

## 【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8月6日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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】	DCインデックスバランス（株式80）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****（１）【ファンドの名称】**

DCインデックスバランス（株式80）（以下「ファンド」といいます。）

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

**（２）【内国投資信託受益証券の形態等】**

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

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

**（３）【発行（売出）価額の総額】**

5兆円を上限とします。

**（４）【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

**（５）【申込手数料】**

ありません。

**（６）【申込単位】**

1円以上1円単位

**（７）【申込期間】**

2021年8月7日から2022年2月8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/](http://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。

**（ 1 0 ） 【 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。

**（ 1 1 ） 【 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。

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

## 1.

## 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

## 2.

## インデックスファンドで構成しています。

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

## &lt;国内株式&gt;

## 「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。

## &lt;海外株式&gt;

## 「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。

## &lt;国内債券&gt;

## 「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。

## &lt;海外債券&gt;

## 「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

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

### 3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%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	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	20%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

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

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

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



#### 主な投資制限

- ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

#### 分配方針

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

#### 信託金限度額

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

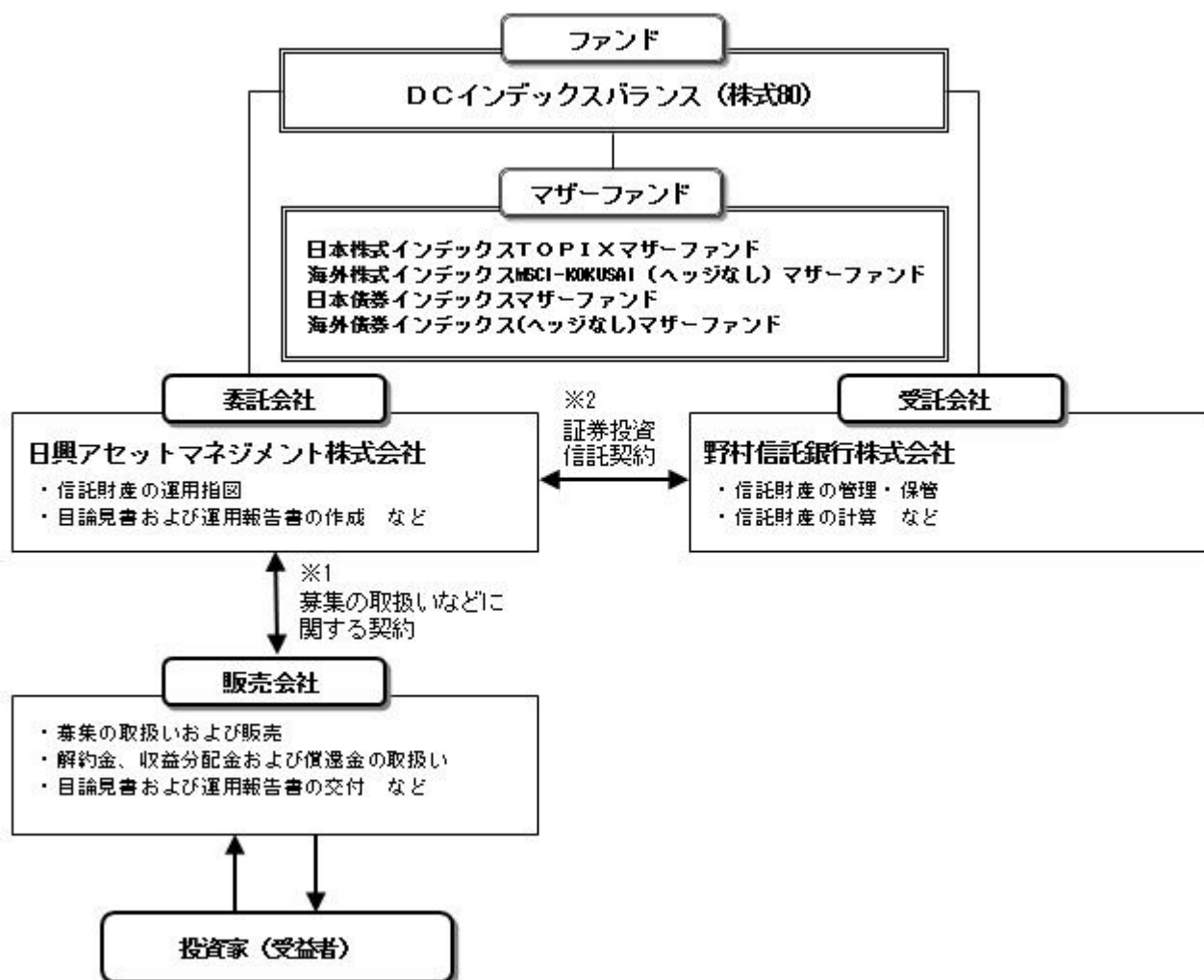
#### (2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2021年5月末現在）

- 1) 資本金  
17,363百万円
- 2) 沿革  
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立  
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	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「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。

株式の標準実質組入比率.....80%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....20%

- ・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。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）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。

## （２）【投資対象】

### < DCインデックスバランス（株式80） >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証券
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 10) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)～12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 15) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で16)に定めるもの以外のもの

- 16) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 17) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 18) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 19) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引
    - 4) 金利先渡取引
    - 5) 為替先渡取引
    - 6) 有価証券の貸付
    - 7) 公社債の空売
    - 8) 公社債の借入
    - 9) 外国為替予約取引
    - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
  - 1) 信用取引
  - 2) 先物取引等
  - 3) スワップ取引
  - 4) 金利先渡取引
  - 5) 有価証券の貸付
  - 6) 公社債の空売
  - 7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの

- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 為替先渡取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>  
わが国の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))には投資しません。
  - 1) 国債証券
  - 2) 地方債証券
  - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であっ

て当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)

- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
  - 1) 先物取引等
  - 2) スワップ取引
  - 3) 金利先渡取引
  - 4) 有価証券の貸付
  - 5) 公社債の空売
  - 6) 公社債の借入

#### < 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
  - 2) スワップ取引
  - 3) 金利先渡取引
  - 4) 為替先渡取引
  - 5) 有価証券の貸付
  - 6) 公社債の空売
  - 7) 公社債の借入
  - 8) 外国為替予約取引

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・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、</li> <li>・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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

### ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

\* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

<b>運用の基本方針</b>	
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） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびコ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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### < 日本債券インデックスマザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
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 <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>



主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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 >

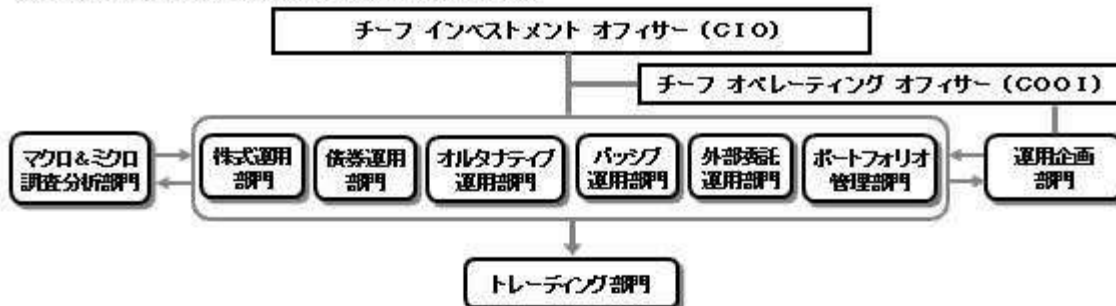
<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
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）

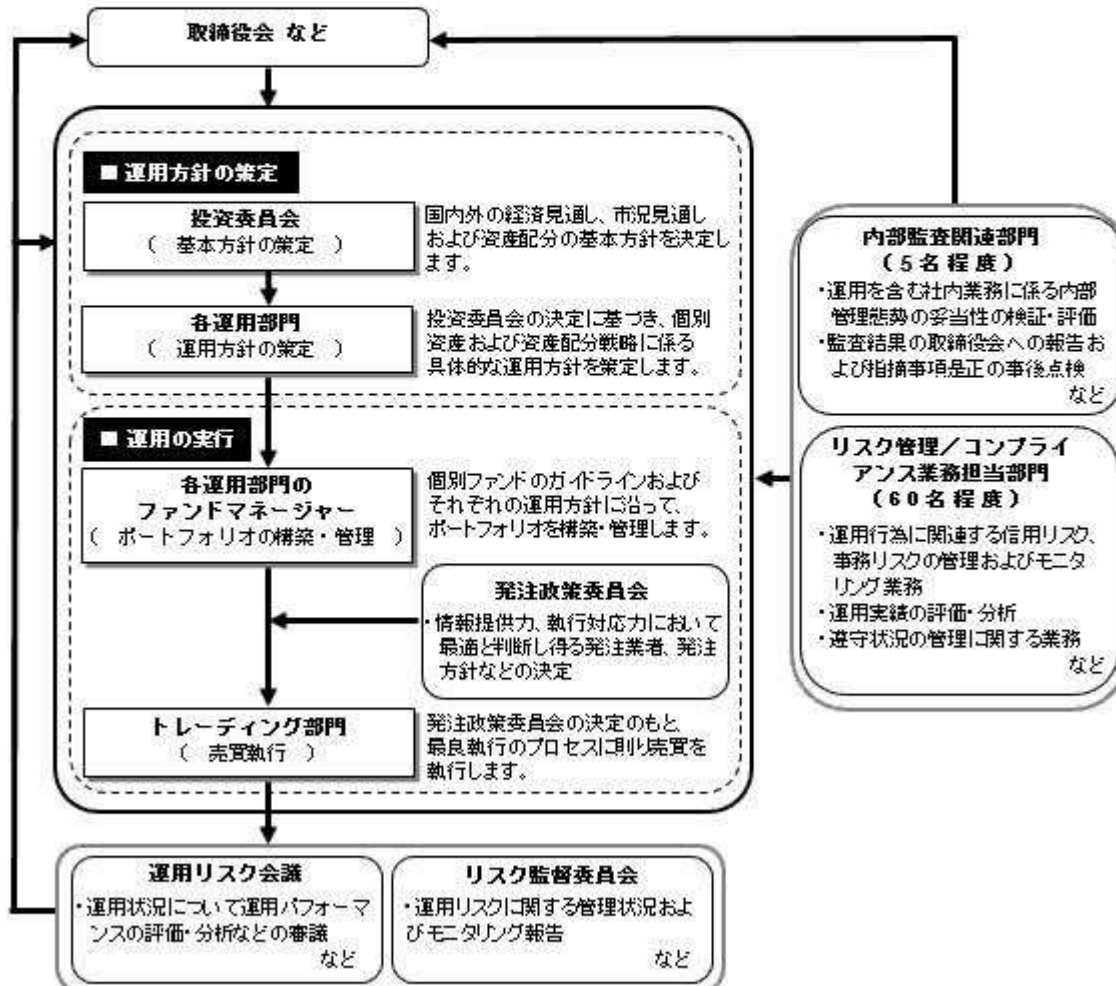
\* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

