22	
	TOTAL SE	5,937	28.08	166,710.96	
	AIR LIQUIDE SA	1,152	133.35	153,619.20	
	AKZO NOBEL	468	85.86	40,182.48	

ARCELORMITTAL	1,679	12.45	20,906.90	
ARKEMA	208	89.72	18,661.76	
BASF SE	2,348	52.27	122,729.96	
COVESTRO AG	543	43.98	23,881.14	
CRH PLC	1,668	31.29	52,191.72	
EVONIK INDUSTRIES AG	670	22.27	14,920.90	
HEIDELBERGCEMENT AG	333	53.94	17,962.02	
KONINKLIJKE DSM NV	408	141.30	57,650.40	
LANXESS AG	270	48.33	13,049.10	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	739	34.48	25,480.72	
SOLVAY SA	192	76.72	14,730.24	
STORA ENSO OYJ-R SHS	1,994	13.07	26,071.55	
SYMRISE AG	407	114.05	46,418.35	
THYSSENKRUPP AG	881	4.67	4,117.79	
UMICORE	604	34.78	21,007.12	
UPM-KYMMENE OYJ	1,142	25.81	29,475.02	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	774	22.90	17,724.60	
AIRBUS GROUP SE	1,336	68.03	90,888.08	
ALSTOM	565	41.35	23,362.75	
BOUYGUES SA	502	30.77	15,446.54	
BRENNTAG AG	402	55.20	22,190.40	
CNH INDUSTRIAL NV	3,250	7.26	23,621.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,479	35.37	52,312.23	
EIFFAGE	260	70.18	18,246.80	
FERROVIAL SA	1,472	20.66	30,411.52	
KINGSPAN GROUP PLC	450	76.00	34,200.00	
KONE OYJ-B	732	71.52	52,352.64	
LEGRAND SA	782	68.60	53,645.20	
MTU AERO ENGINES AG	116	169.30	19,638.80	
PRYSMIAN SPA	690	24.96	17,222.40	
SAFRAN SA	784	96.58	75,718.72	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,352	110.20	148,990.40	
SIEMENS AG-REG	1,783	109.66	195,523.78	
SIEMENS ENERGY AG	891	20.42	18,194.22	
THALES SA	232	64.30	14,917.60	

VINCI SA	1,219	72.84	88,791.96	
BUREAU VERITAS SA	1,035	20.46	21,176.10	
RANDSTAD NV	417	48.63	20,278.71	
TELEPERFORMANCE	136	263.50	35,836.00	
WOLTERS KLUWER	669	71.34	47,726.46	
ADP	100	89.20	8,920.00	
AENA SA	163	125.40	20,440.20	
ATLANTIA SPA	1,458	14.45	21,068.10	
DEUTSCHE POST AG-REG	2,310	40.61	93,809.10	
GETLINK	1,605	12.85	20,624.25	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	850	63.93	54,340.50	
CONTINENTAL AG	268	101.15	27,108.20	
DAIMLER AG	2,164	48.40	104,737.60	
FERRARI NV	325	160.50	52,162.50	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	2,795	11.10	31,024.50	
MICHELIN (CGDE)-B	424	98.18	41,628.32	
PEUGEOT SA	1,912	16.50	31,548.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	556	50.14	27,877.84	
RENAULT SA	379	24.77	9,387.83	
VALEO SA	847	28.01	23,724.47	
VOLKSWAGEN AG-PFD	450	139.06	62,577.00	
ADIDAS AG	466	281.80	131,318.80	
ESSILORLUXOTTICA	668	115.70	77,287.60	
HERMES INTERNATIONAL	87	825.00	71,775.00	
KERING	174	556.00	96,744.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	666	428.00	285,048.00	
MONCLER SPA	532	38.94	20,716.08	
PUMA SE	260	82.00	21,320.00	
ACCOR SA	541	24.28	13,135.48	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	381	140.05	53,359.05	
SODEXO	273	61.68	16,838.64	
PUBLICIS GROUPE	562	32.16	18,073.92	
SCOUT24 AG	240	72.25	17,340.00	
SES	642	7.21	4,630.10	
UBISOFT ENTERTAINMENT	247	80.90	19,982.30	

VIVENDI	2,083	25.43	52,970.69	
DELIVERY HERO SE	387	91.66	35,472.42	
INDITEX	2,623	24.19	63,450.37	
JUST EAT TAKEAWAY	260	101.20	26,312.00	
PROSUS	1,165	79.40	92,501.00	
ZALANDO SE	340	82.56	28,070.40	
CARREFOUR SA	1,713	13.85	23,725.05	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,733	24.31	66,439.23	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,860	48.51	90,228.60	
DANONE	1,448	51.12	74,021.76	
HEINEKEN HOLDING NV	292	71.15	20,775.80	
HEINEKEN NV	750	81.16	60,870.00	
KERRY GROUP PLC-A	390	108.40	42,276.00	
PERNOD-RICARD SA	532	147.90	78,682.80	
BEIERSDORF AG	244	99.32	24,234.08	
HENKEL AG & CO KGAA	373	83.25	31,052.25	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	404	90.62	36,610.48	
L'OREAL	602	288.60	173,737.20	
UNILEVER NV	3,548	51.10	181,302.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	670	68.64	45,988.80	
FRESENIUS SE & CO KGAA	990	34.37	34,026.30	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,167	42.16	91,371.55	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	114	383.40	43,707.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	508	38.13	19,372.58	
ARGENX SE	100	209.00	20,900.00	
BAYER AG-REG	2,403	42.42	101,947.27	
EUROFINS SCIENTIFIC	30	694.80	20,844.00	
GALAPAGOS NV	115	107.75	12,391.25	
GRIFOLS SA	713	25.09	17,889.17	
MERCK KGAA	308	131.85	40,609.80	
QIAGEN N.V.	760	41.95	31,882.00	
SANOFI	2,729	82.94	226,343.26	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	100	328.00	32,800.00	
UCB SA	286	90.48	25,877.28	
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	7.62	6,164.58	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	15,887	2.49	39,638.06	
BANCO SANTANDER SA	40,058	1.74	69,861.15	
BNP PARIBAS	2,874	33.50	96,279.00	
CAIXABANK S.A	7,994	1.71	13,725.69	
COMMERZBANK AG	3,549	4.57	16,233.12	
CREDIT AGRICOLE SA	2,542	7.51	19,105.67	
ERSTE GROUP BANK AG	838	18.34	15,368.92	
FINECOBANK SPA	1,495	11.56	17,282.20	
ING GROEP NV-CVA	8,745	6.59	57,638.29	
INTESA SANPAOLO	45,214	1.56	70,588.09	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	—	—	
KBC GROEP NV	520	45.68	23,753.60	
MEDIOBANCA SPA	1,623	6.56	10,659.86	
SOCIETE GENERALE	2,059	12.75	26,252.25	
UNICREDIT SPA	5,231	6.94	36,339.75	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,447	8.12	36,109.64	
DEUTSCHE BOERSE AG	500	137.75	68,875.00	
EXOR NV	234	48.65	11,384.10	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	292	76.42	22,314.64	
AEGON NV	4,432	2.49	11,075.56	
AGEAS	414	37.00	15,318.00	
ALLIANZ SE-REG	987	163.42	161,295.54	
ASSICURAZIONI GENERALI	3,542	12.06	42,716.52	
AXA SA	5,033	14.97	75,354.07	
HANNOVER RUECK SE-REG	148	129.60	19,180.80	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	381	211.50	80,581.50	
NN GROUP NV	906	32.55	29,490.30	
POSTE ITALIANE SPA	1,485	7.59	11,274.12	
SAMPO OYJ-A SHS	1,114	35.39	39,424.46	
SCOR SE	541	23.68	12,810.88	
AROUNDTOWN SA	4,105	4.43	18,185.15	
DEUTSCHE WOHNEN SE	978	43.58	42,621.24	
LEG IMMOBILIEN AG	250	120.06	30,015.00	
VONOVIA SE	1,430	56.52	80,823.60	
ADYEN NV	46	1,568.50	72,151.00	

	AMADEUS IT GROUP SA	1,015	46.66	47,359.90	
	ATOS SE	214	65.20	13,952.80	
	CAP GEMINI SA	449	105.80	47,504.20	
	DASSAULT SYSTEMES SA	379	148.15	56,148.85	
	EDENRED	658	42.30	27,833.40	
	SAP SE	2,481	124.90	309,876.90	
	WORLDLINE SA	704	69.88	49,195.52	
	NOKIA OYJ	15,108	3.60	54,403.90	
	CELLNEX TELECOM SA	687	53.06	36,452.22	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	7,711	13.46	103,828.61	
	ELISA OYJ	295	44.85	13,230.75	
	KONINKLIJKE KPN NV	9,792	2.40	23,520.38	
	ORANGE S.A.	4,593	9.51	43,716.17	
	TELEFONICA SA	11,463	3.07	35,248.72	
	E.ON SE	5,278	9.52	50,288.78	
	EDF	1,761	10.43	18,376.03	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	6,771	4.37	29,650.20	
	ENAGAS SA	630	19.71	12,417.30	
	ENDESA SA	822	24.11	19,818.42	
	ENEL SPA	19,815	7.56	149,979.73	
	ENGIE	4,325	11.36	49,153.62	
	FORTUM OYJ	1,026	17.38	17,837.01	
	IBERDROLA SA	14,466	10.70	154,858.53	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	720	17.76	12,787.20	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	989	16.06	15,888.28	
	RWE AG	1,273	33.20	42,263.60	
	SNAM SPA	7,266	4.34	31,563.50	
	TERNA SPA	4,271	5.98	25,540.58	
	UNIPER SE	695	27.04	18,792.80	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,423	17.35	24,689.05	
	ASML HOLDING NV	1,020	316.60	322,932.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,929	26.80	78,497.20	
	STMICROELECTRONICS NV	1,501	28.61	42,943.61	
ユーロ小計		419,225		8,968,502.37 (1,112,273,663)	

英ポンド	BP PLC	47,290	2.05	97,180.95	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	10,047	9.71	97,636.74	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	8,320	9.40	78,257.92	
	ANGLO AMERICAN PLC	3,254	19.84	64,572.37	
	BHP GROUP PLC	4,911	16.08	79,008.16	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	270	62.64	16,912.80	
	GLENCORE PLC	25,062	1.67	41,973.83	
	JOHNSON MATTHEY PLC	515	23.75	12,231.25	
	MONDI PLC	1,379	15.93	21,974.36	
	RIO TINTO PLC	2,741	45.78	125,482.98	
	ASHTEAD GROUP PLC	986	29.75	29,333.50	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	7,623	4.58	34,913.34	
	BUNZL PLC	865	24.66	21,330.90	
	DCC PLC	217	50.28	10,910.76	
	FERGUSON PLC	539	80.72	43,508.08	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	11,311	1.32	15,026.66	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,577	2.43	8,717.14	
	SMITHS GROUP PLC	845	14.23	12,028.57	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	235	114.65	26,942.75	
	EXPERIAN PLC	2,432	29.70	72,230.40	
	INTERTEK GROUP PLC	389	59.96	23,324.44	
	RELX PLC	4,419	16.35	72,250.65	
	RENTOKIL INITIAL PLC	4,172	5.54	23,112.88	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	5.41	12,745.96	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	315	42.68	13,444.20	
	BURBERRY GROUP PLC	993	14.88	14,775.84	
	PERSIMMON PLC	663	25.93	17,191.59	
	TAYLOR WIMPEY PLC	6,807	1.19	8,127.55	
	COMPASS GROUP PLC	5,146	11.50	59,179.00	
	GVC HOLDINGS PLC	1,075	10.04	10,793.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	393	42.01	16,509.93	
	WHITBREAD PLC	639	23.86	15,246.54	
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	5.91	17,227.65	
	INFORMA PLC	5,309	4.49	23,837.41	
	PEARSON PLC	2,704	5.12	13,855.29	

WPP PLC	2,617	6.65	17,413.51	
KINGFISHER PLC	6,190	3.20	19,814.19	
NEXT PLC	290	63.28	18,351.20	
OCADO GROUP PLC	1,268	23.13	29,328.84	
TESCO PLC	22,567	2.14	48,315.94	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	17.32	14,843.24	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,330	25.72	137,087.60	
COCA-COLA HBC AG-CDI	556	19.74	10,975.44	
DIAGEO PLC	5,687	26.28	149,482.79	
IMPERIAL BRANDS PLC	2,179	13.00	28,327.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,735	70.00	121,450.00	
UNILEVER PLC	2,747	46.94	128,944.18	
SMITH & NEPHEW PLC	1,973	14.56	28,736.74	
ASTRAZENECA PLC	3,156	79.43	250,681.08	
GLAXOSMITHKLINE PLC	12,142	13.43	163,164.19	
BARCLAYS PLC	36,980	1.11	41,247.49	
HSBC HOLDINGS PLC	49,395	3.21	158,755.53	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	205,518	0.29	60,185.94	
NATWEST GROUP PLC	9,505	1.22	11,672.14	
STANDARD CHARTERED PLC	5,798	3.99	23,157.21	
3I GROUP PLC	2,022	10.67	21,574.74	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	913	14.14	12,909.82	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	714	84.38	60,247.32	
M&G PLC	5,002	1.68	8,443.37	
ST JAMES'S PLACE PLC	1,607	9.37	15,057.59	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	6,446	2.42	15,631.55	
AVIVA PLC	8,042	2.78	22,364.80	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	12,544	1.97	24,761.85	
PRUDENTIAL PLC	5,992	10.79	64,653.68	
RSA INSURANCE GROUP PLC	2,591	4.43	11,493.67	
SAGE GROUP PLC/THE	3,107	6.94	21,562.58	
HALMA PLC	1,095	24.44	26,761.80	
BT GROUP PLC	21,498	1.04	22,476.15	
VODAFONE GROUP PLC	63,095	1.12	71,044.97	
NATIONAL GRID PLC	7,941	9.45	75,042.45	

	SEVERN TRENT PLC	445	25.32	11,267.40	
	SSE PLC	2,314	13.37	30,938.18	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	8.90	14,495.71	
英ポンド小計		694,200		3,244,457.27 (443,355,085)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	22	3,874.00	85,228.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1,085	42.49	46,101.65	
	SIKA AG-REG	336	231.20	77,683.20	
	ABB LTD-REG	4,212	23.61	99,445.32	
	GEBERIT AG-REG	81	543.40	44,015.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	248.30	36,003.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	50.96	21,352.24	
	SGS SA-REG	14	2,380.00	33,320.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	164	188.10	30,848.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,403	63.00	88,389.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	208.30	19,788.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	10	2,010.00	20,100.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4	7,485.00	29,940.00	
	NESTLE SA-REG	7,098	106.56	756,362.88	
	ALCON INC	1,263	56.46	71,308.98	
	SONOVA HOLDING AG-REG	153	236.20	36,138.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	29	997.00	28,913.00	
	LONZA GROUP AG-REG	176	575.00	101,200.00	
	NOVARTIS AG-REG	5,298	76.48	405,191.04	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,671	297.40	496,955.40	
	VIFOR PHARMA AG	141	112.80	15,904.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5,786	9.87	57,154.10	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	43.80	25,360.20	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	44	855.60	37,646.40	
	UBS GROUP AG-REG	8,374	11.26	94,291.24	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	132.00	21,120.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	63	337.10	21,237.30	
	SWISS RE AG	623	67.98	42,351.54	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	370	315.10	116,587.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	215	79.60	17,114.00	