## 1) 分配対象額の範囲

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

## 2) 分配対象額についての分配方針

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

## 3) 留保益の運用方針

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

## 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

## &lt; DCインデックスバランス（株式80） &gt;

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（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
  - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
  - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

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

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法

により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商



品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、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。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

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

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### <その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

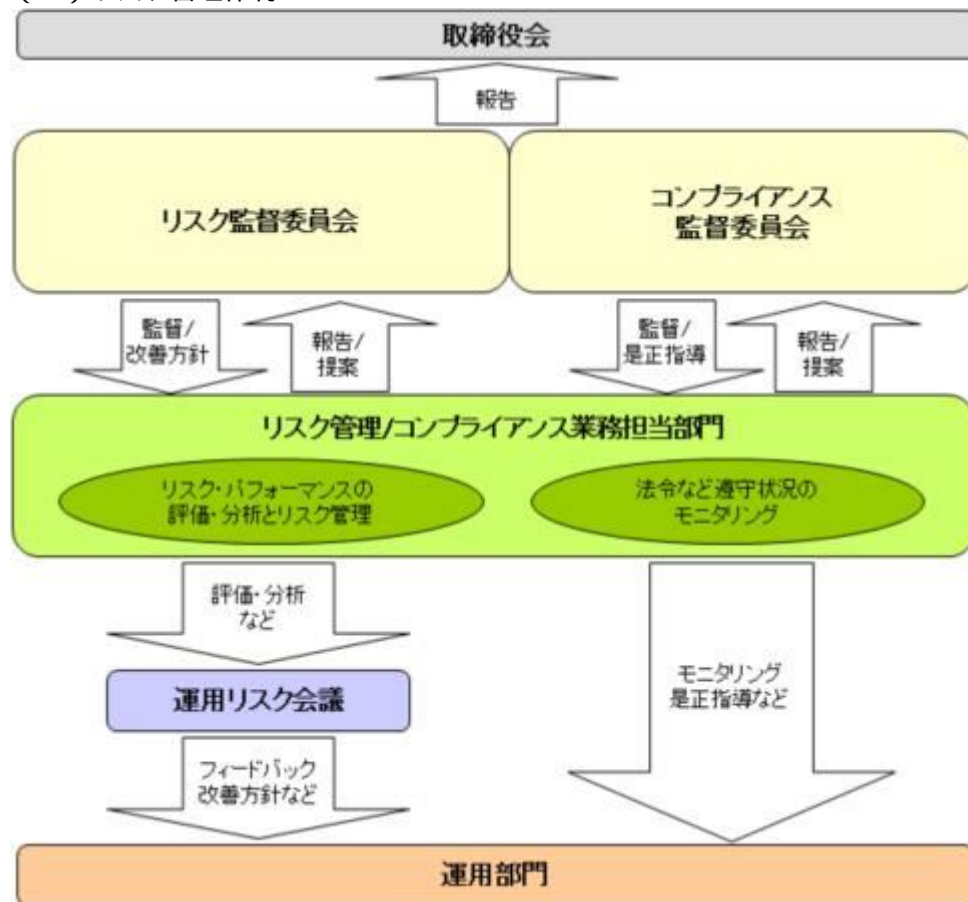
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限さ

れることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### 全社的リスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

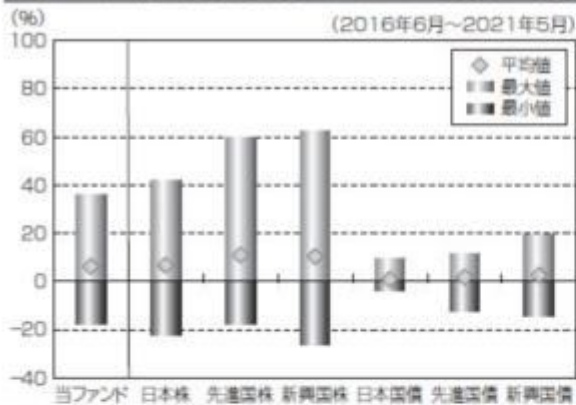
### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2021年5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	6.2%	6.7%	11.0%	10.3%	0.8%	1.8%	2.7%
最大値	35.8%	42.1%	59.8%	62.7%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-17.8%	-22.0%	-17.5%	-26.0%	-4.0%	-12.3%	-14.5%

※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6月から2021年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

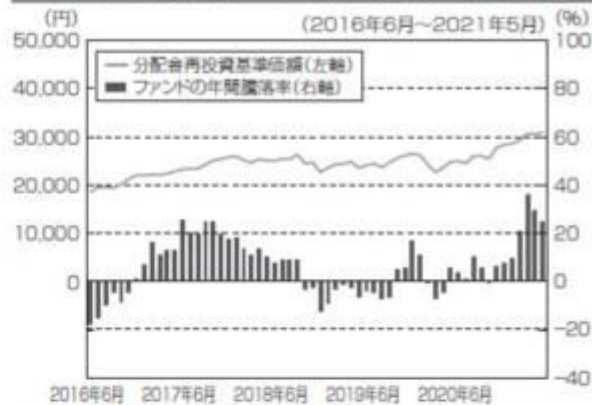
## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income

## 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6月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%（税抜0.14%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.14%	0.04%	0.08%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

##### (4)【その他の手数料等】

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

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

- \* 監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

( 5 ) 【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1 ) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）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。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1 ) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

## 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本

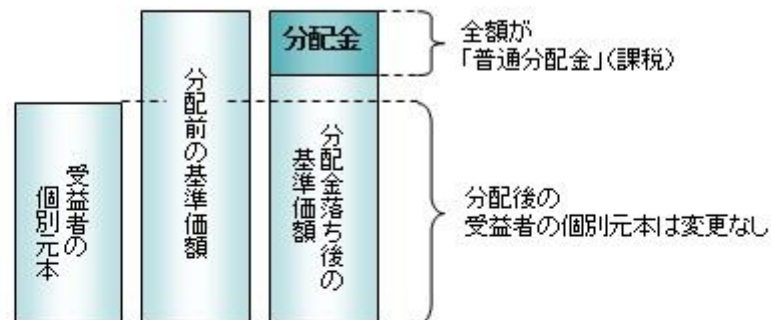
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

## 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

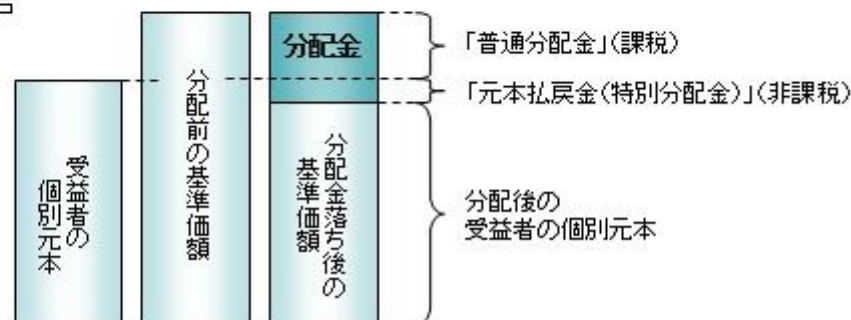
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
  - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

## 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8月6日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【DCインデックスバランス(株式80)】

以下の運用状況は2021年5月31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	10,988,927,288	95.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		574,460,754	4.97
合計（純資産総額）		11,563,388,042	100.00

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,744,402,165	1.5999	5,990,813,319	1.8494	6,924,897,363	59.89
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	629,125,763	2.8720	1,806,874,438	3.7054	2,331,162,602	20.16
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	454,740,600	2.4526	1,115,312,667	2.5470	1,158,224,308	10.02
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	407,086,296	1.4135	575,446,836	1.4116	574,643,015	4.97

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.03
合計	95.03

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き



第9計算期間末	(2011年11月 7日)	1,457	1,459	1.0736	1.0746
第10計算期間末	(2012年11月 6日)	1,612	1,614	1.1223	1.1233
第11計算期間末	(2013年11月 6日)	2,382	2,383	1.6841	1.6851
第12計算期間末	(2014年11月 6日)	2,987	2,989	1.9687	1.9697
第13計算期間末	(2015年11月 6日)	3,522	3,524	2.2109	2.2119
第14計算期間末	(2016年11月 7日)	3,295	3,297	1.9763	1.9773
第15計算期間末	(2017年11月 6日)	4,675	4,677	2.5453	2.5463
第16計算期間末	(2018年11月 6日)	5,965	5,967	2.4596	2.4606
第17計算期間末	(2019年11月 6日)	7,720	7,723	2.5870	2.5880
第18計算期間末	(2020年11月 6日)	9,106	9,109	2.6461	2.6471
	2020年 5月末日	8,056		2.4784	
	6月末日	8,221		2.4889	
	7月末日	8,155		2.4479	
	8月末日	8,715		2.6028	
	9月末日	8,812		2.6042	
	10月末日	8,716		2.5415	
	11月末日	9,621		2.7705	
	12月末日	9,942		2.8381	
	2021年 1月末日	10,097		2.8532	
	2月末日	10,415		2.9222	
	3月末日	11,121		3.0684	
	4月末日	11,253		3.0454	
	5月末日	11,563		3.0829	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010
当中間期	2020年11月 7日～2021年 5月 6日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	6.13
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	4.63
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	50.15
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	16.96
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	12.35
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	10.57
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	28.84
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	3.33
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	5.22
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	2.32
当中間期	2020年11月 7日～2021年 5月 6日	15.99

(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9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	231,238,595	111,194,193
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	239,405,768	160,145,471
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	337,947,290	360,574,596
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	382,949,221	279,756,877
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	498,795,450	423,102,531
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	409,317,117	335,093,532
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	719,523,758	550,004,012
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	902,995,339	314,754,593
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	975,568,818	416,413,525
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1,136,417,948	679,513,255
当中間期	2020年11月 7日～2021年 5月 6日	643,961,145	387,138,767

#### （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 5月31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	38,196,325,740	98.36
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		636,177,980	1.64

合計(純資産総額)	38,832,503,720	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	617,120,000	1.59

(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	146,600	7,025.48	1,029,935,734	9,115.00	1,336,259,000	3.44
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	90,700	8,119.72	736,459,328	10,785.00	978,199,500	2.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	112,700	6,962.00	784,617,688	8,256.00	930,451,200	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	14,200	49,262.18	699,523,091	53,870.00	764,954,000	1.97
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	976,500	428.30	418,235,792	620.00	605,430,000	1.56
日本	株式	任天堂	その他製品	8,300	55,252.65	458,597,000	67,700.00	561,910,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	99,100	4,179.03	414,142,641	5,555.00	550,500,500	1.42
日本	株式	信越化学工業	化学	26,200	15,062.92	394,648,621	18,855.00	494,001,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	166,100	2,245.93	373,050,436	2,931.50	486,922,150	1.25
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	120,400	3,505.32	422,041,240	3,719.00	447,767,600	1.15
日本	株式	日本電産	電気機器	34,800	10,754.97	374,273,189	12,530.00	436,044,000	1.12
日本	株式	KDDI	情報・通信業	113,900	2,856.25	325,327,544	3,717.00	423,366,300	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,500	29,136.98	247,664,410	48,660.00	413,610,000	1.07
日本	株式	HOYA	精密機器	28,500	11,842.56	337,513,160	14,350.00	408,975,000	1.05
日本	株式	日立製作所	電気機器	69,600	3,717.10	258,710,540	5,736.00	399,225,600	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,400	19,548.16	359,686,290	21,605.00	397,532,000	1.02
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	98,800	3,005.97	296,990,676	3,951.00	390,358,800	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,000	2,606.41	297,131,547	3,353.00	382,242,000	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	42,500	7,453.70	316,782,440	8,279.00	351,857,500	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	12,700	21,711.24	275,732,864	26,300.00	334,010,000	0.86
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	194,000	1,319.33	255,951,631	1,673.00	324,562,000	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	97,700	2,572.45	251,329,216	3,249.00	317,427,300	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	113,800	2,696.44	306,854,872	2,530.00	287,914,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	4,200	56,544.73	237,487,866	65,520.00	275,184,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	113,900	1,805.15	205,606,585	2,414.00	274,954,600	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	55,800	3,439.72	191,936,742	4,736.00	264,268,800	0.68

日本	株式	三菱商事	卸売業	86,800	2,456.26	213,203,950	2,984.00	259,011,200	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	144,700	1,377.99	199,396,504	1,692.00	244,832,400	0.63
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	47,000	4,940.50	232,203,680	5,179.00	243,413,000	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	14,700	15,377.91	226,055,392	16,310.00	239,757,000	0.62

#### 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	2.29
		食料品	3.33
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.26
		医薬品	5.00
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.66
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.61
		機械	5.53
		電気機器	17.50
		輸送用機器	7.51
		精密機器	2.66
		その他製品	2.52
		電気・ガス業	1.20
		陸運業	3.27
		海運業	0.27
		空運業	0.47
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.87
		卸売業	4.65
		小売業	4.45
銀行業	5.09		
証券、商品先物取引業	0.81		
保険業	1.92		
その他金融業	1.10		
不動産業	1.97		
サービス業	5.52		
合計			98.36

## 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	32	日本円	610,887,600	617,120,000	1.59

(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 5月31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	154,719,899,197	66.19
	カナダ	8,589,078,004	3.67
	ドイツ	7,065,540,358	3.02
	イタリア	1,426,030,849	0.61
	フランス	7,924,926,728	3.39
	オランダ	4,358,934,234	1.86
	スペイン	1,929,469,520	0.83
	ベルギー	665,962,168	0.28
	オーストリア	163,305,181	0.07
	ルクセンブルク	228,027,924	0.10
	フィンランド	927,060,888	0.40
	アイルランド	4,441,595,349	1.90
	ポルトガル	126,402,591	0.05
	イギリス	10,148,405,775	4.34
	スイス	7,812,434,202	3.34
	スウェーデン	2,679,137,610	1.15
	ノルウェー	459,085,287	0.20
	デンマーク	1,878,407,373	0.80
	ケイマン	449,644,427	0.19
	オーストラリア	4,871,483,211	2.08
バミューダ	325,835,105	0.14	
ニュージーランド	222,259,567	0.10	
パプアニューギニア	24,416,507	0.01	
香港	1,967,731,925	0.84	

	シンガポール	701,970,967	0.30
	イスラエル	496,953,089	0.21
	ジャージー	804,545,059	0.34
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	54,925,711	0.02
	小計	225,463,468,806	96.45
投資証券	アメリカ	4,392,276,456	1.88
	カナダ	14,055,935	0.01
	フランス	127,053,120	0.05
	イギリス	139,814,804	0.06
	オーストラリア	335,120,396	0.14
	香港	92,608,162	0.04
	シンガポール	95,823,112	0.04
	小計	5,196,751,985	2.22
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,095,950,514	1.32
合計（純資産総額）		233,756,171,305	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	2,767,532,544	1.18
	買建	ドイツ	555,609,456	0.24

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,918,148,440	0.82
	売建		130,872,743	0.06

(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	663,068	12,628.98	8,373,876,224	13,677.19	9,068,909,406	3.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	283,004	23,741.08	6,718,822,868	27,404.87	7,755,689,754	3.32
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	16,925	351,654.57	5,951,753,699	353,764.16	5,987,458,462	2.56

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	95,040	31,260.74	2,971,021,262	36,081.40	3,429,176,712	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	11,647	180,356.53	2,100,612,556	264,692.82	3,082,877,340	1.32
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	11,885	179,399.42	2,132,162,193	258,687.85	3,074,505,169	1.32
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	120,290	11,417.23	1,373,379,222	18,026.98	2,168,465,713	0.93
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自 動車部品	30,500	46,841.86	1,428,676,811	68,624.14	2,093,036,490	0.90
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	104,051	15,949.22	1,659,532,873	18,576.88	1,932,942,941	0.83
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	24,365	59,655.65	1,453,510,097	71,319.85	1,737,708,213	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	54,170	23,365.70	1,265,720,445	31,768.93	1,720,923,176	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	37,490	36,305.31	1,361,086,267	45,212.33	1,695,010,597	0.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	66,622	21,742.35	1,448,519,402	24,948.44	1,662,115,503	0.71
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバコ	113,833	12,989.51	1,478,634,949	13,546.63	1,542,054,580	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	42,540	31,074.15	1,321,894,494	35,003.56	1,489,051,510	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	97,969	15,625.43	1,530,808,105	14,801.13	1,450,052,493	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	307,469	2,737.41	841,670,068	4,652.72	1,430,569,133	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・ 娯楽	71,452	14,135.99	1,010,044,786	19,608.62	1,401,075,402	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェ ア・サービ ス	35,145	36,191.16	1,271,938,487	39,577.26	1,390,942,831	0.60
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェ ア・サービ ス	43,957	22,298.84	980,190,181	28,539.79	1,254,523,778	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	16,782	42,585.49	714,669,707	73,864.60	1,239,595,751	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・ 娯楽	180,314	4,955.66	893,575,598	6,293.63	1,134,831,114	0.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	166,921	3,760.37	627,685,990	6,406.69	1,069,411,302	0.46
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	27,733	36,256.03	1,005,488,590	38,474.79	1,067,021,517	0.46
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	18,934	53,617.76	1,015,198,668	55,382.70	1,048,616,057	0.45
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	161,782	5,295.91	856,784,529	6,269.49	1,014,290,825	0.43
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	163,387	6,361.68	1,039,417,379	6,200.34	1,013,055,344	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	161,172	5,545.07	893,710,860	6,068.63	978,093,299	0.42
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	166,800	4,260.88	710,715,318	5,806.30	968,491,507	0.41
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活 必需品小売 り	62,112	15,768.57	979,417,745	15,589.21	968,277,185	0.41