	TEMENOS AG	155	106.65	16,530.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	360	78.98	28,432.80	
	SWISSCOM AG-REG	56	469.80	26,308.80	
スイスフラン小計		40,604		3,048,324.04 (352,813,024)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	650	178.65	116,122.50	
	BOLIDEN AB	995	261.10	259,794.50	
	ALFA LAVAL AB	950	192.75	183,112.50	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	206.20	559,420.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,445	406.90	587,970.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,038	352.50	365,895.00	
	EPIROC AB-A	2,500	135.75	339,375.00	
	EPIROC AB-B	603	131.60	79,354.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	710	220.80	156,768.00	
	SANDVIK AB	3,333	174.95	583,108.35	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	181.40	191,558.40	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	190.50	214,312.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	3,384	183.45	620,794.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	430	205.20	88,236.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	290	703.40	203,986.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,569	158.05	247,980.45	
	SWEDISH MATCH AB	379	681.80	258,402.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,300	272.70	354,510.00	
	NORDEA BANK ABP	7,162	70.55	505,279.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	3,860	83.64	322,850.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,151	77.82	245,210.82	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,076	149.50	310,362.00	
	INVESTOR AB-B SHS	968	565.60	547,500.80	
	KINNEVIK AB - B	550	376.30	206,965.00	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	108.45	839,511.45	
	HEXAGON AB-B SHS	863	667.60	576,138.80	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	109.90	160,454.00	
	TELIA CO AB	8,145	36.18	294,686.10	
スウェーデンクローナ小計		60,446		9,419,660.57 (112,659,140)	

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	2,431	131.65	320,041.15	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	345.60	148,262.40	
	MOWI ASA	1,466	164.05	240,497.30	
	ORKLA ASA	1,924	91.22	175,507.28	
	DNB ASA	2,071	140.00	289,940.00	
	TELENOR ASA	2,000	153.70	307,400.00	
ノルウェークローネ小計		10,321		1,481,648.13 (16,757,440)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	320	656.80	210,176.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	711	391.50	278,356.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	470	1,062.00	499,140.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	22	10,285.00	226,270.00	
	DSV PANALPINA A S	452	1,045.00	472,340.00	
	PANDORA A/S	209	534.00	111,606.00	
	CARLSBERG AS-B	339	854.00	289,506.00	
	COLOPLAST-B	302	973.80	294,087.60	
	GN STORE NORD A/S	290	479.70	139,113.00	
	GENMAB A/S	153	2,210.00	338,130.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	4,105	445.25	1,827,751.25	
	DANSKE BANK A/S	2,079	93.76	194,927.04	
	ORSTED A/S	438	974.40	426,787.20	
デンマーククローネ小計		9,890		5,308,190.59 (88,487,537)	
豪ドル	AMPOL LTD	730	25.84	18,863.20	
	ORIGIN ENERGY LTD	6,145	4.36	26,792.20	
	SANTOS LTD	3,916	5.28	20,676.48	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,652	18.48	49,008.96	
	BHP GROUP LTD	7,083	36.00	254,988.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,660	15.92	26,427.20	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	3,879	16.72	64,856.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	36.00	47,016.00	
	NEWCREST MINING LTD	2,263	30.71	69,496.73	
	RIO TINTO LTD	956	95.40	91,202.40	
	SOUTH32 LTD	16,210	2.22	35,986.20	
	CIMIC GROUP LTD	130	22.43	2,915.90	

	BRAMBLES LTD	3,858	10.26	39,583.08	
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,319	4.00	21,276.00	
	SYDNEY AIRPORT	3,332	5.99	19,958.68	
	TRANSURBAN GROUP	7,052	13.99	98,657.48	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,588	32.21	51,149.48	
	SEEK LTD	1,090	23.01	25,080.90	
	WESFARMERS LTD	2,988	46.92	140,196.96	
	COLES GROUP LTD	3,302	17.19	56,761.38	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	3,094	38.82	120,109.08	
	COCHLEAR LTD	227	224.99	51,072.73	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	644	64.67	41,647.48	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	36.40	43,243.20	
	CSL LTD	1,079	294.82	318,110.78	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	7,128	19.78	140,991.84	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,234	69.90	295,956.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,660	19.53	149,599.80	
	WESTPAC BANKING CORP	8,722	18.78	163,799.16	
	ASX LTD	514	81.32	41,798.48	
	MACQUARIE GROUP LTD	814	136.18	110,850.52	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	330	59.27	19,559.10	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	4.84	39,479.88	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	8.86	34,323.64	
	SUNCORP GROUP LTD	4,089	8.75	35,778.75	
	AFTERPAY LTD	490	102.13	50,043.70	
	COMPUTERSHARE LTD	1,590	12.89	20,495.10	
	TELSTRA CORPORATION LTD	10,933	2.73	29,847.09	
	AGL ENERGY LTD	2,231	13.15	29,337.65	
	APA GROUP	4,476	10.72	47,982.72	
豪ドル小計		146,933		2,944,921.41 (219,838,383)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,190	7.36	23,478.40	
	A2 MILK CO LTD	2,139	15.37	32,876.43	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	35.86	53,359.68	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	6,030	4.62	27,858.60	
		12,847		137,573.11	

ニュージーランドドル小計				(9,635,620)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,598	46.40	352,547.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	106.20	424,800.00	
	MTR CORP	5,500	39.05	214,775.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	7,000	54.25	379,750.00	
	SANDS CHINA LTD	7,000	29.35	205,450.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	5,100	24.65	125,715.00	
	WH GROUP LTD	32,000	6.33	202,560.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,000	14.36	43,080.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	13,000	22.05	286,650.00	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	121.70	261,655.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,971	368.00	1,093,328.00	
	AIA GROUP LTD	28,063	78.15	2,193,123.45	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	7,598	37.55	285,304.90	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,200	29.05	122,010.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	4,750	38.20	181,450.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	3,433	98.00	336,434.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	73.00	342,662.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	31,208	11.34	353,898.72	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	40.65	162,600.00	
香港ドル小計		177,265		7,567,793.27 (102,240,887)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	5,283	4.51	23,826.33	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	6,300	4.24	26,712.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,802	21.55	103,483.10	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,108	8.81	80,241.48	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,542	20.08	71,123.36	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,600	9.06	23,556.00	
	CAPITALAND LTD	8,911	2.71	24,148.81	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	24,200	2.12	51,304.00	
シンガポールドル小計		64,746		404,395.08 (31,195,036)	
イスラエルシュケル	BANK HAPOALIM BM	4,308	20.75	89,391.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,406	16.84	57,357.04	
	NICE LTD	172	773.50	133,042.00	

イスラエルシュケル小計	7,886		279,790.04 (8,679,087)	
合　　計	2,456,516		10,325,179,492 (10,325,179,492)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	1,361	19,312.59	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	273	43,827.42	
		AMERICAN TOWER CORP	1,070	254,360.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	3,008	21,747.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	316	46,069.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	326	25,320.42	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	369	34,091.91	
		CROWN CASTLE INTL CORP	972	154,032.84	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	588	89,728.80	
		DUKE REALTY CORPORATION	777	30,264.15	
		EQUINIX INC	216	167,838.48	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	630	39,230.10	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	1,097	56,287.07	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	145	29,468.35	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	323	38,327.18	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	194	14,883.68	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,109	31,905.93	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	22,895.88	
		INVITATION HOMES INC	1,378	40,058.46	
		IRON MOUNTAIN INC	818	22,781.30	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,010	18,483.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	270	32,051.70	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	652	22,950.40	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	620	19,176.60	
		PROLOGIS INC	1,736	179,224.64	

		PUBLIC STORAGE	377	88,866.44	
		REALTY INCOME CORP	957	58,137.75	
		REGENCY CENTERS CORP	482	18,455.78	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	240	72,506.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	749	50,093.12	
		SUN COMMUNITIES INC	230	32,568.00	
		UDR INC	680	22,297.20	
		VENTAS INC	800	33,792.00	
		VEREIT INC	4,089	27,600.75	
		VICI PROPERTIES INC	1,035	24,953.85	
		VORNADO REALTY TRUST	436	14,854.52	
		WELLTOWER INC	1,068	60,085.68	
		WEYERHAEUSER CO	1,733	51,002.19	
		WP CAREY INC	594	39,673.26	
米ドル小計			34,695	2,049,205.72 (214,551,838)	
ユーロ	投資証券	GECINA SA	150	16,605.00	
		KLEPIERRE	588	7,291.20	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	13,338.00	
ユーロ小計			1,089	37,234.20 (4,617,785)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	3,140	11,938.28	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	9,405.08	
		SEGRO PLC	3,361	31,458.96	
英ポンド小計			8,195	52,802.32 (7,215,437)	
豪ドル	投資証券	DEXUS	2,875	26,565.00	
		GOODMAN GROUP	4,311	79,624.17	
		GPT GROUP	5,900	24,721.00	
		LENDLEASE GROUP	1,550	19,561.00	
		MIRVAC GROUP	11,628	25,581.60	
		SCENTRE GROUP	11,481	26,061.87	
		STOCKLAND	5,114	20,456.00	
		VICINITY CENTRES	10,480	13,886.00	
豪ドル小計			53,339	236,456.64 (17,651,488)	

香港ドル	投資証券	LINK REIT	5,967	369,655.65	
香港ドル小計			5,967	369,655.65 (4,994,047)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	9,800	30,184.00	
シンガポールドル小計			9,800	30,184.00 (2,328,393)	
合計				251,358,988 (251,358,988)	

(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	565銘柄	97.2%	—	70.7%
	投資証券	39銘柄	—	2.8%	2.0%
加ドル	株式	60銘柄	100.0%	—	3.3%
ユーロ	株式	181銘柄	99.6%	—	10.5%
	投資証券	3銘柄	—	0.4%	0.0%
英ポンド	株式	73銘柄	98.4%	—	4.2%
	投資証券	3銘柄	—	1.6%	0.1%
スイスフラン	株式	33銘柄	100.0%	—	3.3%
スウェーデンクローナ	株式	28銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式	6銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	13銘柄	100.0%	—	0.8%
豪ドル	株式	40銘柄	92.6%	—	2.1%
	投資証券	8銘柄	—	7.4%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式	19銘柄	95.3%	—	1.0%
	投資証券	1銘柄	—	4.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	8銘柄	93.1%	—	0.3%
	投資証券	1銘柄	—	6.9%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	167,968,244	211,983,356
国債証券	31,964,995,556	33,233,854,647
地方債証券	3,166,772,000	3,257,020,000
特殊債券	3,263,504,000	4,609,275,000
社債券	2,753,050,000	2,433,814,438
未収利息	80,383,938	82,296,959
前払費用	1,407,203	1,250,848
流動資産合計	41,398,080,941	43,829,495,248
資産合計	41,398,080,941	43,829,495,248
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,446,973	22,272,541
未払利息	46	59
流動負債合計	7,447,019	22,272,600
負債合計	7,447,019	22,272,600
純資産の部		
元本等		
元本	28,913,282,954	31,007,104,895
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	12,477,350,968	12,800,117,753
元本等合計	41,390,633,922	43,807,222,648
純資産合計	41,390,633,922	43,807,222,648
負債純資産合計	41,398,080,941	43,829,495,248

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）

		2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
1．	期首	2018年10月27日	2019年10月29日
	期首元本額	27,733,551,245円	28,913,282,954円
	期首からの追加設定元本額	3,514,710,092円	6,276,681,341円
	期首からの一部解約元本額	2,334,978,383円	4,182,859,400円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	2,535,930,689円	3,299,809,640円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	2,322,233,086円	2,929,229,354円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	1,675,794,828円	2,061,514,447円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	259,508,561円	316,092,415円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	1,955,743,762円	2,146,139,820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	3,612,132,571円	3,542,424,372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）	1,528,015,066円	1,593,046,655円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,277,309円	4,546,069円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	25,114,375円	24,979,029円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	120,247,275円	96,410,954円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	272,928,864円	254,848,043円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,280,739,177円	4,110,973,037円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,312,679,950円	1,390,321,836円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,273,971,733円	1,314,190,148円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	679,086,849円	714,039,343円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	97,643,471円	102,165,160円
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	6,654,000,097円	6,790,875,434円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	303,235,291円	315,499,139円
	計	28,913,282,954円	31,007,104,895円

2．	受益権の総数	28,913,282,954口	31,007,104,895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 2018年10月27日 至 2019年10月28日	自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△846,332,693
地方債証券	△15,749,000
特殊債券	△27,205,000
社債券	△17,321,562
合計	△906,608,255

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2019年10月28日現在		2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4315円	1口当たり純資産額	1.4128円
(1万口当たり純資産額)	(14,315円)	(1万口当たり純資産額)	(14,128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	102,291,700	
	第２回利付国債（４０年）	95,000,000	134,653,000	
	第３回利付国債（４０年）	70,000,000	99,730,400	
	第４回利付国債（４０年）	95,000,000	135,996,300	
	第５回利付国債（４０年）	35,000,000	48,521,550	
	第６回利付国債（４０年）	70,000,000	95,720,100	
	第７回利付国債（４０年）	50,000,000	65,850,500	
	第８回利付国債（４０年）	95,000,000	117,001,050	
	第９回利付国債（４０年）	130,000,000	119,785,900	
	第１０回利付国債（４０年）	125,000,000	134,991,250	
	第１１回利付国債（４０年）	140,000,000	146,757,800	
	第１２回利付国債（４０年）	175,000,000	165,914,000	
	第１３回利付国債（４０年）	80,000,000	75,760,800	
	第３１３回利付国債（１０年）	370,000,000	372,256,605	
	第３１７回利付国債（１０年）	105,000,000	106,186,482	
	第３１８回利付国債（１０年）	185,000,000	186,924,175	
	第３１９回利付国債（１０年）	5,000,000	5,070,400	
	第３２０回利付国債（１０年）	190,000,000	192,456,700	
	第３２１回利付国債（１０年）	175,000,000	177,761,500	
	第３２２回利付国債（１０年）	75,000,000	76,078,500	
	第３２３回利付国債（１０年）	45,000,000	45,768,600	

第３２４回利付国債（１０年）	25,000,000	25,385,500	
第３２５回利付国債（１０年）	210,000,000	213,735,900	
第３２６回利付国債（１０年）	30,000,000	30,536,100	
第３２７回利付国債（１０年）	65,000,000	66,301,950	
第３２８回利付国債（１０年）	115,000,000	117,029,750	
第３２９回利付国債（１０年）	230,000,000	235,678,700	
第３３０回利付国債（１０年）	210,000,000	215,680,500	
第３３１回利付国債（１０年）	80,000,000	81,699,200	
第３３３回利付国債（１０年）	210,000,000	215,189,100	
第３３４回利付国債（１０年）	120,000,000	123,208,800	
第３３５回利付国債（１０年）	490,000,000	501,995,200	
第３３６回利付国債（１０年）	80,000,000	82,084,000	
第３３７回利付国債（１０年）	30,000,000	30,531,600	
第３３８回利付国債（１０年）	390,000,000	399,044,100	
第３３９回利付国債（１０年）	370,000,000	378,809,700	
第３４０回利付国債（１０年）	420,000,000	430,336,200	
第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	714,672,000	
第３４２回利付国債（１０年）	130,000,000	131,409,200	
第３４３回利付国債（１０年）	245,000,000	247,780,750	
第３４４回利付国債（１０年）	50,000,000	50,593,000	
第３４５回利付国債（１０年）	610,000,000	617,545,700	
第３４６回利付国債（１０年）	490,000,000	496,306,300	
第３４７回利付国債（１０年）	160,000,000	162,086,400	
第３４８回利付国債（１０年）	90,000,000	91,186,200	
第３４９回利付国債（１０年）	490,000,000	496,517,000	
第３５０回利付国債（１０年）	480,000,000	486,422,400	
第３５１回利付国債（１０年）	435,000,000	440,681,100	
第３５２回利付国債（１０年）	390,000,000	394,949,100	
第３５３回利付国債（１０年）	200,000,000	202,454,000	
第３５４回利付国債（１０年）	125,000,000	126,473,750	
第３５５回利付国債（１０年）	150,000,000	151,689,000	
第３５６回利付国債（１０年）	200,000,000	202,048,000	
第３５７回利付国債（１０年）	820,000,000	827,872,000	
第３５８回利付国債（１０年）	370,000,000	373,300,400	
第３５９回利付国債（１０年）	100,000,000	100,770,000	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	62,458,000	