## 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	3.27
		素材	4.56
		資本財	6.62
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	2.13
		自動車・自動車部品	1.96
		耐久消費財・アパレル	1.99
		消費者サービス	1.91
		メディア・娯楽	7.16
		小売	5.40
		食品・生活必需品小売り	1.36
		食品・飲料・タバコ	3.98
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	5.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.29
		銀行	6.46
		各種金融	4.71
		保険	3.18
		不動産	0.43
		ソフトウェア・サービス	11.35
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.42		
電気通信サービス	1.74		
公益事業	2.98		
半導体・半導体製造装置	4.42		
投資証券			2.22
合計			98.68

## 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	120	米ドル	24,607,625	2,700,932,920	25,214,400	2,767,532,544	1.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2106	買建	120	ユーロ	4,027,960	538,699,370	4,154,400	555,609,456	0.24



(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	13,700,000.00	1,495,669,180	1,503,304,240	0.64
	ユーロ	買建	3,100,000.00	410,136,660	414,844,200	0.18
	ユーロ	売建	380,000.00	50,908,600	50,821,846	0.02
	英ポンド	売建	200,000.00	31,204,200	31,119,860	0.01
	スイスフラン	売建	40,000.00	4,877,460	4,876,508	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	770,000.00	10,165,724	10,164,000	0.00
	デンマーククローネ	売建	430,000.00	7,735,700	7,731,529	0.00
	香港ドル	売建	1,850,000.00	26,160,850	26,159,000	0.01

(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 5月31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	35,256,861,565	75.34
地方債証券	日本	4,677,021,857	9.99
特殊債券	日本	4,896,283,485	10.46
社債券	日本	1,823,247,000	3.90
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		144,711,195	0.31
合計（純資産総額）		46,798,125,102	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	100.72	825,953,200	0.100	2029/12/20	1.76
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	740,000,000	100.88	746,569,200	100.65	744,869,200	0.100	2030/3/20	1.59
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	102.09	714,672,000	101.87	713,132,000	0.300	2025/12/20	1.52
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	690,000,000	101.07	697,448,300	101.01	697,031,100	0.100	2027/3/20	1.49

日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	680,000,000	101.14	687,795,400	101.05	687,187,600	0.100	2028/3/20	1.47
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	101.23	617,545,700	101.00	616,124,400	0.100	2026/12/20	1.32
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	101.21	597,178,000	101.05	596,206,800	0.100	2027/12/20	1.27
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	590,000,000	101.08	596,409,100	100.98	595,829,200	0.100	2028/9/20	1.27
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	550,000,000	100.91	555,009,000	100.54	552,975,500	0.100	2030/6/20	1.18
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	101.18	541,317,100	101.02	540,483,750	0.100	2028/6/20	1.15
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	102.44	501,995,200	102.07	500,157,700	0.500	2024/9/20	1.07
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	430,000,000	116.64	501,552,000	115.72	497,596,000	1.500	2033/3/20	1.06
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	102.46	430,336,200	102.24	429,445,800	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	117.55	420,846,900	1.700	2032/9/20	0.90
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	355,000,000	119.31	423,554,050	118.34	420,135,400	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	114.64	412,711,200	1.300	2035/6/20	0.88
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	405,491,170	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	102.00	397,815,600	0.400	2025/3/20	0.85
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	350,000,000	113.75	398,132,000	113.20	396,203,500	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	110.60	387,131,500	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	102.13	377,910,600	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	117.38	340,428,100	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	112.12	336,387,000	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	100.89	327,918,500	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	100.94	302,835,000	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	102.37	302,000,350	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	102.46	292,013,850	0.500	2038/3/20	0.62
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	114.24	285,600,000	112.70	281,767,500	2.300	2026/9/20	0.60
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	117.20	269,562,300	116.14	267,126,600	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	133.14	266,292,000	2.200	2041/3/20	0.57

## □.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.34
地方債証券	9.99
特殊債券	10.46
社債券	3.90

合 計	99.69
-----	-------

### 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 5月31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	69,213,162,893	43.82
	カナダ	3,266,015,894	2.07
	メキシコ	1,266,031,640	0.80
	ドイツ	11,887,911,581	7.53
	イタリア	14,994,778,016	9.49
	フランス	16,332,374,163	10.34
	オランダ	3,073,691,934	1.95
	スペイン	9,614,151,754	6.09
	ベルギー	3,820,963,705	2.42
	オーストリア	2,363,463,125	1.50
	フィンランド	970,039,008	0.61
	アイルランド	1,317,815,677	0.83
	イギリス	10,368,431,512	6.56
	スウェーデン	571,512,884	0.36
	ノルウェー	396,406,464	0.25
	デンマーク	804,709,446	0.51
	ポーランド	1,006,234,898	0.64
	オーストラリア	3,468,778,538	2.20
	シンガポール	676,709,183	0.43
	マレーシア	747,596,418	0.47
イスラエル	714,939,324	0.45	
	小計	156,875,718,057	99.31
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,089,706,375	0.69
合計（純資産総額）		157,965,424,432	100.00

### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		293,817,980	0.19

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,996.89	879,751,987	10,991.00	879,280,423	0.250	2023/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,971.46	877,717,195	10,979.85	878,388,645	0.125	2022/10/31	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	11,928.28	727,625,185	11,824.49	721,294,213	2.375	2026/4/30	0.46
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	25,304.83	768,001,846	23,073.76	700,288,646	4.500	2041/4/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,590,000	10,782.20	710,547,308	10,149.15	668,829,356	0.625	2030/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,308.71	644,596,471	11,207.09	638,804,432	1.875	2022/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,686.43	619,381,217	11,539.37	611,586,993	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	12,001.78	616,891,699	11,741.74	603,525,807	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,775.89	631,129,049	12,174.35	601,413,151	2.875	2028/5/15	0.38
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,955,000	22,409.47	662,199,969	20,192.68	596,693,943	2.500	2044/7/4	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	12,661.84	629,293,668	11,993.85	596,094,428	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,750,000	10,899.17	626,702,777	10,312.29	592,956,962	0.875	2030/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	15,391.20	604,874,176	14,961.26	587,977,771	4.250	2023/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,040,000	11,957.40	602,653,366	11,609.90	585,139,302	2.000	2026/11/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,735,000	22,939.32	627,390,657	21,392.62	585,088,224	4.750	2035/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,832.21	593,977,123	11,616.12	583,129,405	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	11,765.32	584,736,805	11,590.82	576,064,113	2.000	2025/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,388.08	582,240,119	12,086.24	568,053,639	3.000	2025/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,863.51	569,448,560	11,658.14	559,590,760	2.125	2025/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	13,064.44	589,206,281	12,382.51	558,451,382	3.125	2028/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,540,000	23,165.10	588,393,677	21,802.42	553,781,685	5.750	2032/10/25	0.35
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,692,000	23,005.95	619,320,303	20,566.27	553,644,196	2.500	2046/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,686.14	565,609,525	11,420.82	552,768,058	1.625	2026/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,945.12	547,256,478	10,976.00	548,800,000	0.250	2024/3/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,852.36	547,579,237	11,686.22	539,903,550	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,769.10	538,455,120	10,796.99	539,849,846	0.375	2026/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,595,000	15,899.01	571,569,453	14,911.51	536,069,114	1.250	2034/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,676.46	533,823,248	10,661.94	533,097,032	0.750	2028/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,745,000	20,275.73	556,568,869	19,352.28	531,220,223	5.500	2029/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,896.84	544,842,460	10,537.81	526,890,872	0.500	2027/10/31	0.33

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.31
合 計	99.31

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,650,000.00	289,945,000	290,861,605	0.18
	英ポンド	買建	19,000.00	2,958,330	2,956,375	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。

## 参考情報



## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	150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	59.89%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	20.16%
日本債券インデックスマザーファンド	4.97%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.02%
現金その他	4.97%