第１４回利付国債（３０年）	108,000,000	139,540,320	
第１５回利付国債（３０年）	147,000,000	192,552,360	
第１６回利付国債（３０年）	35,000,000	45,978,800	
第１８回利付国債（３０年）	110,000,000	142,221,200	
第２１回利付国債（３０年）	20,000,000	26,060,000	
第２２回利付国債（３０年）	40,000,000	53,460,400	
第２３回利付国債（３０年）	55,000,000	73,689,000	
第２４回利付国債（３０年）	68,000,000	91,324,680	
第２５回利付国債（３０年）	20,000,000	26,322,800	
第２６回利付国債（３０年）	170,000,000	227,024,800	
第２７回利付国債（３０年）	29,000,000	39,387,800	
第２８回利付国債（３０年）	94,000,000	128,293,080	
第２９回利付国債（３０年）	176,000,000	238,173,760	
第３０回利付国債（３０年）	147,000,000	197,390,130	
第３１回利付国債（３０年）	120,000,000	159,776,400	
第３２回利付国債（３０年）	50,000,000	67,830,500	
第３３回利付国債（３０年）	135,000,000	176,110,200	
第３４回利付国債（３０年）	200,000,000	269,406,000	
第３５回利付国債（３０年）	168,000,000	220,478,160	
第３６回利付国債（３０年）	135,000,000	177,743,700	
第３７回利付国債（３０年）	131,000,000	170,393,010	
第３８回利付国債（３０年）	95,000,000	121,959,100	
第３９回利付国債（３０年）	75,000,000	97,953,750	
第４０回利付国債（３０年）	90,000,000	115,703,100	
第４１回利付国債（３０年）	40,000,000	50,641,200	
第４２回利付国債（３０年）	135,000,000	171,080,100	
第４３回利付国債（３０年）	155,000,000	196,617,500	
第４４回利付国債（３０年）	150,000,000	190,458,000	
第４５回利付国債（３０年）	160,000,000	196,164,800	
第４６回利付国債（３０年）	250,000,000	306,690,000	
第４７回利付国債（３０年）	165,000,000	206,410,050	
第４８回利付国債（３０年）	85,000,000	102,391,850	
第４９回利付国債（３０年）	90,000,000	108,457,200	
第５０回利付国債（３０年）	25,000,000	26,600,000	
第５１回利付国債（３０年）	70,000,000	66,066,000	
第５２回利付国債（３０年）	90,000,000	89,080,200	

第５３回利付国債（３０年）	105,000,000	106,320,900	
第５４回利付国債（３０年）	110,000,000	116,606,600	
第５５回利付国債（３０年）	110,000,000	116,526,300	
第５６回利付国債（３０年）	50,000,000	52,929,000	
第５７回利付国債（３０年）	100,000,000	105,780,000	
第５８回利付国債（３０年）	100,000,000	105,700,000	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	175,276,800	
第６０回利付国債（３０年）	120,000,000	129,687,600	
第６１回利付国債（３０年）	70,000,000	71,945,300	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	116,946,000	
第６３回利付国債（３０年）	90,000,000	85,183,200	
第６４回利付国債（３０年）	100,000,000	94,492,000	
第６５回利付国債（３０年）	110,000,000	103,769,600	
第６６回利付国債（３０年）	180,000,000	169,520,400	
第６７回利付国債（３０年）	110,000,000	109,175,000	
第５０回利付国債（２０年）	237,000,000	239,048,109	
第５１回利付国債（２０年）	39,000,000	39,551,226	
第５４回利付国債（２０年）	15,000,000	15,400,800	
第５５回利付国債（２０年）	66,000,000	67,967,460	
第５７回利付国債（２０年）	52,000,000	53,746,160	
第５８回利付国債（２０年）	135,000,000	140,228,550	
第５９回利付国債（２０年）	33,000,000	34,300,530	
第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	304,720,250	
第６１回利付国債（２０年）	27,000,000	27,736,020	
第６３回利付国債（２０年）	31,000,000	32,588,750	
第６４回利付国債（２０年）	54,000,000	57,181,140	
第６５回利付国債（２０年）	100,000,000	106,399,000	
第６６回利付国債（２０年）	34,000,000	36,068,220	
第６７回利付国債（２０年）	34,000,000	36,347,020	
第６８回利付国債（２０年）	78,000,000	84,181,500	
第７０回利付国債（２０年）	104,000,000	113,639,760	
第７２回利付国債（２０年）	112,000,000	121,761,920	
第７３回利付国債（２０年）	113,000,000	122,985,810	
第７４回利付国債（２０年）	118,000,000	128,919,720	
第７５回利付国債（２０年）	10,000,000	10,980,700	
第７６回利付国債（２０年）	21,000,000	22,873,830	

第７７回利付国債（２０年）	40,000,000	43,746,000	
第７９回利付国債（２０年）	160,000,000	175,724,800	
第８２回利付国債（２０年）	60,000,000	66,481,200	
第８７回利付国債（２０年）	130,000,000	146,216,200	
第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	340,884,000	
第９０回利付国債（２０年）	16,000,000	18,183,520	
第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	285,600,000	
第９２回利付国債（２０年）	60,000,000	68,165,400	
第９３回利付国債（２０年）	60,000,000	68,108,400	
第９４回利付国債（２０年）	50,000,000	57,079,000	
第９５回利付国債（２０年）	82,000,000	95,103,600	
第９６回利付国債（２０年）	98,000,000	112,350,140	
第９７回利付国債（２０年）	45,000,000	52,135,200	
第９８回利付国債（２０年）	94,000,000	108,252,280	
第９９回利付国債（２０年）	117,000,000	135,336,240	
第１００回利付国債（２０年）	30,000,000	35,074,800	
第１０１回利付国債（２０年）	66,000,000	78,145,980	
第１０２回利付国債（２０年）	81,000,000	96,380,280	
第１０３回利付国債（２０年）	11,000,000	13,004,090	
第１０４回利付国債（２０年）	33,000,000	38,505,060	
第１０５回利付国債（２０年）	77,000,000	90,163,150	
第１０６回利付国債（２０年）	2,000,000	2,357,780	
第１０７回利付国債（２０年）	130,000,000	152,865,700	
第１０８回利付国債（２０年）	134,000,000	155,377,020	
第１０９回利付国債（２０年）	27,000,000	31,411,800	
第１１０回利付国債（２０年）	98,000,000	115,663,520	
第１１１回利付国債（２０年）	25,000,000	29,833,000	
第１１２回利付国債（２０年）	80,000,000	94,772,000	
第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	344,650,500	
第１１４回利付国債（２０年）	52,000,000	62,017,800	
第１１５回利付国債（２０年）	125,000,000	150,225,000	
第１１６回利付国債（２０年）	55,000,000	66,336,050	
第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	410,474,960	
第１１８回利付国債（２０年）	10,000,000	11,906,300	
第１１９回利付国債（２０年）	30,000,000	35,141,100	
第１２０回利付国債（２０年）	170,000,000	195,860,400	

第１２１回利付国債（２０年）	22,000,000	26,060,100	
第１２２回利付国債（２０年）	17,000,000	19,969,560	
第１２３回利付国債（２０年）	195,000,000	235,599,000	
第１２４回利付国債（２０年）	190,000,000	227,637,100	
第１２５回利付国債（２０年）	50,000,000	61,116,000	
第１２６回利付国債（２０年）	105,000,000	126,172,200	
第１２８回利付国債（２０年）	65,000,000	77,652,250	
第１２９回利付国債（２０年）	85,000,000	100,645,950	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	178,066,500	
第１３１回利付国債（２０年）	12,000,000	14,115,600	
第１３２回利付国債（２０年）	75,000,000	88,425,000	
第１３３回利付国債（２０年）	30,000,000	35,701,200	
第１３４回利付国債（２０年）	50,000,000	59,643,000	
第１３５回利付国債（２０年）	30,000,000	35,447,400	
第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	257,468,200	
第１３７回利付国債（２０年）	200,000,000	236,702,000	
第１３８回利付国債（２０年）	120,000,000	139,260,000	
第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	269,562,300	
第１４０回利付国債（２０年）	448,000,000	531,345,920	
第１４１回利付国債（２０年）	195,000,000	231,749,700	
第１４２回利付国債（２０年）	125,000,000	150,053,750	
第１４３回利付国債（２０年）	94,000,000	110,787,460	
第１４４回利付国債（２０年）	430,000,000	501,552,000	
第１４５回利付国債（２０年）	355,000,000	423,554,050	
第１４６回利付国債（２０年）	135,000,000	161,374,950	
第１４７回利付国債（２０年）	60,000,000	71,079,600	
第１４８回利付国債（２０年）	90,000,000	105,606,900	
第１４９回利付国債（２０年）	115,000,000	135,128,450	
第１５０回利付国債（２０年）	90,000,000	104,674,500	
第１５１回利付国債（２０年）	70,000,000	79,576,000	
第１５２回利付国債（２０年）	350,000,000	398,132,000	
第１５３回利付国債（２０年）	450,000,000	518,589,000	
第１５４回利付国債（２０年）	160,000,000	182,224,000	
第１５５回利付国債（２０年）	250,000,000	277,567,500	
第１５６回利付国債（２０年）	110,000,000	112,195,600	
第１５７回利付国債（２０年）	50,000,000	49,400,000	

	第１５８回利付国債（２０年）	170,000,000	175,559,000	
	第１５９回利付国債（２０年）	150,000,000	157,171,500	
	第１６０回利付国債（２０年）	140,000,000	148,866,200	
	第１６１回利付国債（２０年）	120,000,000	125,607,600	
	第１６２回利付国債（２０年）	70,000,000	73,200,400	
	第１６３回利付国債（２０年）	165,000,000	172,368,900	
	第１６４回利付国債（２０年）	285,000,000	292,729,200	
	第１６５回利付国債（２０年）	60,000,000	61,546,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	100,000,000	105,895,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	160,000,000	163,814,400	
	第１６８回利付国債（２０年）	100,000,000	100,516,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	160,000,000	157,769,600	
	第１７０回利付国債（２０年）	140,000,000	137,902,800	
	第１７１回利付国債（２０年）	170,000,000	167,273,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	230,000,000	230,414,000	
	第１７３回利付国債（２０年）	150,000,000	150,000,000	
国債証券 合計		30,150,000,000	33,233,854,647	
地方債証券	第７０８回東京都公募公債	100,000,000	101,434,000	
	第７０９回東京都公募公債	100,000,000	101,253,000	
	第７１２回東京都公募公債	200,000,000	202,850,000	
	第７３０回東京都公募公債	100,000,000	102,184,000	
	第７３１回東京都公募公債	100,000,000	102,086,000	
	平成２４年度第２回京都府公募公債	200,000,000	202,934,000	
	平成２５年度第１０回静岡県公募公債	200,000,000	204,428,000	
	平成２６年度第１２回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,954,000	
	平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,543,000	
	平成２４年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	101,882,000	
	平成２６年度第３回埼玉県公募公債	200,000,000	204,630,000	
	平成２４年度第９回福岡県公募公債	100,000,000	101,494,000	
	平成２６年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	101,790,000	
	第１０回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	102,000,000	
	平成２５年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	102,310,000	
	平成２６年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	102,096,000	
	平成２４年度第１回長崎県公募公債	100,000,000	101,538,000	
	平成２７年度第１回佐賀県公募公債	100,000,000	102,164,000	
	平成２７年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	102,285,000	

	第４８６回名古屋市公募公債（１０年）	200,000,000	204,572,000	
	平成２７年度第５回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	102,207,000	
	第５１回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,000,000	
	第５３回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,023,000	
	平成２５年度第２回福井県公募公債	200,000,000	203,954,000	
	平成２３年度第２回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	101,409,000	
地方債証券 合計		3,200,000,000	3,257,020,000	
特殊債券	第１回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,539,000	
	第２回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,391,000	
	第５回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,931,000	
	第５回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,480,000	
	第１３回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	203,692,000	
	第１４回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,290,000	
	第１６回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,624,000	
	第２２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,164,000	
	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	101,465,000	
	第３５回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	200,058,000	
	第６０回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,006,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	103,245,000	
	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	114,603,000	
	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	115,992,000	
	第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,948,000	
	第８６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,285,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,640,000	
	第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,203,000	
	第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,781,000	
	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	101,134,000	
	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	102,346,000	
	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	201,246,000	
	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	100,841,000	

	第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,179,000	
	第１３回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,884,000	
	第４５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,610,000	
	Ｆ６３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,187,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,552,000	
	Ｆ２２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,818,000	
	Ｆ２９０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,972,000	
	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	101,491,000	
	第５２回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,732,000	
	第３８回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,257,000	
	第３９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,310,000	
	第１９回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,215,000	
	第３２０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,000,000	
	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	100,146,000	
特殊債券 合計		4,500,000,000	4,609,275,000	
社債券	第１５回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,284,000	
	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	102,330,000	
	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	200,856,000	
	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	200,304,000	
	第１０回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,399,000	
	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	101,294,000	
	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	99,913,000	
	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	101,482,000	
	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	103,202,000	
	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	105,632,000	
	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	203,220,000	
	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	102,219,000	

	第１１回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,266,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	202,168,000	
	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	101,993,000	
	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	99,838,000	
	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	101,420,000	
	第２９９回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,091,000	
	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	201,903,438	
社債券 合計		2,400,000,000	2,433,814,438	
合計		40,250,000,000	43,533,964,085	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	197,170,172	94,568,404
コール・ローン	42,416,845	18,168,132
国債証券	153,398,988,437	151,573,682,113
派生商品評価勘定	-	46,431
未収入金	-	165,967,376
未収利息	1,250,297,032	1,147,349,861
前払費用	24,113,142	29,999,629
流動資産合計	154,912,985,628	153,029,781,946
資産合計	154,912,985,628	153,029,781,946
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	36,630	163,507
未払解約金	77,116,063	194,737,553
未払利息	11	5
流動負債合計	77,152,704	194,901,065
負債合計	77,152,704	194,901,065
純資産の部		
元本等		
元本	66,014,655,688	62,305,294,771
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	88,821,177,236	90,529,586,110
元本等合計	154,835,832,924	152,834,880,881
純資産合計	154,835,832,924	152,834,880,881
負債純資産合計	154,912,985,628	153,029,781,946

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）

		2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
1．	期首	2018年10月27日	2019年10月29日
	期首元本額	66,172,631,391円	66,014,655,688円
	期首からの追加設定元本額	2,720,902,002円	7,433,213,464円
	期首からの一部解約元本額	2,878,877,705円	11,142,574,381円
	元本の内訳　※ インデックスファンド海外債券ヘッジなし（ＤＣ専用）	12,643,238,374円	13,606,901,842円

	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	239,828,273円	290,429,905円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	316,392,308円	372,429,728円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	410,335,597円	471,286,049円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	316,679,082円	361,323,232円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	24,749,651,028円	22,100,204,303円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,264,393,398円	2,032,710,032円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	17,569,671,668円	15,849,657,187円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	875,736,013円	1,006,742,263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）	157,572,835円	150,608,646円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	2,657,723円	2,599,441円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	3,073,153円	2,854,393円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	8,243,513円	6,124,228円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	12,955,389円	11,219,101円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	858,147,704円	792,945,418円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	896,266,419円	782,824,655円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	61,561,077円	61,105,570円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	86,960,516円	83,466,931円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	83,907,131円	81,761,903円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	60,614,848円	58,449,486円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）１年決算型	4,128,997,767円	3,900,506,886円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	267,771,872円	279,143,572円
	計	66,014,655,688円	62,305,294,771円
２．	受益権の総数	66,014,655,688口	62,305,294,771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 2018年10月27日 至 2019年10月28日	自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,153,948,724
合計	4,153,948,724

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

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

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,634,190	－	23,635,495	1,305
	米ドル	23,634,190	－	23,635,495	1,305
	売建	215,564,043	－	215,682,424	△118,381

	米ドル	115,173,465	－	115,159,000	14,465
	ユーロ	76,756,388	－	76,892,400	△136,012
	豪ドル	23,634,190	－	23,631,024	3,166
合計		239,198,233	－	239,317,919	△117,076

（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）

2019年10月28日現在		2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.3455円	1口当たり純資産額	2.4530円
(1万口当たり純資産額)	(23,455円)	(1万口当たり純資産額)	(24,530円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考

米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,444,663.28	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	2,030,000.00	2,048,477.06	
		US TREASURY N/B-1.5%-21/09/30	2,000,000.00	2,025,499.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-21/10/15	2,000,000.00	2,053,166.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,902,804.08	
		US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	2,022,704.20	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,016,689.02	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,078,708.40	
		US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	610,593.72	
		US TREASURY N/B-1.5%-21/11/30	3,370,000.00	3,419,760.07	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,193,125.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-22/01/15	5,000,000.00	5,144,140.50	
		US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	4,840,000.00	4,922,998.25	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,560,791.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,123,437.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,553,906.25	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/02/28	2,000,000.00	2,046,640.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,061,718.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,841,343.66	
		US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,062,031.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,072,773.40	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,899,452.84	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,050,000.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	1,200,000.00	1,236,843.72	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,513,782.55	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,078,339.60	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,582,812.50	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/06/30	2,500,000.00	2,566,992.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,109,687.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	4,057,878.27	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	5,700,000.00	5,872,781.25	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	4,500,000.00	4,619,706.75	
		US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,600,000.00	2,663,375.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,960,191.24	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	2,750,000.00	2,824,550.57	

		US TREASURY N/B-1.5%-22/09/15	1,950,000.00	1,999,587.72	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,658,857.20	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,410,000.00	2,489,642.78	
		US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	3,071,835.90	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,103,945.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,488,687.44	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,060,078.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,541,071.87	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,103,909.32	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	4,066,283.13	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,088,827.90	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,071,640.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,658,876.44	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,396,671.76	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,541,542.95	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,196,511.68	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	930,565.59	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,015,546.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,064,296.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,250,228.48	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,506,699.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,202,299.16	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,832,453.08	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,756,517.54	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,965,823.43	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,556,191.35	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,386,581.95	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,504,394.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,547,812.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,065,273.40	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,675,707.81	
		US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,088,183.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,211,875.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,643,050.45	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	860,000.00	858,387.50	

		US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,912,256.75	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,993,906.25	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,586,328.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	711,588.24	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,773,013.64	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	972,351.54	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,310,156.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,839,334.30	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,959,112.86	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,129,375.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,229,570.20	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,132,265.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,707,031.12	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,575,343.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,595,214.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,747,028.78	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,513,612.28	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,123,242.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,211,640.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,649,871.70	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,112,933.05	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,447,253.82	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,805,780.23	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,720,000.00	2,910,081.21	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	3,820,000.00	4,033,084.18	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,988,877.89	
		US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,507,363.22	
		US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,386,339.70	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,573,624.88	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,305,359.32	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,175,624.51	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,950,384.28	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,750,000.00	4,046,337.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,504,398.42	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	4,000,000.00	4,196,562.40	

		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	2,053,929.64	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	3,300,000.00	3,498,644.49	
		US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,639,218.75	
		US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,770,000.00	3,940,312.38	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,327,412.58	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,276,300.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,140,000.00	1,179,810.85	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,844,468.64	
		US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,581,958.84	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,450,507.62	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,154,031.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,188,124.64	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,283,103.41	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	2,011,872.63	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,000,000.00	1,111,445.30	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,611,506.16	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,985,234.36	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,411,599.15	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,344,179.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,304,665.81	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,582,437.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,620,368.98	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,485,825.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,228,671.80	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	2,064,122.88	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,328,539.04	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	2,000,000.00	2,127,421.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,987,389.38	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,273,037.81	
		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,211,406.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	5,180,000.00	5,515,485.80	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	3,120,000.00	3,409,575.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,159,062.40	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	3,990,000.00	4,309,433.41	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,234,531.20	

		US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,727,641.38	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,613,843.75	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,490,646.56	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	3,063,052.27	
		US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,150,390.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,120,507.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	5,313,937.44	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	1,036,777.30	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,215,860.87	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	996,445.31	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,944,912.67	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,593,124.99	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,500,000.00	3,483,115.23	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,972,812.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,640,000.00	2,934,834.14	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,959,424.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,363,525.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,605,781.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,750,082.44	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	685,019.50	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,902,515.52	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,454,990.92	
		US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,368,133.03	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,368,945.30	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,970,000.00	5,733,360.68	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,406,225.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,850,000.00	4,135,591.46	
		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	4,480,000.00	4,864,649.66	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,615,996.65	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,596,293.75	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	6,590,000.00	6,473,645.30	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	1,500,000.00	1,469,648.43	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	958,340.59	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,187,402.32	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	1,006,256.25	

		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	220,000.00	335,491.39	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	1,094,968.72	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	2,170,185.42	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	2,190,460.90	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,142,695.27	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	1,067,732.80	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,432,575.66	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,532,343.75	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	2,075,962.46	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,527,348.76	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,410,136.70	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,340,649.55	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,370,849.95	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	657,929.65	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	994,906.24	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,485,156.20	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,631,562.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,597,814.32	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	2,020,000.00	2,859,957.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	3,015,478.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	2,680,000.00	3,802,982.71	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	3,287,812.32	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,839,511.66	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,980,476.39	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,935,378.70	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	4,151,374.72	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,400,000.00	4,326,234.12	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	5,072,894.19	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,344,906.04	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,986,132.75	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,453,015.62	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,556,015.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,661,437.36	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,508,915.42	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,507,500.00	

		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,562,092.15	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,609,159.95	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	3,221,624.88	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	5,394,062.50	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	4,146,017.32	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	4,353,550.74	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,873,398.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	3,376,251.69	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,642,742.11	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	4,019,413.97	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,450,000.00	1,315,082.02	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,500,000.00	1,404,843.75	
米ドル小計			573,800,000.00	634,024,867.32 (66,382,403,608)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-21/11/01	960,000.00	971,280.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/02/01	690,000.00	702,095.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,210,000.00	1,216,037.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/05/01	960,000.00	979,824.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,020,817.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/08/01	810,000.00	803,698.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,691,000.00	1,717,092.13	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,290,355.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,053,986.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,170,000.00	1,228,710.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	842,329.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,209,185.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	1,145,000.00	1,198,036.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	860,000.00	894,408.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	1,032,716.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,179,592.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,120,000.00	1,188,913.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	551,510.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	860,000.00	891,734.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	917,000.00	1,020,245.03	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	820,000.00	1,176,437.60	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	769,674.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,898,000.00	2,009,089.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,254,877.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	750,000.00	1,222,395.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	935,000.00	1,445,687.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,145,000.00	1,731,068.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	995,000.00	1,364,294.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	1,198,000.00	1,439,864.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	509,035.85	
加ドル小計			31,533,000.00	35,914,994.37 (2,860,629,301)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-21/12/09	15,500,000.00	15,992,428.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	20,700,000.00	21,372,085.53	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%-23/03/09	11,500,000.00	12,067,580.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,900,000.00	18,505,974.89	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	16,100,000.00	17,844,274.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	18,100,000.00	21,471,255.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	13,150,000.00	13,437,558.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,800,000.00	23,003,434.47	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	20,370,000.00	23,966,875.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	10,500,000.00	11,769,935.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,800,000.00	7,562,038.26	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	5,600,000.00	7,408,385.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,150,000.00	14,194,853.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	13,700,000.00	14,818,611.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	10,770,000.00	11,890,430.56	
メキシコペソ小計			212,640,000.00	235,305,721.62 (1,178,881,665)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	930,000.00	992,793.60	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,050,000.00	1,151,424.75	

		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,010,000.00	1,090,696.98	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	550,000.00	565,108.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,050,000.00	1,178,375.83	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	750,000.00	786,060.82	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,145,000.00	1,224,093.73	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	770,000.00	987,313.25	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,126,806.74	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	860,000.00	937,531.58	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	50,000.00	51,783.14	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,375,000.00	1,999,266.50	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,061,129.44	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,070,000.00	1,193,228.26	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	960,000.00	1,000,999.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,030,000.00	1,171,103.82	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	984,881.04	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	1,115,000.00	1,317,651.25	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	953,000.00	1,363,600.05	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,445,000.00	2,518,201.50	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	525,223.50	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	945,000.00	1,249,152.03	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	344,880.69	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,150,000.00	2,088,536.85	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	550,000.00	1,005,500.65	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	1,019,707.15	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	618,505.65	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	558,684.03	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	651,883.74	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%-21/10/31	700,000.00	704,099.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	1,790,000.00	1,935,009.69	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%-22/04/30	1,430,000.00	1,450,705.82	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%-22/10/31	1,420,000.00	1,448,448.28	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,616,805.57	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-23/04/30	1,033,000.00	1,045,548.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-23/07/30	1,290,000.00	1,319,761.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,540,000.00	1,768,254.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,330,000.00	1,559,249.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,340,000.00	1,540,502.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,090,000.00	1,117,697.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,720,000.00	1,938,844.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	930,000.00	944,020.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,450,000.00	1,578,528.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,630,000.00	2,019,501.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,745,000.00	1,961,414.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,535,000.00	1,723,504.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,490,000.00	2,020,404.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	2,040,000.00	2,226,955.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,475,000.00	1,635,741.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,260,000.00	1,336,912.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,725,000.00	1,910,458.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,890,000.00	2,095,412.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,550,000.00	1,721,622.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,155,000.00	1,630,432.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,900,000.00	2,836,320.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	2,210,000.00	2,472,072.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,470,000.00	1,537,076.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,900,000.00	1,964,638.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,660,000.00	1,948,637.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,600,000.00	1,766,736.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,700,000.00	2,776,482.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,450,000.00	1,804,511.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,240,000.00	1,475,618.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,500,000.00	2,354,505.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,410,000.00	2,507,277.51	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	530,000.00	574,011.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,800,000.00	3,168,070.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	940,000.00	1,819,374.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,320,000.00	1,928,155.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	1,405,620.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	900,000.00	898,363.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	605,000.00	1,061,862.84	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-21/10/08	4,540,000.00	4,571,239.74	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-22/04/08	1,000,000.00	1,010,941.50	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-22/10/07	1,000,000.00	1,015,163.00	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,784,517.52	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-23/10/13	2,800,000.00	2,867,648.00	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/04/05	1,000,000.00	1,027,940.00	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/04/11	3,000,000.00	3,106,950.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	2,000,000.00	2,066,803.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	2,370,000.00	2,471,372.01	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	1,600,000.00	1,668,156.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	1,900,000.00	2,001,369.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	1,720,000.00	1,822,116.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	1,850,000.00	1,997,437.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	970,873.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,230,000.00	1,335,781.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,950,000.00	2,112,415.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,830,000.00	1,957,861.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,770,000.00	1,871,008.59	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,540,000.00	2,763,136.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	2,760,000.00	2,951,546.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,720,000.00	2,844,443.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,525,000.00	2,689,099.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	1,130,000.00	1,693,744.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	2,340,000.00	2,542,363.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,150,000.00	1,208,914.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,150,000.00	1,691,304.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,845,000.00	2,013,522.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	1,170,000.00	1,677,301.47	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,796,343.85	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	2,160,000.00	2,329,495.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,370,000.00	1,449,209.29	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	1,280,000.00	2,119,148.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,110,000.00	1,174,112.49	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	420,000.00	445,211.34	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,822,160.46	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,265,000.00	2,205,541.41	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	170,000.00	179,640.87	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,730,000.00	3,009,341.92	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,235,000.00	2,338,132.87	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,290,000.00	2,632,383.54	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	910,000.00	1,637,268.36	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	3,105,000.00	5,203,008.13	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	2,732,000.00	4,699,748.68	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	2,870,498.07	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,180,000.00	1,234,729.58	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.3%-21/10/15	880,000.00	903,444.96	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-21/11/01	1,370,000.00	1,380,992.19	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-21/12/15	1,060,000.00	1,091,068.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01	1,695,000.00	1,818,655.33	

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%-22/04/01		1,390,000.00	1,421,191.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-22/04/15		970,000.00	994,420.23	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%-22/07/15		1,100,000.00	1,125,437.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-22/08/01		1,270,000.00	1,297,887.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01		1,700,000.00	1,883,513.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-22/09/15		1,310,000.00	1,354,063.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01		2,000,000.00	2,233,914.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%-23/01/15		500,000.00	503,525.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-23/03/01		910,000.00	935,507.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-23/03/15		1,200,000.00	1,233,836.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01		1,365,000.00	1,528,290.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-23/06/15		1,000,000.00	1,022,047.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01		1,700,000.00	1,934,465.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-23/10/01		1,310,000.00	1,411,105.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%-23/10/15		1,160,000.00	1,188,196.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01		860,000.00	1,097,941.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01		1,650,000.00	1,904,136.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-24/05/15		1,075,000.00	1,148,853.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%-24/07/01		1,360,000.00	1,449,897.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01		1,450,000.00	1,659,741.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-24/11/15		1,350,000.00	1,429,016.85	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01		1,480,000.00	1,630,582.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-25/02/01		1,560,000.00	1,581,372.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01		1,540,000.00	1,870,653.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-25/05/15		1,175,000.00	1,246,779.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01		1,400,000.00	1,490,073.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01		800,000.00	864,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15		1,300,000.00	1,452,425.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01		1,480,000.00	1,617,785.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01		1,730,000.00	2,122,556.03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01		1,230,000.00	1,323,103.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15		1,220,000.00	1,346,953.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01		1,280,000.00	1,810,065.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01		1,640,000.00	1,733,552.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15		1,000,000.00	1,031,235.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01		1,160,000.00	1,296,951.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01		1,395,000.00	1,547,864.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15		230,000.00	237,854.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01		2,060,000.00	2,916,508.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01		1,950,000.00	2,161,867.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01		1,330,000.00	1,760,467.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01		1,855,000.00	2,184,770.77	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01		1,755,000.00	2,112,746.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01		2,050,000.00	2,878,212.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01		1,800,000.00	2,261,770.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01		1,700,000.00	1,804,402.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01		1,100,000.00	1,124,767.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01		1,145,000.00	1,243,981.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01		2,230,000.00	3,398,466.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01		1,685,000.00	1,830,253.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01		1,740,000.00	2,706,227.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01		1,140,000.00	1,338,732.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01		1,580,000.00	2,371,668.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01		1,150,000.00	1,491,418.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01		700,000.00	729,674.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01		900,000.00	1,040,171.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01		2,260,000.00	3,174,045.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01		1,200,000.00	1,515,211.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01		1,850,000.00	2,974,923.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01		310,000.00	399,635.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01		1,720,000.00	2,787,672.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01		330,000.00	349,945.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01		1,145,000.00	1,878,237.39	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	1,120,000.00	1,515,721.76	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	1,270,000.00	1,572,033.94	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,525,000.00	2,143,073.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	785,000.00	1,182,502.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	1,180,000.00	1,395,642.64	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	680,000.00	861,731.36	
		FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	345,000.00	360,490.50	
		FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	580,635.00	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	255,225.00	
		FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	569,591.88	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	600,000.00	616,239.60	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	520,049.12	
		FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	344,468.80	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	568,950.03	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	370,746.69	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	477,959.82	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	291,960.18	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	499,830.48	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	380,796.94	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	432,206.35	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	495,000.00	515,191.54	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	564,324.64	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	354,628.04	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,072,099.92	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	3,980,252.90	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-22/05/25	2,310,000.00	2,335,964.40	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,914,835.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	2,980,000.00	3,031,810.28	
		FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,183,756.80	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,363,633.56	
		FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,522,761.90	