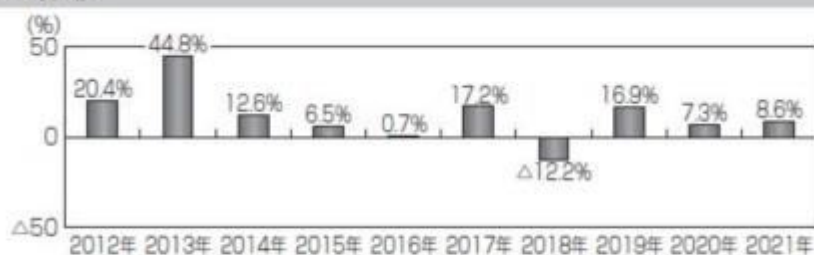
※当ファンドの対純資産総額比です。

### <組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.44%	
	2 ソニーグループ	電気機器	2.52%	
	3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.40%	
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	3.88%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.32%	
	3 AMAZON.COM INC	小売	2.56%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第357回利付国債(10年)	国債証券	2029/12/20	1.76%
	2 第358回利付国債(10年)	国債証券	2030/3/20	1.59%
	3 第341回利付国債(10年)	国債証券	2025/12/20	1.52%
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0.250%)	国債証券	2023/11/15	0.56%
	2 US TREASURY N/B (クーポン0.125%)	国債証券	2022/10/31	0.56%
	3 US TREASURY N/B (クーポン2.375%)	国債証券	2026/4/30	0.46%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2021年は、2021年5月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

#### (1) 申込方法

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

- (2) 申込みの受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (3) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (4) 申込金額  
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (5) 申込単位  
1円以上1円単位
- (6) 申込代金の支払い  
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

## 2【換金（解約）手続等】

### < 解約請求による換金 >

- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約制限  
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (5) 手取額  
1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。  
上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。  
税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。
- (6) 解約単位  
1口単位  
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。
- (7) 解約代金の支払い  
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消  
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむ

を得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

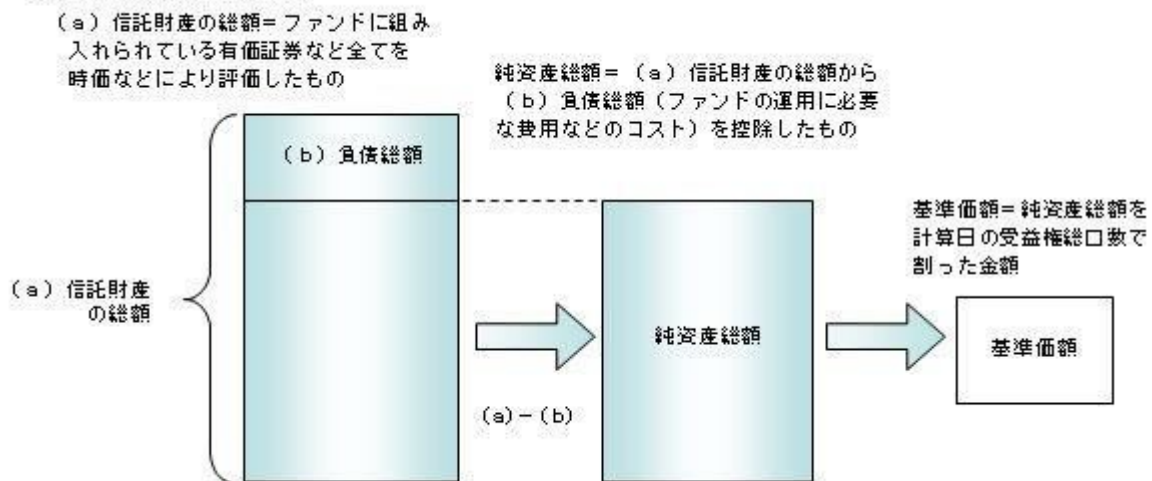
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債(国内・外国)

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

##### 基準価額の照会方法



販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2002年12月10日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年11月7日から翌年11月6日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合

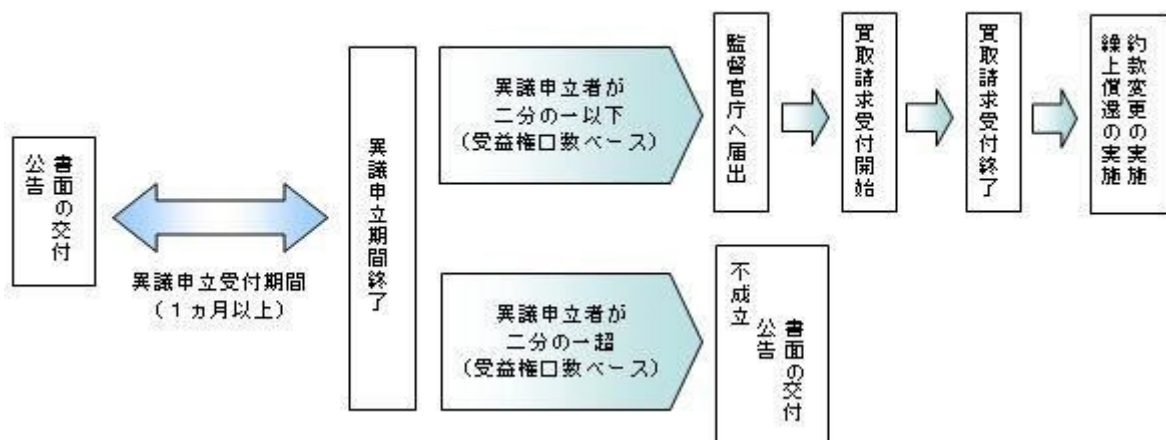
は、原則として公告を行いません。

- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

#### 異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

- 委託会社は、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、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

### (2) 解約請求権

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

( 3 ) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間（2019年11月7日から2020年11月6日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DCインデックスバランス(株式80)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 2019年11月 6日現在	第18期 2020年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	397,328,131	467,515,667
親投資信託受益証券	7,343,228,422	8,660,070,140
未収入金	-	1,832,434
流動資産合計	7,740,556,553	9,129,418,241
資産合計	7,740,556,553	9,129,418,241
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,984,466	3,441,370
未払解約金	9,039,546	13,133,860
未払受託者報酬	1,131,310	926,571
未払委託者報酬	6,411,103	5,559,760
未払利息	217	323
その他未払費用	150,790	185,270
流動負債合計	19,717,432	23,247,154
負債合計	19,717,432	23,247,154
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,984,466,013	3,441,370,706
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,736,373,108	5,664,800,381
(分配準備積立金)	1,097,770,906	1,190,466,326
元本等合計	7,720,839,121	9,106,171,087
純資産合計	7,720,839,121	9,106,171,087
負債純資産合計	7,740,556,553	9,129,418,241

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自 2018年11月 7日	至 2019年11月 6日	自 2019年11月 7日	至 2020年11月 6日
営業収益				
受取利息		199		-
有価証券売買等損益		420,342,350		261,132,345
営業収益合計		420,342,549		261,132,345
営業費用				
支払利息		135,141		116,715
受託者報酬		2,136,902		1,986,665
委託者報酬		12,109,788		11,700,741
その他費用		304,195		353,991
営業費用合計		14,686,026		14,158,112
営業利益又は営業損失（ ）		405,656,523		246,974,233
経常利益又は経常損失（ ）		405,656,523		246,974,233
当期純利益又は当期純損失（ ）		405,656,523		246,974,233
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（ ）		15,839,644		60,572,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,540,095,079		4,736,373,108
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,381,130,547		1,692,298,035
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		1,381,130,547		1,692,298,035
剰余金減少額又は欠損金増加額		603,364,219		1,067,975,827
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		603,364,219		1,067,975,827
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		2,984,466		3,441,370
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,736,373,108		5,664,800,381

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

		第17期 2019年11月 6日現在	第18期 2020年11月 6日現在
1.	期首元本額	2,425,310,720円	2,984,466,013円
	期中追加設定元本額	975,568,818円	1,136,417,948円
	期中一部解約元本額	416,413,525円	679,513,255円
2.	受益権の総数	2,984,466,013口	3,441,370,706口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第17期 自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日		第18期 自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	145,746,795円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 159,127,120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	28,533,121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 148,419,315円
C	信託約款に定める収益調整金	3,993,167,677円	C 信託約款に定める収益調整金 4,987,054,297円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	926,475,456円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 886,361,261円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	5,093,923,049円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D ) 6,180,961,993円
F	分配対象収益(1万口当たり)	17,068円	F 分配対象収益(1万口当たり) 17,960円
G	分配金額	2,984,466円	G 分配金額 3,441,370円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

	第17期 自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	第18期 自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	第17期 2019年11月 6日現在	第18期 2020年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第17期(2019年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

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



親投資信託受益証券	418,789,613
合計	418,789,613

第18期(2020年11月6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	277,040,294
合計	277,040,294

(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17期 2019年11月6日現在		第18期 2020年11月6日現在	
1口当たり純資産額	2.5870円	1口当たり純資産額	2.6461円
(1万口当たり純資産額)	(25,870円)	(1万口当たり純資産額)	(26,461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	647,750,426	1,845,635,288	
	日本債券インデックスマザーファンド	315,604,302	446,548,526	

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	363,175,635	887,891,792	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,476,712,685	5,479,994,534	
合計	4,803,243,048	8,660,070,140	

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

（参考）

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	96,981,135	99,769,328
株式	33,417,562,630	34,394,247,690
派生商品評価勘定	17,618,570	7,827,350
未収入金	1,747,820	52,158,410
未収配当金	319,496,862	297,955,110
流動資産合計	33,853,407,017	34,851,957,888
資産合計	33,853,407,017	34,851,957,888
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	20,140,000	5,230,000
未払解約金	33,457,645	52,611,923
未払利息	53	68
流動負債合計	53,597,698	57,841,991
負債合計	53,597,698	57,841,991
<b>純資産の部</b>		