		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	1,000,000.00	1,024,055.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,475,936.04	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,048,466.55	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	1,665,000.00	1,713,846.10	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,751,044.40	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	3,989,352.82	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,519,589.95	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,778,289.21	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,000,000.00	2,124,968.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,700,000.00	2,836,819.80	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,590,000.00	2,858,520.84	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,230,000.00	3,989,628.81	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,143,430.64	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,760,000.00	3,033,240.00	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,161,573.72	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	1,870,000.00	2,019,667.32	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,400,000.00	2,482,344.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	3,020,000.00	3,862,326.32	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	250,000.00	257,598.50	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,225,000.00	3,845,344.87	
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,640,000.00	4,572,854.88	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	4,160,000.00	4,945,487.04	
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,885,000.00	4,948,496.25	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,825,000.00	3,391,949.25	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,320,000.00	3,987,110.24	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,710,000.00	3,565,487.38	
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,742,499.22	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,530,000.00	2,635,911.54	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,660,000.00	2,411,460.42	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,790,000.00	2,374,506.60	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	800,000.00	885,622.40	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,425,707.20	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,050,000.00	2,411,968.65	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,263,507.30	
		IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	489,649.68	

IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18		65,000.00	65,845.97	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20		470,000.00	521,679.60	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18		590,000.00	671,756.89	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13		840,000.00	1,064,291.67	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15		905,000.00	983,610.01	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15		490,000.00	511,064.61	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15		615,000.00	675,750.43	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15		770,000.00	865,202.33	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15		675,000.00	849,392.72	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18		770,000.00	895,924.26	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15		355,000.00	417,959.96	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15		460,000.00	486,325.06	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15		390,000.00	494,124.15	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18		562,000.00	792,834.19	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15		321,000.00	420,312.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15		950,000.00	958,160.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15		1,270,000.00	1,335,355.47	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15		355,000.00	390,629.93	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15		760,000.00	900,568.61	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15		1,050,000.00	1,121,610.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15		1,345,000.00	1,376,663.99	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15		1,250,000.00	1,378,235.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15		1,275,000.00	1,333,586.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15		1,195,000.00	1,276,424.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15		485,000.00	504,457.71	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15		1,225,000.00	1,340,893.33	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15		925,000.00	1,341,580.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15		906,000.00	1,001,219.69	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15		765,000.00	818,320.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15		730,000.00	994,179.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15		1,150,000.00	1,969,518.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15		973,000.00	1,107,278.86	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15		1,225,000.00	2,280,080.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15		1,273,000.00	2,258,755.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15		355,000.00	362,247.46	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	256,944.12	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	844,915.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	740,118.01	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-22/09/20	355,000.00	359,870.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,020,981.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	437,593.37	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	581,166.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	970,000.00	1,042,263.06	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	345,000.00	353,878.57	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	936,061.69	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	670,000.00	733,566.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	912,282.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	760,000.00	823,148.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	734,092.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	999,454.82	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	620,000.00	679,431.96	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	590,108.01	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	620,000.00	643,690.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	776,174.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,125,000.00	1,927,112.62	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	634,000.00	1,110,431.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	603,000.00	827,816.49	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	305,000.00	361,133.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	709,367.94	
ユーロ小計			413,655,000.00	505,700,043.54 (62,716,919,399)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	575,000.00	801,072.75	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,160,689.97	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,670,000.00	1,725,875.19	
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,570,000.00	1,575,411.46	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,410,000.00	1,504,300.80	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,580,000.00	1,639,063.56	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	970,330.90	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,593,438.93	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	1,828,000.00	1,883,349.28	

		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	510,000.00	512,502.25	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,150,000.00	1,249,101.02	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,370,000.00	1,477,550.48	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,178,912.09	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	500,000.00	499,003.00	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,250,000.00	1,397,033.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	900,000.00	1,321,401.24	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	1,471,000.00	1,554,660.47	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,000,000.00	1,005,300.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,553,443.80	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,967,586.73	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,453,970.68	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	2,103,141.25	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,677,228.57	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,345,000.00	2,279,931.55	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	2,014,270.88	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,135,000.00	1,875,689.65	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	445,000.00	483,706.45	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,471,158.09	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,518,488.99	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,758,439.40	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,375,000.00	2,474,396.10	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,520,000.00	1,757,790.62	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	620,000.00	761,576.25	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,045,000.00	1,966,447.56	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	135,000.00	126,970.87	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,252,000.00	2,272,849.24	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	782,544.28	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,370,000.00	2,798,970.82	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,392,963.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,100,000.00	2,285,192.80	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	370,000.00	332,852.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,160,000.00	2,414,834.40	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,735,000.00	1,751,354.80	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,662,130.60	

		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	972,790.23	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,242,000.00	2,039,580.10	
英ポンド小計			53,297,000.00	71,999,296.60 (9,838,703,880)	
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	8,019,470.32	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,615,999.94	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,920,000.00	5,563,639.32	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,500,000.00	4,844,731.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,800,101.05	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,749,830.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	5,385,000.00	8,473,690.60	
スウェーデンクローナ小計			34,715,000.00	40,067,463.48 (479,206,863)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,670,000.00	5,930,281.35	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,736,459.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,720,000.00	2,881,505.44	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,650,000.00	2,796,646.76	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	3,054,191.94	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	3,020,795.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	3,024,327.55	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	3,129,463.25	
ノルウェークローネ小計			26,680,000.00	28,573,670.49 (323,168,213)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,390,000.00	5,595,342.83	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-22/11/15	3,350,000.00	3,412,645.67	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	5,340,000.00	5,698,047.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,960,000.00	6,690,265.68	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	4,474,932.80	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,500,000.00	1,632,765.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,780,000.00	22,534,645.24	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	800,000.00	866,888.00	
デンマーククローネ小計			38,280,000.00	50,905,532.22 (848,595,222)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,180,000.00	1,247,885.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,810,000.00	2,906,116.05	

		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-22/07/25	2,200,000.00	2,199,786.52	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,720,000.00	1,909,896.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,216,445.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,970,000.00	2,202,223.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,290,000.00	2,476,795.30	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,430,000.00	2,619,248.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	500,000.00	506,575.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,890,000.00	3,263,127.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,300,000.00	3,633,333.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,340,000.00	2,589,256.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,544,692.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	655,000.00	909,074.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	3,340,000.00	3,801,387.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	550,000.00	550,705.37	
ポーランドズロチ小計			32,535,000.00	35,576,549.84 (966,614,859)	
豪ドル	**国債証券**	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,375,000.00	1,405,195.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,650,000.00	1,809,511.11	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,860,000.00	1,941,481.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,470,000.00	2,798,851.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,330,000.00	2,540,878.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,915,000.00	1,919,273.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,310,000.00	2,620,661.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,550,000.00	1,546,384.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,400,000.00	2,910,481.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,600,000.00	1,609,797.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,170,000.00	2,764,588.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,040,000.00	2,353,146.73	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,200,000.00	2,467,728.77	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	2,150,000.00	2,502,587.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,210,000.00	2,672,511.67	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	2,220,000.00	2,605,078.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	2,390,000.00	2,762,561.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	2,000,000.00	2,028,074.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,348,000.00	1,432,162.38	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,500,000.00	1,512,234.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	900,000.00	929,270.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,463,090.17	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	643,287.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	850,000.00	1,157,194.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	853,671.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	500,000.00	603,360.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	1,060,000.00	1,346,427.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,120,000.00	1,103,194.50	
豪ドル小計			46,345,000.00	52,302,686.54 (3,904,395,550)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	558,000.00	563,133.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	450,000.00	459,915.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	525,000.00	553,035.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	460,000.00	475,640.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	581,024.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	190,000.00	200,317.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	594,054.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	360,000.00	391,375.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	400,000.00	434,080.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	560,000.00	659,120.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	365,000.00	415,005.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	585,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	485,000.00	577,591.35	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	573,293.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	421,000.00	490,403.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	160,257.68	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	317,000.00	412,734.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	490,000.00	662,480.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	250,000.00	298,137.50	
シンガポールドル小計			7,994,000.00	9,087,348.63 (700,998,073)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	470,946.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	868,997.45	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	830,000.00	855,888.77	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	790,127.54	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	659,893.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	843,240.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	475,000.00	500,887.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	895,819.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	345,024.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,064,280.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	849,654.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	750,000.00	818,475.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,206,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,520,000.00	1,665,920.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	816,615.38	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,188,549.94	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	670,543.74	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,040,000.00	1,210,039.94	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	693,941.36	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	670,000.00	702,991.87	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	661,699.32	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	817,098.12	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	910,952.39	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	400,000.00	412,951.64	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	875,941.06	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,330,000.00	1,383,532.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	1,015,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,070,000.00	1,189,020.27	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	492,444.81	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	1,015,550.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	700,000.00	759,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	1,050,264.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,173,996.77	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	1,064,872.31	
マレーシアリンギット小計			27,480,000.00	29,941,009.87 (753,914,628)	
イスラエルシュケ	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-22/01/31	1,300,000.00	1,390,633.14	
		ISRAEL FIXED BOND-0.75%-22/07/31	1,080,000.00	1,093,363.92	

ル		ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,024,632.90	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,140,000.00	1,254,072.61	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,200,000.00	1,250,735.28	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,320,000.00	1,480,162.99	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	500,000.00	504,519.50	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,400,000.00	1,501,932.46	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,200,000.00	1,616,998.32	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,500,000.00	1,643,643.45	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,405,665.25	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	985,000.00	1,005,444.85	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	590,000.00	602,886.24	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,400,000.00	2,438,544.92	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,230,000.00	1,749,718.78	
イスラエルシュケル小計			17,095,000.00	19,962,954.61 (619,250,852)	
合計				151,573,682,113 (151,573,682,113)	

(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	222銘柄	100.0%	43.7%
加ドル	国債証券	30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	309銘柄	100.0%	41.4%
英ポンド	国債証券	46銘柄	100.0%	6.5%
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	8銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	2.6%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.5%

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	15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。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	96,178,592	80,664,456
コール・ローン	297,712,670	265,782,979
国債証券	23,973,158,706	24,438,089,823
派生商品評価勘定	1,455,095	328,393,143
未収利息	220,287,789	234,079,598
前払費用	11,051,223	12,867,726
流動資産合計	24,599,844,075	25,359,877,725
資産合計	24,599,844,075	25,359,877,725
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	474,286,479	5,469,202
未払解約金	16,423,458	12,281,934
未払利息	81	74
流動負債合計	490,710,018	17,751,210
負債合計	490,710,018	17,751,210
純資産の部		
元本等		
元本	15,247,027,897	15,326,314,880
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	8,862,106,160	10,015,811,635
元本等合計	24,109,134,057	25,342,126,515
純資産合計	24,109,134,057	25,342,126,515
負債純資産合計	24,599,844,075	25,359,877,725

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）

		2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
1．	期首	2018年10月27日	2019年10月29日
	期首元本額	16,823,343,930円	15,247,027,897円
	期首からの追加設定元本額	967,758,629円	3,146,539,886円
	期首からの一部解約元本額	2,544,074,662円	3,067,252,903円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（ＤＣ専用）	2,705,219,686円	3,833,097,916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）	1,154,074,686円	1,136,513,820円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	3,867,213円	3,874,458円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,521,317円	4,256,652円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	12,098,418円	9,124,934円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	18,993,425円	16,682,495円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	10,322,751,712円	9,335,627,641円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	91,313,946円	90,986,014円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	127,872,002円	124,325,198円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	122,465,334円	121,687,096円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	88,146,677円	87,021,402円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）１年決算型	595,703,481円	563,117,254円

	計	15,247,027,897円	15,326,314,880円
2．	受益権の総数	15,247,027,897口	15,326,314,880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 2018年10月27日 至 2019年10月28日	自 2019年10月29日 至 2020年10月26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

	2019年10月28日現在	2020年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（2019年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	611,292,964
合計	611,292,964

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（2019年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	24,026,651,496	－	24,499,482,880	△472,831,384

	米ドル	11,438,125,712	—	11,632,287,900	△194,162,188
	加ドル	452,990,587	—	465,369,050	△12,378,463
	メキシコペソ	180,962,448	—	192,296,270	△11,333,822
	ユーロ	9,119,065,833	—	9,265,762,240	△146,696,407
	英ポンド	1,472,061,140	—	1,555,166,410	△83,105,270
	スウェーデンクローナ	136,358,623	—	138,039,160	△1,680,537
	ノルウェークローネ	65,400,697	—	64,613,250	787,447
	デンマーククローネ	127,734,454	—	129,375,210	△1,640,756
	ポーランドズロチ	108,510,083	—	111,916,350	△3,406,267
	豪ドル	482,062,080	—	491,516,030	△9,453,950
	シンガポールドル	72,311,384	—	74,188,450	△1,877,066
	マレーシアリンギット	238,513,997	—	241,947,580	△3,433,583
	南アフリカランド	132,554,458	—	137,004,980	△4,450,522
合計		24,026,651,496	—	24,499,482,880	△472,831,384

（2020年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,064,619,601	—	24,741,695,660	322,923,941
	米ドル	10,952,310,532	—	10,807,974,230	144,336,302
	加ドル	515,832,567	—	509,256,070	6,576,497
	メキシコペソ	190,817,894	—	194,779,200	△3,961,306
	ユーロ	10,180,865,945	—	10,067,752,040	113,113,905
	英ポンド	1,665,216,835	—	1,632,757,360	32,459,475
	スウェーデンクローナ	117,932,268	—	116,741,560	1,190,708
	ノルウェークローネ	66,912,852	—	64,308,700	2,604,152
	デンマーククローネ	128,076,286	—	127,055,840	1,020,446
	ポーランドズロチ	131,543,481	—	126,715,590	4,827,891
	豪ドル	667,172,388	—	650,114,680	17,057,708

	シンガポールドル	105,907,660	―	105,362,210	545,450
	マレーシアリンギット	250,760,018	―	248,111,910	2,648,108
	イスラエルシュケル	91,270,875	―	90,766,270	504,605
合計		25,064,619,601	―	24,741,695,660	322,923,941