元本等		
元本	21,517,048,675	22,074,085,898
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,282,760,644	12,720,029,999
元本等合計	33,799,809,319	34,794,115,897
純資産合計	33,799,809,319	34,794,115,897
負債純資産合計	33,853,407,017	34,851,957,888

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
1.	期首	2018年11月 7日	2019年11月 7日
	期首元本額	19,628,127,216円	21,517,048,675円
	期首からの追加設定元本額	3,688,070,856円	5,120,023,303円
	期首からの一部解約元本額	1,799,149,397円	4,562,986,080円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	573,098,014円	706,769,163円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,482,617,542円	1,801,534,543円
	DCインデックスバランス（株式60）	2,869,213,373円	3,409,693,795円
	DCインデックスバランス（株式80）	2,959,007,071円	3,476,712,685円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,363,512,596円	1,354,690,627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	3,585,817,766円	3,236,646,653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	49,485,768円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	42,485,478円	40,124,492円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	63,721,419円	59,041,463円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,225,049円	53,396,078円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,300,617,772円	3,753,508,024円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	283,866,304円	294,227,367円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	809,568,305円	804,213,731円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,180,262,868円	1,181,735,058円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,150,880,819円	1,117,792,381円
計	21,517,048,675円	22,074,085,898円
2. 受益権の総数	21,517,048,675口	22,074,085,898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	437,610,000円	370,645,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	903,790,303
合計	903,790,303

(2020年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	820,501,596
合計	820,501,596

(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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	338,740,000	-	356,370,000	17,630,000
合計		338,740,000	-	356,370,000	17,630,000

（2020年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	374,075,000	-	381,915,000	7,840,000
合計		374,075,000	-	381,915,000	7,840,000

## （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11月 6日現在		2020年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.5708円	1口当たり純資産額	1.5762円
(1万口当たり純資産額)	(15,708円)	(1万口当たり純資産額)	(15,762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	2,782.00	1,947,400	
日本水産	20,100	421.00	8,462,100	
マルハニチロ	2,900	2,219.00	6,435,100	
雪国まいたけ	1,300	2,003.00	2,603,900	
カネコ種苗	600	1,530.00	918,000	
サカタのタネ	2,400	3,665.00	8,796,000	
ホクト	1,500	2,142.00	3,213,000	
ホクリヨウ	300	678.00	203,400	
住石ホールディングス	4,200	126.00	529,200	
日鉄鉱業	500	5,060.00	2,530,000	
三井松島ホールディングス	800	706.00	564,800	
国際石油開発帝石	73,900	507.00	37,467,300	
石油資源開発	2,600	1,700.00	4,420,000	
K & O エナジーグループ	900	1,464.00	1,317,600	
ヒノキヤグループ	500	2,232.00	1,116,000	
ショーボンドホールディングス	3,100	5,270.00	16,337,000	
ミライト・ホールディングス	6,000	1,553.00	9,318,000	
サンヨーホームズ	200	677.00	135,400	
日本アクア	900	703.00	632,700	
ファーストコーポレーション	700	747.00	522,900	
ベステラ	400	1,413.00	565,200	
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	598.00	1,495,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	701.00	280,400	
第一カッター興業	300	2,226.00	667,800	
安藤・間	12,000	666.00	7,992,000	
東急建設	6,000	486.00	2,916,000	
コムシスホールディングス	7,100	2,826.00	20,064,600	

ピーアールホールディングス	2,300	770.00	1,771,000	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,195.00	2,853,500	
東建コーポレーション	600	8,010.00	4,806,000	
ソネック	300	863.00	258,900	
ヤマウラ	900	902.00	811,800	
大成建設	15,500	3,385.00	52,467,500	
大林組	46,500	904.00	42,036,000	
清水建設	47,200	757.00	35,730,400	
飛島建設	1,400	1,125.00	1,575,000	
長谷工コーポレーション	18,000	1,278.00	23,004,000	
松井建設	1,900	721.00	1,369,900	
銭高組	200	4,680.00	936,000	
鹿島建設	36,500	1,147.00	41,865,500	
不動テトラ	1,300	1,512.00	1,965,600	
大末建設	600	835.00	501,000	
鉄建建設	1,000	1,994.00	1,994,000	
西松建設	3,600	1,960.00	7,056,000	
三井住友建設	11,300	425.00	4,802,500	
大豊建設	1,100	3,435.00	3,778,500	
前田建設工業	11,700	783.00	9,161,100	
ナカノフドー建設	1,400	413.00	578,200	
奥村組	2,200	2,460.00	5,412,000	
東鉄工業	2,000	2,894.00	5,788,000	
イチケン	400	1,628.00	651,200	
富士ピー・エス	800	589.00	471,200	
浅沼組	500	4,200.00	2,100,000	
戸田建設	19,300	618.00	11,927,400	
熊谷組	2,200	2,477.00	5,449,400	
北野建設	300	2,541.00	762,300	
植木組	200	2,816.00	563,200	
矢作建設工業	2,100	932.00	1,957,200	
ピーエス三菱	1,600	575.00	920,000	
日本ハウスホールディングス	3,300	241.00	795,300	
大東建託	5,100	9,460.00	48,246,000	
新日本建設	2,100	961.00	2,018,100	
N I P P O	3,900	2,816.00	10,982,400	



東亜道路工業	300	3,775.00	1,132,500	
前田道路	4,100	1,816.00	7,445,600	
日本道路	500	8,070.00	4,035,000	
東亜建設工業	1,500	2,003.00	3,004,500	
日本国土開発	4,600	566.00	2,603,600	
若築建設	900	1,240.00	1,116,000	
東洋建設	5,300	408.00	2,162,400	
五洋建設	18,500	693.00	12,820,500	
福田組	500	5,210.00	2,605,000	
住友林業	11,800	1,700.00	20,060,000	
日本基礎技術	1,700	451.00	766,700	
巴コーポレーション	2,200	373.00	820,600	
大和ハウス工業	46,000	2,846.50	130,939,000	
ライト工業	2,700	1,573.00	4,247,100	
積水ハウス	50,400	1,789.00	90,165,600	
日特建設	1,300	804.00	1,045,200	
北陸電気工事	800	1,208.00	966,400	
ユアテック	2,800	657.00	1,839,600	
日本リーテック	1,000	2,384.00	2,384,000	
四電工	300	2,379.00	713,700	
中電工	1,900	2,135.00	4,056,500	
関電工	6,600	818.00	5,398,800	
きんでん	11,100	1,669.00	18,525,900	
東京エネシス	1,600	855.00	1,368,000	
トーエネック	500	3,570.00	1,785,000	
住友電設	1,300	2,765.00	3,594,500	
日本電設工業	2,600	2,162.00	5,621,200	
協和エクシオ	7,100	2,558.00	18,161,800	
新日本空調	1,300	2,210.00	2,873,000	
九電工	3,300	3,010.00	9,933,000	
三機工業	3,300	1,186.00	3,913,800	
日揮ホールディングス	14,300	877.00	12,541,100	
中外炉工業	500	1,501.00	750,500	
ヤマト	1,500	746.00	1,119,000	
太平電業	1,100	2,329.00	2,561,900	
高砂熱学工業	3,600	1,474.00	5,306,400	

三晃金属工業	200	2,664.00	532,800	
朝日工業社	300	2,927.00	878,100	
明星工業	3,100	872.00	2,703,200	
大気社	2,300	2,865.00	6,589,500	
ダイダン	1,100	2,727.00	2,999,700	
日比谷総合設備	1,500	1,764.00	2,646,000	
フィル・カンパニー	300	2,094.00	628,200	
OSJBホールディングス	7,600	250.00	1,900,000	
東洋エンジニアリング	2,100	315.00	661,500	
レイズネクスト	2,500	1,258.00	3,145,000	
日本製粉	4,400	1,731.00	7,616,400	
日清製粉グループ本社	16,800	1,644.00	27,619,200	
日東富士製粉	100	6,590.00	659,000	
昭和産業	1,400	3,280.00	4,592,000	
鳥越製粉	1,300	1,078.00	1,401,400	
中部飼料	1,800	1,482.00	2,667,600	
フィード・ワン	2,100	903.00	1,896,300	
東洋精糖	300	1,263.00	378,900	
日本甜菜製糖	800	1,794.00	1,435,200	
三井製糖	1,300	1,831.00	2,380,300	
塩水港精糖	1,700	230.00	391,000	
日新製糖	700	1,890.00	1,323,000	
森永製菓	3,500	4,120.00	14,420,000	
中村屋	400	4,150.00	1,660,000	
江崎グリコ	4,100	4,360.00	17,876,000	
名糖産業	700	1,490.00	1,043,000	
井村屋グループ	800	2,541.00	2,032,800	
不二家	1,000	2,395.00	2,395,000	
山崎製パン	11,100	1,739.00	19,302,900	
第一屋製パン	300	1,004.00	301,200	
モロゾフ	300	6,050.00	1,815,000	
亀田製菓	800	4,875.00	3,900,000	
寿スピリッツ	1,400	5,000.00	7,000,000	
カルビー	6,800	3,105.00	21,114,000	
森永乳業	2,800	5,290.00	14,812,000	
六甲バター	1,000	1,792.00	1,792,000	