（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）

2019年10月28日現在		2020年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5812円	1口当たり純資産額	1.6535円
(1万口当たり純資産額)	(15,812円)	(1万口当たり純資産額)	(16,535円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	700,000.00	713,026.79	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	800,000.00	815,207.12	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	1,670,000.00	1,808,418.45	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,500,000.00	1,529,515.65	
		US TREASURY N/B-2.875%-21/11/15	1,400,000.00	1,440,619.32	
		US TREASURY N/B-1.5%-21/11/30	500,000.00	507,382.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-22/01/15	1,800,000.00	1,851,890.58	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	1,750,000.00	1,792,553.70	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	900,000.00	920,671.83	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,350,000.00	2,408,750.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	500,000.00	515,351.55	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	500,000.00	513,710.90	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	1,000,000.00	1,033,125.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	700,000.00	719,195.26	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,550,000.00	2,617,833.82	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	1,000,000.00	1,033,046.80	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	1,700,000.00	1,758,902.28	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,100,000.00	1,142,281.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	1,600,000.00	1,657,312.48	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	700,000.00	729,421.84	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,400,000.00	2,477,156.16	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,050,000.00	2,132,400.36	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	600,000.00	619,125.00	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	580,000.00	678,803.87	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	2,000,000.00	2,129,453.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/08/31	300,000.00	321,767.55	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,440,000.00	1,551,656.16	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,000,000.00	1,082,382.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,080,000.00	1,170,112.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	1,300,000.00	1,383,890.56	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,295,812.44	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,000,000.00	1,064,023.40	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,230,000.00	4,567,738.85	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,300,000.00	4,639,800.62	

US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15		1,650,000.00	1,768,658.10	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15		1,500,000.00	1,621,288.95	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30		700,000.00	778,011.71	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15		2,300,000.00	2,479,417.94	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15		1,000,000.00	1,093,457.00	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31		900,000.00	1,002,902.31	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15		2,400,000.00	2,555,437.44	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15		900,000.00	952,769.52	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15		4,000,000.00	4,357,656.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15		700,000.00	774,949.21	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15		530,000.00	733,739.42	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15		3,200,000.00	3,564,000.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15		3,100,000.00	3,618,523.36	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15		210,000.00	285,558.96	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15		1,000,000.00	1,153,593.70	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15		600,000.00	644,507.76	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15		500,000.00	542,929.65	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15		900,000.00	957,234.33	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15		400,000.00	580,812.48	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15		390,000.00	577,367.54	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15		170,000.00	255,318.75	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15		390,000.00	533,797.25	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15		100,000.00	152,359.37	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15		230,000.00	351,882.01	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15		350,000.00	504,574.21	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15		200,000.00	308,195.30	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15		200,000.00	285,593.74	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15		350,000.00	459,607.40	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15		300,000.00	372,773.43	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15		500,000.00	657,890.60	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15		250,000.00	316,806.62	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15		140,000.00	198,214.84	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15		200,000.00	288,562.50	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15		550,000.00	780,462.87	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15		120,000.00	164,390.61	

		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,150,000.00	1,490,238.19	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	1,400,000.00	1,669,554.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	583,787.07	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	890,695.26	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	260,148.42	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,450,000.00	1,732,183.48	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	179,167.96	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	3,250,000.00	3,708,046.87	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	383,402.34	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,550,000.00	1,943,312.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,050,000.00	1,316,970.69	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	1,144,492.10	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	600,000.00	544,171.86	
米ドル小計			92,380,000.00	102,141,756.91 (10,694,241,948)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	700,000.00	703,493.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/05/01	600,000.00	612,390.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	781,237.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	600,000.00	621,816.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	200,000.00	210,036.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	400,000.00	416,004.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	450,000.00	670,756.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	688,646.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	510,000.00	831,228.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	309,238.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	302,370.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	151,951.00	
加ドル小計			5,190,000.00	6,299,167.00 (501,728,651)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	5,000,000.00	5,162,339.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	7,000,000.00	7,665,196.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	5,000,000.00	5,931,286.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	7,059,462.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,500,000.00	2,802,365.50	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	5,257,353.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	3,000,000.00	3,244,951.50	
メキシコペソ小計			33,000,000.00	37,122,954.95 (185,986,004)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	350,000.00	373,632.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	170,000.00	183,582.66	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	350,000.00	392,791.94	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	150,000.00	163,780.05	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000.00	552,524.56	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	219,923.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,600,000.00	1,819,190.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	253,681.48	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	453,102.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	450,000.00	817,253.55	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	220,000.00	402,200.26	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	80,000.00	135,105.44	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	500,000.00	540,505.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	300,000.00	344,465.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	600,000.00	703,420.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	500,000.00	544,320.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	600,000.00	743,374.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	900,000.00	1,010,523.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,100,000.00	1,491,573.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	300,000.00	332,605.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	500,000.00	555,362.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	650,000.00	917,559.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	830,000.00	1,239,024.00	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	500,000.00	522,815.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	600,000.00	704,326.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	430,000.00	674,958.31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	400,000.00	704,015.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	150,000.00	290,325.75	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	400,000.00	584,289.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	175,514.52	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	300,000.00	310,020.48	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	300,000.00	312,779.28	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	500,000.00	526,676.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	500,000.00	529,685.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	200,000.00	215,939.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	570,000.00	700,504.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	500,000.00	541,645.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	250,000.00	267,467.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	500,000.00	528,533.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	500,000.00	543,924.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	650,000.00	695,110.65	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	400,000.00	425,996.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	560,000.00	823,591.72	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	200,000.00	286,718.20	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04		350,000.00	579,454.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04		470,000.00	771,545.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04		260,000.00	452,271.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04		150,000.00	283,983.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04		270,000.00	550,963.99	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04		550,000.00	989,557.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04		750,000.00	1,256,765.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15		750,000.00	1,290,194.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01		800,000.00	858,362.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-22/04/15		500,000.00	512,587.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01		750,000.00	830,961.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01		850,000.00	951,682.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01		600,000.00	682,752.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01		430,000.00	548,970.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01		700,000.00	807,815.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01		200,000.00	228,929.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01		450,000.00	546,619.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15		500,000.00	558,625.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01		950,000.00	1,165,565.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01		700,000.00	989,879.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01		500,000.00	554,790.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	900,000.00	1,274,202.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	550,000.00	728,013.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	750,000.00	1,053,004.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,100,000.00	1,382,192.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	650,000.00	990,584.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	388,825.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	250,000.00	375,264.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	560,000.00	786,489.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	450,000.00	723,630.15	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	486,222.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	246,057.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	800,000.00	1,082,658.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	316,813.00	
		FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	105,570.00	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	244,729.00	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	300,000.00	377,336.70	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	177,619.05	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	158,964.69	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	500,000.00	519,400.50	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	350,000.00	369,519.50	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	1,000,000.00	1,059,940.00	
		FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	200,000.00	246,616.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	850,000.00	904,774.85	
		FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	750,000.00	863,122.50	
		FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	650,000.00	719,540.90	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	750,000.00	825,543.75	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	421,616.00	

		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	950,000.00	1,271,773.55	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	600,000.00	650,771.64	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	492,285.24	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	350,000.00	432,312.72	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	500,000.00	549,500.00	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	742,867.44	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	750,000.00	959,187.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	200,000.00	238,471.00	
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,800,000.00	3,117,855.60	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	1,000,000.00	1,188,819.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	180,000.00	308,745.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	300,000.00	360,207.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	790,547.72	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	197,351.70	
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	473,023.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	600,000.00	1,033,690.80	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	300,000.00	435,806.10	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	693,059.20	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	803,989.55	
		IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	200,000.00	221,991.32	
		IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	300,000.00	380,104.17	
		IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	300,000.00	326,058.57	
		IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	377,507.88	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	200,000.00	253,397.00	
		IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	200,000.00	282,147.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	270,000.00	297,098.82	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	150,000.00	160,230.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	300,000.00	330,776.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	156,892.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	200,000.00	213,627.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	470,000.00	681,667.79	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	650,000.00	1,113,206.25	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	150,000.00	279,193.53	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	354,871.18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	350,000.00	376,074.30	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	100,000.00	109,480.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	400,000.00	521,304.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	293,957.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	200,000.00	216,553.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	400,000.00	544,684.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	450,000.00	770,845.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	250,000.00	437,867.37	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	193,684.08	
ユーロ小計			60,830,000.00	80,428,353.44 (9,974,724,393)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.75%-22/09/07	600,000.00	620,074.92	
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	300,000.00	301,034.04	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	650,000.00	720,817.24	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	400,000.00	431,401.60	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	194,326.17	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	270,000.00	396,420.37	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	800,000.00	845,498.56	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	650,000.00	939,291.60	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	402,134.51	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	400,000.00	612,843.28	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	260,000.00	399,136.29	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	288,169.78	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	100,000.00	165,259.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	270,000.00	473,200.48	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	550,000.00	831,933.30	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	550,000.00	989,758.44	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	115,644.12	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	122,834.88	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	1,144,104.86	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	830,979.20	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	624,526.14	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	300,000.00	329,759.40	
英ポンド小計			8,160,000.00	11,779,148.18 (1,609,620,598)	
スウェー	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	1,950,000.00	2,071,253.92	

デンクローナ		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	2,500,000.00	2,642,172.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	1,850,000.00	2,092,018.85	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,614,910.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	1,101,501.10	
スウェーデンクローナ小計			8,500,000.00	9,521,856.87 (113,881,408)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,464,267.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	491,107.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	1,059,377.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	1,055,338.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,433,224.00	
ノルウェークローネ小計			5,150,000.00	5,503,313.90 (62,242,480)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	2,450,000.00	2,543,337.65	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	561,263.90	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	4,399,803.40	
デンマーククローネ小計			5,250,000.00	7,504,404.95 (125,098,430)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,110,405.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	1,000,000.00	1,081,570.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	800,000.00	903,288.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	800,000.00	880,808.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	600,000.00	675,582.00	
ポーランドズロチ小計			4,200,000.00	4,651,653.00 (126,385,412)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,270,000.00	1,392,775.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	339,941.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	900,000.00	981,455.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	500,000.00	567,242.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	480,000.00	582,096.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	800,000.00	1,019,203.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	400,000.00	461,401.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	650,000.00	786,032.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	500,000.00	577,941.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	950,000.00	1,293,334.94	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	571,596.61	
豪ドル小計			7,200,000.00	8,573,021.38 (639,976,046)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	200,000.00	210,680.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	213,220.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	470,800.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	200,000.00	257,660.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	195,300.00	
シンガポールドル小計			1,150,000.00	1,347,660.00 (103,958,492)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	1,000,000.00	1,023,797.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,000,000.00	1,086,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,535,100.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	1,096,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	580,438.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	624,150.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,500,276.27	
マレーシアリンギット小計			7,750,000.00	8,445,761.57 (212,664,276)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-22/01/31	1,000,000.00	1,069,717.80	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	673,749.30	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	1,079,927.03	
イスラエルシュケル小計			2,120,000.00	2,823,394.13 (87,581,685)	
合計				24,438,089,823 (24,438,089,823)	

(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　82銘柄	100.0%	43.6%
加ドル	国債証券　12銘柄	100.0%	2.1%

メキシコペソ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	135銘柄	100.0%	40.8%
英ポンド	国債証券	22銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	11銘柄	100.0%	2.6%
シンガポールドル	国債証券	5銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	7銘柄	100.0%	0.9%
イスラエルシュケル	国債証券	3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。

【中間財務諸表】

（１）　当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年10月27日から2021年 4月26日まで）の中間財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2020年10月26日現在	当中間計算期間末 2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,048,180	16,435,885
親投資信託受益証券	286,653,758	293,306,885
未収入金	3,018,193	-
流動資産合計	305,720,131	309,742,770
資産合計	305,720,131	309,742,770
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	193,659	-
未払解約金	3,039,365	72
未払受託者報酬	66,486	67,501
未払委託者報酬	948,324	962,802
未払利息	4	1
その他未払費用	6,585	6,697
流動負債合計	4,254,423	1,037,073
負債合計	4,254,423	1,037,073
純資産の部		
元本等		
元本	193,659,578	184,281,167
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	107,806,130	124,424,530
（分配準備積立金）	65,436,609	60,497,600
元本等合計	301,465,708	308,705,697
純資産合計	301,465,708	308,705,697
負債純資産合計	305,720,131	309,742,770

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自　2019年10月29日 至　2020年 4月28日	当中間計算期間 自　2020年10月27日 至　2021年 4月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	△10,587,478	23,539,254
営業収益合計	△10,587,478	23,539,254
営業費用		
支払利息	1,867	747
受託者報酬	68,742	67,501
委託者報酬	980,432	962,802
その他費用	6,858	6,697
営業費用合計	1,057,899	1,037,747
営業利益又は営業損失（△）	△11,645,377	22,501,507
経常利益又は経常損失（△）	△11,645,377	22,501,507
中間純利益又は中間純損失（△）	△11,645,377	22,501,507
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	406,202	1,096,592
期首剰余金又は期首欠損金（△）	135,733,459	107,806,130
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,306,821	3,496,437
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,306,821	3,496,437
剰余金減少額又は欠損金増加額	30,263,917	8,282,952
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	30,263,917	8,282,952
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	95,724,784	124,424,530

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき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。

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 2020年10月26日現在	当中間計算期間末 2021年 4月26日現在
１．	期首元本額	251,025,434円	193,659,578円
	期中追加設定元本額	9,217,244円	5,551,890円
	期中一部解約元本額	66,583,100円	14,930,301円
２．	受益権の総数	193,659,578口	184,281,167口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2019年10月29日 至 2020年 4月28日	当中間計算期間 自 2020年10月27日 至 2021年 4月26日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2020年10月26日現在	当中間計算期間末 2021年 4月26日現在
中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
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

（１口当たり情報）

前計算期間末 2020年10月26日現在		当中間計算期間末 2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5567円	1口当たり純資産額	1.6752円
(1万口当たり純資産額)	(15,567円)	(1万口当たり純資産額)	(16,752円)

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

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	114,776,019	202,272,545
株式	33,489,436,240	37,414,312,280
派生商品評価勘定	445,600	299,450
未収配当金	292,763,801	346,132,342
前払金	2,115,000	14,005,000
流動資産合計	33,899,536,660	37,977,021,617
資産合計	33,899,536,660	37,977,021,617
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,333,250	12,359,850
未払金	-	852,300
未払解約金	28,402,432	4,413,621
未払利息	32	19
流動負債合計	31,735,714	17,625,790
負債合計	31,735,714	17,625,790
純資産の部		

元本等		
元本	22,017,538,384	20,596,864,527
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	11,850,262,562	17,362,531,300
元本等合計	33,867,800,946	37,959,395,827
純資産合計	33,867,800,946	37,959,395,827
負債純資産合計	33,899,536,660	37,977,021,617

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
1．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	21,582,031,788円	22,017,538,384円
	期首からの追加設定元本額	5,024,902,333円	705,976,437円
	期首からの一部解約元本額	4,589,395,737円	2,126,650,294円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	694,622,832円	663,721,746円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	1,780,001,539円	1,716,986,817円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	3,373,731,467円	3,385,073,232円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	3,455,337,100円	3,608,944,914円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,361,389,089円	1,326,553,625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	3,267,569,917円	2,849,488,594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）	734,514,070円	633,500,537円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	49,415,304円	43,357,661円

	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	41,038,145円	34,725,744円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	58,523,187円	50,146,657円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	53,449,514円	44,003,285円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,758,810,767円	3,119,194,500円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	292,909,234円	252,648,651円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	799,731,646円	726,472,347円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,179,083,972円	1,097,839,723円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	1,117,410,601円	1,044,206,494円
	計	22,017,538,384円	20,596,864,527円
２．	受益権の総数	22,017,538,384口	20,596,864,527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	369,625,000円	447,345,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年 4月26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