ヤクルト本社	10,200	5,150.00	52,530,000	
明治ホールディングス	9,800	7,630.00	74,774,000	
雪印メグミルク	3,600	2,343.00	8,434,800	
プリマハム	2,300	3,020.00	6,946,000	
日本ハム	5,700	4,470.00	25,479,000	
林兼産業	500	583.00	291,500	
丸大食品	1,600	1,666.00	2,665,600	
S Foods	1,200	3,365.00	4,038,000	
柿安本店	500	2,577.00	1,288,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,600	723.00	6,940,800	
サッポロホールディングス	5,100	1,840.00	9,384,000	
アサヒグループホールディングス	32,500	3,616.00	117,520,000	
キリンホールディングス	63,100	1,985.00	125,253,500	
宝ホールディングス	11,000	1,124.00	12,364,000	
オエノンホールディングス	4,300	417.00	1,793,100	
養命酒製造	500	1,817.00	908,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,400	1,531.00	17,453,400	
サントリー食品インターナショナル	9,900	3,665.00	36,283,500	
ダイドーグループホールディングス	800	5,450.00	4,360,000	
伊藤園	4,500	7,080.00	31,860,000	
キーコーヒー	1,500	2,154.00	3,231,000	
ユニカフェ	500	1,065.00	532,500	
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	3,430.00	12,348,000	
J - オイルミルズ	800	3,740.00	2,992,000	
キッコーマン	10,700	6,030.00	64,521,000	
味の素	32,800	2,294.00	75,243,200	
キュービー	8,300	2,207.00	18,318,100	
ハウス食品グループ本社	5,600	3,630.00	20,328,000	
カゴメ	6,100	3,875.00	23,637,500	
焼津水産化学工業	700	1,000.00	700,000	
アリアケジャパン	1,400	7,140.00	9,996,000	
ピエトロ	200	1,698.00	339,600	
エバラ食品工業	400	2,325.00	930,000	

やまみ	100	2,241.00	224,100
ニチレイ	7,100	2,804.00	19,908,400
東洋水産	7,600	5,450.00	41,420,000
イトアンドホールディングス	500	1,886.00	943,000
大冷	200	2,134.00	426,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	869.00	695,200
日清食品ホールディングス	6,300	9,160.00	57,708,000
永谷園ホールディングス	700	2,360.00	1,652,000
一正蒲鉾	600	1,057.00	634,200
フジッコ	1,600	2,022.00	3,235,200
ロック・フィールド	1,600	1,492.00	2,387,200
日本たばこ産業	79,700	2,051.50	163,504,550
ケンコーマヨネーズ	800	1,840.00	1,472,000
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,473.00	1,473,000
なとり	900	2,069.00	1,862,100
イフジ産業	300	906.00	271,800
ピクルスコーポレーション	300	2,957.00	887,100
北の達人コーポレーション	5,200	489.00	2,542,800
ユーグレナ	6,400	871.00	5,574,400
ミヨシ油脂	500	1,191.00	595,500
理研ビタミン	1,400	1,571.00	2,199,400
片倉工業	2,000	1,215.00	2,430,000
ゲンゼ	1,100	3,830.00	4,213,000
東洋紡	5,700	1,406.00	8,014,200
ユニチカ	4,400	364.00	1,601,600
富士紡ホールディングス	700	3,600.00	2,520,000
倉敷紡績	1,500	1,867.00	2,800,500
シキボウ	800	949.00	759,200
日本毛織	4,800	1,070.00	5,136,000
ダイトウボウ	2,400	100.00	240,000
トーア紡コーポレーション	600	470.00	282,000
ダイドーリミテッド	2,000	199.00	398,000
帝国繊維	1,600	2,707.00	4,331,200
帝人	11,800	1,705.00	20,119,000
東レ	105,100	501.30	52,686,630
サカイオーベックス	400	2,000.00	800,000

住江織物	300	2,030.00	609,000	
日本フェルト	800	480.00	384,000	
イチカワ	200	1,309.00	261,800	
日東製網	200	1,455.00	291,000	
アツギ	1,200	535.00	642,000	
ダイニック	600	773.00	463,800	
セーレン	3,600	1,688.00	6,076,800	
ソトー	600	941.00	564,600	
東海染工	200	1,129.00	225,800	
小松マテーレ	2,400	905.00	2,172,000	
ワコールホールディングス	3,600	2,099.00	7,556,400	
ホギメディカル	1,600	3,200.00	5,120,000	
クラウドディアホールディングス	400	299.00	119,600	
T S Iホールディングス	4,400	237.00	1,042,800	
マツオカコーポレーション	400	2,385.00	954,000	
ワールド	2,100	1,425.00	2,992,500	
三陽商会	800	529.00	423,200	
ナイガイ	600	356.00	213,600	
オンワードホールディングス	8,800	207.00	1,821,600	
ルックホールディングス	500	996.00	498,000	
ゴールドウイン	2,600	7,450.00	19,370,000	
デサント	2,800	1,782.00	4,989,600	
キング	700	551.00	385,700	
ヤマトインターナショナル	1,300	327.00	425,100	
特種東海製紙	900	4,915.00	4,423,500	
王子ホールディングス	60,500	461.00	27,890,500	
日本製紙	6,400	1,225.00	7,840,000	
三菱製紙	1,600	326.00	521,600	
北越コーポレーション	8,600	369.00	3,173,400	
中越パルプ工業	600	1,313.00	787,800	
巴川製紙所	500	951.00	475,500	
大王製紙	7,000	1,621.00	11,347,000	
阿波製紙	400	421.00	168,400	
レンゴー	13,700	834.00	11,425,800	
トーモク	900	1,791.00	1,611,900	
ザ・バック	1,100	2,971.00	3,268,100	

クラレ	22,900	1,004.00	22,991,600	
旭化成	96,200	926.00	89,081,200	
共和レザー	800	627.00	501,600	
昭和電工	11,000	1,875.00	20,625,000	
住友化学	106,600	366.00	39,015,600	
住友精化	600	3,725.00	2,235,000	
日産化学	8,000	5,750.00	46,000,000	
ラサ工業	500	2,099.00	1,049,500	
クレハ	1,200	4,555.00	5,466,000	
多木化学	600	6,750.00	4,050,000	
テイカ	1,100	1,463.00	1,609,300	
石原産業	2,600	686.00	1,783,600	
片倉コープアグリ	400	1,226.00	490,400	
日本曹達	2,100	2,785.00	5,848,500	
東ソー	22,400	1,693.00	37,923,200	
トクヤマ	4,200	2,253.00	9,462,600	
セントラル硝子	2,900	2,246.00	6,513,400	
東亜合成	9,100	1,110.00	10,101,000	
大阪ソーダ	1,500	2,569.00	3,853,500	
関東電化工業	3,500	719.00	2,516,500	
デンカ	5,300	3,245.00	17,198,500	
信越化学工業	24,900	14,640.00	364,536,000	
日本カーバイド工業	500	1,223.00	611,500	
堺化学工業	1,000	2,006.00	2,006,000	
第一稀元素化学工業	1,600	720.00	1,152,000	
エア・ウォーター	13,500	1,558.00	21,033,000	
日本酸素ホールディングス	14,000	1,616.00	22,624,000	
日本化学工業	500	2,536.00	1,268,000	
東邦アセチレン	200	1,248.00	249,600	
日本パーカライジング	7,300	1,064.00	7,767,200	
高压ガス工業	2,300	829.00	1,906,700	
四国化成工業	2,100	1,183.00	2,484,300	
戸田工業	300	2,036.00	610,800	
ステラ ケミファ	800	3,155.00	2,524,000	
保土谷化学工業	500	4,530.00	2,265,000	
日本触媒	2,200	5,230.00	11,506,000	

大日精化工業	1,300	2,162.00	2,810,600	
カネカ	3,700	3,045.00	11,266,500	
三菱瓦斯化学	13,500	1,881.00	25,393,500	
三井化学	13,500	2,778.00	37,503,000	
J S R	13,500	2,487.00	33,574,500	
東京応化工業	2,500	6,130.00	15,325,000	
大阪有機化学工業	1,300	2,736.00	3,556,800	
三菱ケミカルホールディングス	97,000	568.30	55,125,100	
K Hネオケム	2,400	2,573.00	6,175,200	
ダイセル	18,200	781.00	14,214,200	
住友ベークライト	2,300	2,992.00	6,881,600	
積水化学工業	30,700	1,673.00	51,361,100	
日本ゼオン	13,100	1,288.00	16,872,800	
アイカ工業	4,400	3,800.00	16,720,000	
宇部興産	7,300	1,762.00	12,862,600	
積水樹脂	2,600	2,284.00	5,938,400	
タキロンシーアイ	3,200	678.00	2,169,600	
旭有機材	800	1,473.00	1,178,400	
ニチバン	800	1,661.00	1,328,800	
リケンテクノス	3,500	436.00	1,526,000	
大倉工業	700	1,908.00	1,335,600	
積水化成成品工業	2,000	589.00	1,178,000	
群栄化学工業	300	2,551.00	765,300	
タイガースポリマー	800	437.00	349,600	
ミライアル	500	1,247.00	623,500	
ダイキアクシス	600	871.00	522,600	
ダイキョーニシカワ	3,100	641.00	1,987,100	
竹本容器	600	929.00	557,400	
森六ホールディングス	800	2,010.00	1,608,000	
日本化薬	9,000	929.00	8,361,000	
カーリットホールディングス	1,600	553.00	884,800	
日本精化	1,200	1,549.00	1,858,800	
扶桑化学工業	1,500	3,350.00	5,025,000	
トリケミカル研究所	300	12,890.00	3,867,000	
A D E K A	6,700	1,463.00	9,802,100	
日油	5,500	4,180.00	22,990,000	