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	375,130,000	－	372,255,000	△2,875,000
合計		375,130,000	－	372,255,000	△2,875,000

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	549,225,000	－	537,180,000	△12,045,000
合計		549,225,000	－	537,180,000	△12,045,000

（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中間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、同中間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。

（１口当たり情報）

2020年10月26日現在		2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5382円	1口当たり純資産額	1.8430円
(1万口当たり純資産額)	(15,382円)	(1万口当たり純資産額)	(18,430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

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	811,466,919	2,120,702,220
コール・ローン	1,426,733,123	579,309,003
株式	223,415,541,666	222,533,049,724
投資証券	5,334,508,523	5,087,420,298
派生商品評価勘定	60,104,909	166,057,960
未収入金	39,451,273	33,714,846
未収配当金	164,265,623	226,418,258
差入委託証拠金	522,276,550	343,946,797
流動資産合計	231,774,348,586	231,090,619,106
資産合計	231,774,348,586	231,090,619,106
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,849,511	3,090,027
未払金	20,085,890	-
未払解約金	51,950,784	76,069,979
未払利息	398	56
流動負債合計	98,886,583	79,160,062
負債合計	98,886,583	79,160,062
純資産の部		
元本等		
元本	81,609,225,737	64,290,973,949
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	150,066,236,266	166,720,485,095
元本等合計	231,675,462,003	231,011,459,044
純資産合計	231,675,462,003	231,011,459,044
負債純資産合計	231,774,348,586	231,090,619,106

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
１．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	70,689,493,098円	81,609,225,737円
	期首からの追加設定元本額	33,463,538,387円	2,255,305,725円
	期首からの一部解約元本額	22,543,805,748円	19,573,557,513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）	21,291,664,890円	22,596,398,352円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	125,790,854円	116,808,274円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	326,099,287円	305,962,821円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	617,768,856円	605,773,433円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	633,127,496円	646,660,901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	1,788,005,391円	1,569,455,092円
	日興五大陸株式ファンド	4,619,536,139円	4,268,948,221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）	60,652,390円	51,680,942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）	128,258,002円	118,772,978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）	6,659,771,936円	6,351,107,979円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	37,356,692,620円	20,433,160,395円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,543,408円	4,009,179円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	3,735,838円	3,197,684円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	5,328,950円	4,333,448円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	4,847,044円	4,025,707円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,412,350,660円	2,777,905,574円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	26,570,843円	22,131,178円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	72,789,091円	64,870,538円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	108,320,390円	99,851,015円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	101,730,297円	91,456,562円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,261,641,355円	4,154,463,676円
	計	81,609,225,737円	64,290,973,949円
２．	受益権の総数	81,609,225,737口	64,290,973,949口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年 4月26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

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,874,303,434	－	2,916,807,732	42,504,298
合計		2,874,303,434	－	2,916,807,732	42,504,298

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,202,886,745	－	3,362,346,905	159,460,160
合計		3,202,886,745	－	3,362,346,905	159,460,160

（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中間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、同中間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中間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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,560,728,900	－	1,551,480,000	△9,248,900
	米ドル	1,275,820,800	－	1,266,193,000	△9,627,800
	ユーロ	284,908,100	－	285,287,000	378,900
合計		1,560,728,900	－	1,551,480,000	△9,248,900

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	802,612,060	－	806,147,180	3,535,120
	米ドル	388,675,070	－	388,236,510	△438,560

	ユーロ	413,936,990	－	417,910,670	3,973,680
	売建	34,230,933	－	34,258,280	△27,347
	スイスフラン	34,230,933	－	34,258,280	△27,347
合計		836,842,993	－	840,405,460	3,507,773

（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中間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同中間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同中間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。

・同中間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。

・同中間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中間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中間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。

（１口当たり情報）

2020年10月26日現在		2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2.8388円	1口当たり純資産額	3.5932円
(1万口当たり純資産額)	(28,388円)	(1万口当たり純資産額)	(35,932円)

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	33,915,362	55,790,942
コール・ローン	465,491,601	333,484,149
株式	10,325,179,492	13,890,580,331
投資証券	251,358,988	322,804,111
派生商品評価勘定	118,676,267	115,067,024
未収入金	2,071,276	162,238
未収配当金	7,424,886	13,642,905
差入委託証拠金	236,763,776	367,246,673
流動資産合計	11,440,881,648	15,098,778,373
資産合計	11,440,881,648	15,098,778,373
負債の部		
流動負債		

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
派生商品評価勘定	7,868,917	89,088,463
未払金	2,095,919	-
未払解約金	8,723,931	3,681,788
未払利息	129	32
流動負債合計	18,688,896	92,770,283
負債合計	18,688,896	92,770,283
純資産の部		
元本等		
元本	5,875,608,160	6,363,103,424
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	5,546,584,592	8,642,904,666
元本等合計	11,422,192,752	15,006,008,090
純資産合計	11,422,192,752	15,006,008,090
負債純資産合計	11,440,881,648	15,098,778,373

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
1．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	4,930,561,728円	5,875,608,160円

	期首からの追加設定元本額	1,560,324,240円	701,665,114円
	期首からの一部解約元本額	615,277,808円	214,169,850円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（ＤＣ専用）	4,283,823,546円	4,827,351,466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）	379,820,199円	352,269,175円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	6,701,205円	6,093,282円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	5,505,090円	4,798,122円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	7,811,402円	6,612,798円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	7,110,060円	6,097,271円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	39,022,669円	33,923,340円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	106,946,295円	98,748,779円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	159,359,431円	151,418,351円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	149,373,199円	140,219,077円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	730,135,064円	735,571,763円
	計	5,875,608,160円	6,363,103,424円
２．	受益権の総数	5,875,608,160口	6,363,103,424口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年 4月26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

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	852,350,843	－	864,239,328	11,888,485
合計		852,350,843	－	864,239,328	11,888,485

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	727,596,871	－	753,165,707	25,568,836
合計		727,596,871	－	753,165,707	25,568,836

（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中間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、同中間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中間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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	10,952,181,945	－	10,853,263,080	98,918,865
	米ドル	7,981,314,102	－	7,911,144,170	70,169,932
	加ドル	357,329,338	－	355,062,580	2,266,758
	ユーロ	1,166,592,763	－	1,157,627,920	8,964,843
	英ポンド	461,934,734	－	454,309,570	7,625,164
	スイスフラン	354,965,133	－	353,526,460	1,438,673
	スウェーデンクローナ	113,689,006	－	112,818,680	870,326
	ノルウェークローネ	18,455,613	－	17,731,820	723,793
	デンマーククローネ	89,286,932	－	88,639,280	647,652
	豪ドル	245,163,983	－	240,189,470	4,974,513
	ニュージーランドドル	9,866,552	－	9,800,270	66,282
	香港ドル	109,495,816	－	108,604,680	891,136
	シンガポールドル	35,262,440	－	35,063,360	199,080
	イスラエルシュケル	8,825,533	－	8,744,820	80,713
合計		10,952,181,945	－	10,853,263,080	98,918,865

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	14,554,257,261	－	14,553,847,536	409,725
	米ドル	10,559,094,248	－	10,540,224,233	18,870,015
	加ドル	487,259,792	－	492,157,176	△4,897,384
	ユーロ	1,564,749,078	－	1,574,868,904	△10,119,826

	英ポンド	665,643,290	—	663,872,010	1,771,280
	スイスフラン	428,730,679	—	429,370,419	△639,740
	スウェーデンクローナ	166,531,176	—	168,133,680	△1,602,504
	ノルウェークローネ	26,931,052	—	27,714,617	△783,565
	デンマーククローネ	109,898,469	—	110,579,029	△680,560
	豪ドル	333,510,471	—	335,052,107	△1,541,636
	ニュージーランドドル	9,357,838	—	9,395,176	△37,338
	香港ドル	142,160,420	—	141,817,370	343,050
	シンガポールドル	48,118,993	—	48,215,326	△96,333
	イスラエルシュケル	12,271,755	—	12,447,489	△175,734
合計		14,554,257,261	—	14,553,847,536	409,725

（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中間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同中間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同中間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。

・同中間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。

・同中間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中間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中間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。

（１口当たり情報）

2020年10月26日現在		2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.9440円	1口当たり純資産額	2.3583円
(1万口当たり純資産額)	(19,440円)	(1万口当たり純資産額)	(23,583円)

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	211,983,356	125,322,489
国債証券	33,233,854,647	34,953,674,870
地方債証券	3,257,020,000	4,679,122,532
特殊債券	4,609,275,000	4,899,224,993
社債券	2,433,814,438	1,824,402,000
未収入金	-	100,724,000
未収利息	82,296,959	81,319,868
前払費用	1,250,848	1,785,428
流動資産合計	43,829,495,248	46,665,576,180
資産合計	43,829,495,248	46,665,576,180
負債の部		
流動負債		
未払金	-	206,966,000
未払解約金	22,272,541	20,785,617
未払利息	59	12
流動負債合計	22,272,600	227,751,629
負債合計	22,272,600	227,751,629
純資産の部		
元本等		
元本	31,007,104,895	32,868,131,139
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	12,800,117,753	13,569,693,412
元本等合計	43,807,222,648	46,437,824,551
純資産合計	43,807,222,648	46,437,824,551
負債純資産合計	43,829,495,248	46,665,576,180

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
１．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	28,913,282,954円	31,007,104,895円
	期首からの追加設定元本額	6,276,681,341円	2,588,448,537円
	期首からの一部解約元本額	4,182,859,400円	727,422,293円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	3,299,809,640円	3,796,971,828円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	2,929,229,354円	3,398,750,795円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	2,061,514,447円	2,497,260,445円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	316,092,415円	399,938,554円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,146,139,820円	2,142,723,580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	3,542,424,372円	3,525,817,581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）	1,593,046,655円	1,674,097,610円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,546,069円	4,817,538円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	24,979,029円	25,357,198円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	96,410,954円	98,319,875円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	254,848,043円	250,121,943円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,110,973,037円	4,124,627,041円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,390,321,836円	1,454,716,704円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,314,190,148円	1,432,122,591円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	714,039,343円	792,824,193円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	102,165,160円	115,982,628円
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	6,790,875,434円	6,808,172,713円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	315,499,139円	325,508,322円
	計	31,007,104,895円	32,868,131,139円
２．	受益権の総数	31,007,104,895口	32,868,131,139口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	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。	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

（１口当たり情報）

2020年10月26日現在		2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4128円	1口当たり純資産額	1.4129円
(1万口当たり純資産額)	(14,128円)	(1万口当たり純資産額)	(14,129円)

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	94,568,404	57,162,035
コール・ローン	18,168,132	70,810,262
国債証券	151,573,682,113	152,903,069,713
派生商品評価勘定	46,431	4,920
未収入金	165,967,376	-
未収利息	1,147,349,861	1,136,894,294
前払費用	29,999,629	14,951,447
流動資産合計	153,029,781,946	154,182,892,671
資産合計	153,029,781,946	154,182,892,671
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	163,507	-
未払解約金	194,737,553	69,251,796
未払利息	5	6
流動負債合計	194,901,065	69,251,802
負債合計	194,901,065	69,251,802

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
純資産の部		
元本等		
元本	62,305,294,771	61,667,891,541
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	90,529,586,110	92,445,749,328
元本等合計	152,834,880,881	154,113,640,869
純資産合計	152,834,880,881	154,113,640,869
負債純資産合計	153,029,781,946	154,182,892,671

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
1．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	66,014,655,688円	62,305,294,771円
	期首からの追加設定元本額	7,433,213,464円	1,211,586,433円
	期首からの一部解約元本額	11,142,574,381円	1,848,989,663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）	13,606,901,842円	14,105,643,267円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	290,429,905円	329,038,172円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	372,429,728円	425,724,744円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	471,286,049円	562,210,019円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	361,323,232円	450,027,116円

	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	22,100,204,303円	21,638,796,590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	2,032,710,032円	2,022,353,411円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	15,849,657,187円	15,109,976,718円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,006,742,263円	919,429,760円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	150,608,646円	158,364,070円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	2,599,441円	2,710,903円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	2,854,393円	2,854,666円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	6,124,228円	6,181,784円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	11,219,101円	10,850,280円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	792,945,418円	784,023,198円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	782,824,655円	776,126,267円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	61,105,570円	63,137,714円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	83,466,931円	89,831,565円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	81,761,903円	89,795,177円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	58,449,486円	65,184,782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	3,900,506,886円	3,784,297,374円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,143,572円	271,333,964円
	計	62,305,294,771円	61,667,891,541円
２．	受益権の総数	62,305,294,771口	61,667,891,541口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年 4月26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

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,634,190	－	23,635,495	1,305
	米ドル	23,634,190	－	23,635,495	1,305
	売建	215,564,043	－	215,682,424	△118,381
	米ドル	115,173,465	－	115,159,000	14,465
	ユーロ	76,756,388	－	76,892,400	△136,012
	豪ドル	23,634,190	－	23,631,024	3,166
合計		239,198,233	－	239,317,919	△117,076

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	12,951,600	－	12,946,680	4,920
	米ドル	12,951,600	－	12,946,680	4,920
合計		12,951,600	－	12,946,680	4,920

（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中間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同中間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同中間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。

・同中間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。

・同中間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中間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中間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。

（１口当たり情報）

2020年10月26日現在		2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2.4530円	1口当たり純資産額	2.4991円
(1万口当たり純資産額)	(24,530円)	(1万口当たり純資産額)	(24,991円)

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	80,664,456	24,832,431
コール・ローン	265,782,979	46,378,816
国債証券	24,438,089,823	24,994,068,943
派生商品評価勘定	328,393,143	149,453,049
未収利息	234,079,598	223,996,867
前払費用	12,867,726	8,062,621
流動資産合計	25,359,877,725	25,446,792,727
資産合計	25,359,877,725	25,446,792,727
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,469,202	51,008,530
未払解約金	12,281,934	5,711,552
未払利息	74	4
流動負債合計	17,751,210	56,720,086
負債合計	17,751,210	56,720,086
純資産の部		
元本等		
元本	15,326,314,880	15,826,410,180
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	10,015,811,635	9,563,662,461
元本等合計	25,342,126,515	25,390,072,641
純資産合計	25,342,126,515	25,390,072,641
負債純資産合計	25,359,877,725	25,446,792,727

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10月26日現在	2021年 4月26日現在
１．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	15,247,027,897円	15,326,314,880円
	期首からの追加設定元本額	3,146,539,886円	958,580,404円
	期首からの一部解約元本額	3,067,252,903円	458,485,104円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（ＤＣ専用）	3,833,097,916円	3,945,142,277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）	1,136,513,820円	1,202,081,182円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	3,874,458円	4,218,143円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,256,652円	4,447,455円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	9,124,934円	9,571,554円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	16,682,495円	16,871,204円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	9,335,627,641円	9,650,420,293円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	90,986,014円	98,504,807円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	124,325,198円	139,339,041円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	121,687,096円	137,952,061円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	87,021,402円	101,971,299円

	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）１年決算型	563,117,254円	515,890,864円
	計	15,326,314,880円	15,826,410,180円
２．	受益権の総数	15,326,314,880口	15,826,410,180口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年 4月26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

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,064,619,601	－	24,741,695,660	322,923,941
	米ドル	10,952,310,532	－	10,807,974,230	144,336,302
	加ドル	515,832,567	－	509,256,070	6,576,497

	メキシコペソ	190,817,894	—	194,779,200	△3,961,306
	ユーロ	10,180,865,945	—	10,067,752,040	113,113,905
	英ポンド	1,665,216,835	—	1,632,757,360	32,459,475
	スウェーデンクローナ	117,932,268	—	116,741,560	1,190,708
	ノルウェークローネ	66,912,852	—	64,308,700	2,604,152
	デンマーククローネ	128,076,286	—	127,055,840	1,020,446
	ポーランドズロチ	131,543,481	—	126,715,590	4,827,891
	豪ドル	667,172,388	—	650,114,680	17,057,708
	シンガポールドル	105,907,660	—	105,362,210	545,450
	マレーシアリンギット	250,760,018	—	248,111,910	2,648,108
	イスラエルシュケル	91,270,875	—	90,766,270	504,605
合計		25,064,619,601	—	24,741,695,660	322,923,941

（2021年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,222,105,543	—	25,123,661,024	98,444,519
	米ドル	11,096,376,855	—	10,986,273,200	110,103,655
	加ドル	501,951,874	—	498,465,596	3,486,278
	メキシコペソ	222,354,537	—	226,648,842	△4,294,305
	ユーロ	10,295,261,594	—	10,323,872,361	△28,610,767
	英ポンド	1,638,772,384	—	1,621,434,236	17,338,148
	スウェーデンクローナ	120,811,078	—	121,235,400	△424,322
	ノルウェークローネ	69,503,295	—	69,988,059	△484,764
	デンマーククローネ	81,713,947	—	81,922,832	△208,885
	ポーランドズロチ	163,434,065	—	164,922,098	△1,488,033
	豪ドル	575,359,801	—	571,433,709	3,926,092
	シンガポールドル	102,819,045	—	103,350,415	△531,370

	マレーシアリンギット	256,144,738	－	253,846,469	2,298,269
	イスラエルシュケル	97,602,330	－	100,267,807	△2,665,477
合計		25,222,105,543	－	25,123,661,024	98,444,519

（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中間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同中間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同中間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。

・同中間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。

・同中間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中間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中間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。

（１口当たり情報）

2020年10月26日現在		2021年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6535円	1口当たり純資産額	1.6043円
(1万口当たり純資産額)	(16,535円)	(1万口当たり純資産額)	(16,043円)

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 4月30日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	306,881,550円
Ⅱ　負債総額	3,188,655円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	303,692,895円
Ⅳ　発行済口数	181,765,868口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6708円

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	38,068,516,587円
Ⅱ　負債総額	293,988,089円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	37,774,528,498円
Ⅳ　発行済口数	20,707,148,354口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8242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	235,329,901,211円
Ⅱ　負債総額	1,585,689,900円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	233,744,211,311円
Ⅳ　発行済口数	64,010,638,866口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.6516円

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	15,335,206,297円
Ⅱ　負債総額	186,567,808円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,148,638,489円
Ⅳ　発行済口数	6,388,204,190口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3713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	46,553,772,138円
Ⅱ　負債総額	61,789,775円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	46,491,982,363円
Ⅳ　発行済口数	32,951,665,903口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4109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	155,923,962,538円
Ⅱ　負債総額	391,541,094円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	155,532,421,444円
Ⅳ　発行済口数	61,864,637,184口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5141円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	25,534,051,112円
Ⅱ　負債総額	197,361,109円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,336,690,003円
Ⅳ　発行済口数	15,868,677,651口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5966円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
　　該当事項はありません。
（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

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。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2021年4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（2021年4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（2021年4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、2021年4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			843	259,595
	株式投資信託		777	224,543
		単位型	274	10,924
		追加型	503	213,618
	公社債投資信託		66	35,052
		単位型	53	2,011
		追加型	13	33,040

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。

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62期事業年度（2020年４月１日から2021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。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第61期 (2020年３月31日)		第62期 (2021年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,591		24,698
有価証券		19		17
前払費用		603		785
未収入金		14		225
未収委託者報酬		16,912		24,738
未収収益	※3	1,412	※3	891
関係会社短期貸付金		2,371		2,403
立替金		1,437		930
その他	※2	1,316	※2	361
流動資産合計		48,679		55,053
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	182	※1	245
器具備品	※1	135	※1	190
有形固定資産合計		318		436
無形固定資産				
ソフトウエア		120		241
無形固定資産合計		120		241
投資その他の資産				
投資有価証券		17,826		22,903
関係会社株式		25,769		25,987
長期差入保証金		484		678

繰延税金資産	2,022	1,845
投資その他の資産合計	46,102	51,414
固定資産合計	46,540	52,092
資産合計	95,220	107,145

（単位：百万円）

		第61期 (2020年３月31日)		第62期 (2021年３月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		554		844
未払金		5,881		9,834
未払収益分配金		8		8
未払償還金		71		71
未払手数料		5,202		8,956
その他未払金		599		798
未払費用	※3	4,289	※3	4,660
未払法人税等		1,439		1,090
未払消費税等	※4	746	※4	775
賞与引当金		2,718		3,034
役員賞与引当金		55		55
その他		42		643
流動負債合計		15,726		20,938
固定負債				
退職給付引当金		1,395		1,456
賞与引当金		－		156
その他		695		544
固定負債合計		2,091		2,157
負債合計		17,818		23,095
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		55,395		61,956
利益剰余金合計		55,395		61,956
自己株式		△905		△2,067
株主資本合計		77,073		82,472
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		△60		1,461
繰延ヘッジ損益		389		115
評価・換算差額等合計		329		1,577
純資産合計		77,402		84,049
負債純資産合計		95,220		107,145

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第61期 (自　2019年４月１日 至　2020年３月31日)	第62期 (自　2020年４月１日 至　2021年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,265	78,975
その他営業収益	2,994	3,973
営業収益合計	77,259	82,948
営業費用		
支払手数料	31,322	34,050
広告宣伝費	953	953
公告費	2	1
調査費	17,275	17,813
調査費	920	966
委託調査費	16,333	16,825
図書費	21	22
委託計算費	534	545
営業雑経費	1,058	1,053
通信費	116	174
印刷費	337	331
協会費	52	51
諸会費	10	11
その他	541	483
営業費用計	51,148	54,419
一般管理費		
給料	9,857	10,383
役員報酬	360	243
役員賞与引当金繰入額	55	55
給料・手当	6,675	6,766
賞与	64	159
賞与引当金繰入額	2,702	3,158
交際費	92	14
寄付金	29	30
旅費交通費	420	57
租税公課	440	485
不動産賃借料	901	939
退職給付費用	387	388
退職金	82	10
固定資産減価償却費	118	138
福利費	1,014	1,084
諸経費	3,229	4,286
一般管理費計	16,573	17,817
営業利益	9,538	10,711

（単位：百万円）

		第61期 (自　2019年４月１日 至　2020年３月31日)		第62期 (自　2020年４月１日 至　2021年３月31日)
営業外収益				
受取利息		99		75
受取配当金	※１	4,881	※１	2,555
有価証券償還益		－		14

デリバティブ収益	223	－
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	5	－
その他	145	62
営業外収益合計	5,357	2,710
営業外費用		
支払利息	185	122
有価証券償還損	0	－
デリバティブ費用	－	804
時効成立後支払分配金・償還金	1	25
為替差損	－	59
その他	12	42
営業外費用合計	199	1,054
経常利益	14,695	12,367
特別利益		
投資有価証券売却益	164	774
その他	－	0
特別利益合計	164	774
特別損失		
投資有価証券売却損	19	237
投資有価証券評価損	21	5
固定資産処分損	0	0
役員退職一時金	－	125
特別損失合計	41	369
税引前当期純利益	14,818	12,773
法人税、住民税及び事業税	3,307	3,722
法人税等調整額	45	△373
法人税等合計	3,353	3,348
当期純利益	11,465	9,424

（3）【株主資本等変動計算書】

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

第62期（自　2020年４月１日　至　2021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	利益剰余金合計		
				繰越利益剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	△905	77,073
当期変動額							
剰余金の配当				△2,862	△2,862		△2,862
当期純利益				9,424	9,424		9,424
自己株式の取得						△1,161	△1,161
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	6,561	6,561	△1,161	5,399
当期末残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	△2,067	82,472

	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
当期変動額				
剰余金の配当				△2,862
当期純利益				9,424
自己株式の取得				△1,161
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,521	△273	1,247	1,247
当期変動額合計	1,521	△273	1,247	6,647
当期末残高	1,461	115	1,577	84,049

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第62期 （自　2020年４月１日 至　2021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
当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（貸借対照表関係）

第61期 (2020年３月31日)	第62期 (2021年３月31日)
※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	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,349百万円 器具備品　764百万円
※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) 未収収益　151百万円 (流動負債) 未払費用　623百万円	※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　257百万円 (流動負債) 未払費用　1,247百万円
※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61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	第62期 （自　2020年４月１日 至　2021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　4,849百万円	※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　2,498百万円

（株主資本等変動計算書関係）

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

（変動事由の概要）
2019年８月13日の取締役会決議による自己株式の取得　　88,800株

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

第62期（自　2020年４月１日　至　2021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）	1,454,500	1,405,500	―	2,860,000

（変動事由の概要）
2020年３月25日の取締役会決議による自己株式の取得　　594,300株
2020年７月17日の取締役会決議による自己株式の取得　　811,200株

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	
2011年度ストックオプション(1)	普通株式	1,184,700	―	752,400	432,300	―
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	1,346,000	―	330,000	1,016,000	―
2016年度ストックオプション(2)	普通株式	2,394,000	―	622,000	1,772,000	―
2017年度ストックオプション(1)	普通株式	2,939,000	―	332,000	2,607,000	―
合計		7,863,700	―	2,036,400	5,827,300	―

(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)432,300株、2016年度ストックオプション(1)1,016,000株、2016年度ストックオプション(2)1,088,000株及び2017年度ストックオプション874,000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(2)684,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,733,000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
2021年５月25日取締役会	普通株式	利益剰余金	5,191	26.74	2021年３月31日	2021年６月29日

(リース取引関係)

第61期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）	第62期（自　2020年４月１日　至　2021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　912百万円	１年内　911百万円
１年超　6,148百万円	１年超　5,236百万円
合計　7,060百万円	合計　6,148百万円

（金融商品関係）

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

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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

2021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	24,698	24,698	－
(2) 未収委託者報酬	24,738	24,738	－
(3) 未収収益	891	891	－
(4) 関係会社短期貸付金	2,403	2,403	－
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	22,905	22,905	－
(6) 未払金	(9,834)	(9,834)	－
(7) 未払費用	(4,660)	(4,660)	－
(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	(188)	(188)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	(453)	(453)	－
デリバティブ取引計	(642)	(642)	－

(※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、上記金額は貸借対照表上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23,094百万円）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	24,698	－	－	－
未収委託者報酬	24,738	－	－	－
未収収益	891	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	17	812	10,348	20
合計	50,346	812	10,348	20

（有価証券関係）

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

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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	23,094

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	16,914	14,476	2,438
	小計	16,914	14,476	2,438
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,990	6,322	△332
	小計	5,990	6,322	△332
合計		22,905	20,799	2,105

(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5百万円（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	5,735	774	237
合計	5,735	774	237

（デリバティブ取引関係）

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	為替予約取引				
	売建				

の取引	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 売建 米ドル	投資有価証券	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。

第62期(2021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	2,670	－	△75	△75
	買建	－	－	－	－
合計		2,670	－	△75	△75

(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	1,713	－	△112	△112
合計		1,713	－	△112	△112

(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 売建 米ドル	投資有価証券	4,620	－	△273
	香港ドル		862	－	△57
	人民元		1,684	－	△117
	ユーロ		180	－	△5
合計			7,347	－	△453

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

（持分法損益等）

第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	第62期 （自　2020年４月１日 至　2021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　3,002	(1)関連会社に対する投資の金額　3,010
(2)持分法を適用した場合の投資の金額　10,485	(2)持分法を適用した場合の投資の金額　12,258
(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,631	(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　2,751

（退職給付関係）

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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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	1,363
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	6
退職給付の支払額	△86
退職給付債務の期末残高	1,429

(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	1,429
未積立退職給付債務	1,429
未認識数理計算上の差異	27
貸借対照表に計上された負債の額	1,456

退職給付引当金	1,456
貸借対照表に計上された負債の額	1,456

(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	2
確定給付制度に係る退職給付費用	147

(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、240百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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

	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

	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	1,184,700	1,346,000
付与	0	0
失効	752,400	330,000

権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
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	2,394,000	2,939,000
付与	0	0
失効	622,000	332,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,772,000	2,607,000
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

	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　　1,738百万円
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61期 (2020年３月31日)	第62期 (2021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	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	0.6%
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%

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	929
投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	446
固定資産減価償却費	90
その他	978
繰延税金資産小計	3,972
評価性引当金	△1,430
繰延税金資産合計	2,541
繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	51
その他有価証券評価差額金	645
繰延税金負債合計	696
繰延税金資産の純額	1,845

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	0.3%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	△5.7%
その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%

（関連当事者情報）

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	シンガポール	342,369(SGD千)	アセットマネジメン	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)

	Limited	国		ト業			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　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。

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

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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(米国ドル貸建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	1,825(USD 16,500 千)

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	―	貸付金利息 (米国ドル貸建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注1)	―	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (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	1,783 (USD 17,000 千)	―	―
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750 千)	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　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。

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。

3　Nikko Asset Management Luxembourg S.A.の行った70,000株の新株発行増資を、1株につき25ユーロで当社が引き受けたものであります。

2　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(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2020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	30,151百万円
負債合計	5,919百万円
純資産合計	24,231百万円

営業収益	19,946百万円
税引前当期純利益	7,020百万円
当期純利益	5,194百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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。

第62期(自　2020年４月１日　至　2021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61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	第62期 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
１株当たり純資産額	395円50銭	432円90銭
１株当たり当期純利益金額	58円61銭	48円45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61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	第62期 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
当期純利益（百万円）	11,465	9,424
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）	11,465	9,424
普通株式の期中平均株式数（千株）	195,599	194,509
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	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	2011年度ストックオプション（1）432,300株、2016年度ストックオプション（1）1,016,000株、2016年度ストックオプション（2）1,772,000株、2017年度ストックオプション（1）2,607,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期 (2020年３月31日)	第62期 (2021年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	77,402	84,049
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）	77,402	84,049
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）	195,558	194,152

（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
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社きらやか銀行	22,700百万円	
株式会社三十三銀行　※1	37,461百万円 （2021年5月1日現在）	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社琉球銀行　※1	56,967百万円	
ソニー生命保険株式会社　※1	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

信金中央金庫	690,998百万円 （出資の総額）	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

※1　募集の取扱いを行ないません。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（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【その他】

（1）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
（2）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
① 委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
② ファンドの基本的性格など
③ 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④ 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
⑤ 目論見書の使用開始日
（3）目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
① 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
② 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
③ 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
④ 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
⑤ 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
⑥ 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
⑦ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
⑧ 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨ 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
⑩ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
⑪ 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
⑫ 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
（4）有価証券届出書本文「第一部　証券情報」、「第二部　ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
（5）目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部　ファンド情報」中「第１　ファンドの状況」「２　投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
（6）投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
（7）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

（８）交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

① ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

② 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

③ 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年６月11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2021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

2020年12月２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」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2019年10月29日から2020年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2020年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

2021年５月26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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2020年10月27日から2021年４月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2021年４月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年10月27日から2021年４月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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。

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、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。

・　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、経営者に対して、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

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。