新日本理化	2,400	163.00	391,200	
ハリマ化成グループ	1,200	1,000.00	1,200,000	
花王	35,500	7,644.00	271,362,000	
第一工業製薬	500	4,315.00	2,157,500	
石原ケミカル	400	2,126.00	850,400	
日華化学	500	932.00	466,000	
ニイタカ	300	3,220.00	966,000	
三洋化成工業	900	4,510.00	4,059,000	
有機合成薬品工業	1,100	311.00	342,100	
大日本塗料	1,700	1,011.00	1,718,700	
日本ペイントホールディングス	12,000	10,180.00	122,160,000	
関西ペイント	16,300	2,836.00	46,226,800	
神東塗料	1,200	174.00	208,800	
中国塗料	4,100	1,009.00	4,136,900	
日本特殊塗料	1,100	946.00	1,040,600	
藤倉化成	2,000	509.00	1,018,000	
太陽ホールディングス	1,100	5,660.00	6,226,000	
D I C	6,100	2,574.00	15,701,400	
サカタインクス	3,200	1,133.00	3,625,600	
東洋インキ S C ホールディングス	3,100	1,963.00	6,085,300	
T & K T O K A	1,100	871.00	958,100	
富士フイルムホールディングス	28,400	5,468.00	155,291,200	
資生堂	29,400	6,941.00	204,065,400	
ライオン	19,300	2,425.00	46,802,500	
高砂香料工業	900	2,138.00	1,924,200	
マンダム	3,300	1,638.00	5,405,400	
ミルボン	2,000	5,570.00	11,140,000	
ファンケル	6,000	3,620.00	21,720,000	
コーセー	2,800	15,150.00	42,420,000	
コタ	900	1,352.00	1,216,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,300	2,055.00	12,946,500	
ノエビアホールディングス	1,200	4,700.00	5,640,000	
アジュバンコスメジャパン	300	1,014.00	304,200	
エステー	1,000	2,000.00	2,000,000	
アグロ カネショウ	600	1,661.00	996,600	
コニシ	2,500	1,555.00	3,887,500	



長谷川香料	2,500	2,156.00	5,390,000	
星光P M C	900	660.00	594,000	
小林製薬	4,200	10,830.00	45,486,000	
荒川化学工業	1,400	1,132.00	1,584,800	
メック	1,000	2,212.00	2,212,000	
日本高純度化学	400	2,694.00	1,077,600	
タカラバイオ	3,900	2,913.00	11,360,700	
J C U	1,800	3,370.00	6,066,000	
新田ゼラチン	1,000	701.00	701,000	
O A T アグリオ	300	1,294.00	388,200	
デクセリアルズ	3,800	1,148.00	4,362,400	
アース製薬	1,100	6,740.00	7,414,000	
北興化学工業	1,400	1,120.00	1,568,000	
大成ラミック	500	2,793.00	1,396,500	
クミアイ化学工業	6,100	1,034.00	6,307,400	
日本農薬	2,700	502.00	1,355,400	
アキレス	1,000	1,575.00	1,575,000	
有沢製作所	2,400	954.00	2,289,600	
日東電工	10,200	7,550.00	77,010,000	
レック	1,600	1,498.00	2,396,800	
三光合成	1,800	294.00	529,200	
きもと	2,500	177.00	442,500	
藤森工業	1,300	4,370.00	5,681,000	
前澤化成工業	900	996.00	896,400	
未来工業	800	1,944.00	1,555,200	
ウェーブロックホールディングス	500	706.00	353,000	
J S P	900	1,523.00	1,370,700	
エフピコ	3,100	4,360.00	13,516,000	
天馬	1,000	1,892.00	1,892,000	
信越ポリマー	2,700	937.00	2,529,900	
東リ	3,700	259.00	958,300	
ニフコ	5,400	3,215.00	17,361,000	
バルカー	1,200	1,849.00	2,218,800	
ユニ・チャーム	31,400	5,202.00	163,342,800	
ショーエイコーポレーション	200	1,172.00	234,400	
協和キリン	14,900	2,825.00	42,092,500	

武田薬品工業	123,300	3,463.00	426,987,900	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	128,500	1,565.50	201,166,750	
大日本住友製薬	11,000	1,336.00	14,696,000	
塩野義製薬	18,600	5,553.00	103,285,800	
わかもと製薬	1,900	260.00	494,000	
あすか製薬	1,700	1,561.00	2,653,700	
日本新薬	3,900	7,920.00	30,888,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,432.00	729,600	
中外製薬	46,400	4,429.00	205,505,600	
科研製薬	2,500	4,195.00	10,487,500	
エーザイ	17,700	10,240.00	181,248,000	
ロート製薬	7,600	3,500.00	26,600,000	
小野薬品工業	34,100	3,211.00	109,495,100	
久光製薬	3,900	5,410.00	21,099,000	
持田製薬	2,100	4,130.00	8,673,000	
参天製薬	27,600	2,034.00	56,138,400	
扶桑薬品工業	500	2,909.00	1,454,500	
日本ケミファ	200	2,459.00	491,800	
ツムラ	4,600	3,365.00	15,479,000	
日医工	4,200	1,103.00	4,632,600	
キッセイ薬品工業	2,600	2,127.00	5,530,200	
生化学工業	2,900	1,031.00	2,989,900	
栄研化学	2,600	2,033.00	5,285,800	
日水製薬	700	1,002.00	701,400	
鳥居薬品	900	3,095.00	2,785,500	
JCRファーマ	4,200	2,923.00	12,276,600	
東和薬品	1,900	2,052.00	3,898,800	
富士製薬工業	1,000	1,270.00	1,270,000	
沢井製薬	3,000	5,300.00	15,900,000	
ゼリア新薬工業	2,700	1,910.00	5,157,000	
第一三共	127,200	3,185.00	405,132,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	1,961.00	6,471,300	
大幸薬品	1,800	1,975.00	3,555,000	
ダイト	900	4,105.00	3,694,500	
大塚ホールディングス	30,800	4,182.00	128,805,600	

大正製薬ホールディングス	3,100	6,470.00	20,057,000
ペプチドリーム	7,500	5,020.00	37,650,000
日本コークス工業	12,700	73.00	927,100
ニチレキ	1,800	1,728.00	3,110,400
ユシロ化学工業	800	1,326.00	1,060,800
ピーピー・カストロール	500	1,252.00	626,000
富士石油	3,900	188.00	733,200
MORESCO	500	1,019.00	509,500
出光興産	16,400	2,155.00	35,342,000
E N E O Sホールディングス	222,900	363.30	80,979,570
コスモエネルギーホールディングス	4,300	1,586.00	6,819,800
横浜ゴム	8,600	1,506.00	12,951,600
TOYO TIRE	7,800	1,593.00	12,425,400
ブリヂストン	39,400	3,493.00	137,624,200
住友ゴム工業	13,300	958.00	12,741,400
藤倉コンポジット	1,300	350.00	455,000
オカモト	900	4,360.00	3,924,000
フコク	600	712.00	427,200
ニッタ	1,700	2,273.00	3,864,100
住友理工	2,800	536.00	1,500,800
三ツ星ベルト	2,000	1,745.00	3,490,000
バンドー化学	2,600	602.00	1,565,200
日東紡績	2,200	4,165.00	9,163,000
A G C	13,600	3,290.00	44,744,000
日本板硝子	7,100	419.00	2,974,900
石塚硝子	300	1,926.00	577,800
日本山村硝子	600	848.00	508,800
日本電気硝子	5,500	2,148.00	11,814,000
オハラ	600	1,261.00	756,600
住友大阪セメント	2,800	3,250.00	9,100,000
太平洋セメント	9,300	2,519.00	23,426,700
日本ヒューム	1,500	804.00	1,206,000
日本コンクリート工業	3,200	318.00	1,017,600
三谷セキサン	700	4,955.00	3,468,500
アジアパイルホールディングス	2,100	474.00	995,400
東海カーボン	14,500	1,168.00	16,936,000

日本カーボン	800	3,750.00	3,000,000
東洋炭素	900	1,808.00	1,627,200
ノリタケカンパニーリミテド	800	3,065.00	2,452,000
TOTO	10,600	5,230.00	55,438,000
日本碍子	17,800	1,552.00	27,625,600
日本特殊陶業	11,300	1,840.00	20,792,000
ダントーホールディングス	1,000	557.00	557,000
MARUWA	600	10,740.00	6,444,000
品川リフラクトリーズ	400	2,221.00	888,400
黒崎播磨	300	2,935.00	880,500
ヨータイ	1,200	799.00	958,800
イソライト工業	800	470.00	376,000
東京窯業	1,900	341.00	647,900
ニッカトー	700	706.00	494,200
フジインコーポレーテッド	1,300	3,550.00	4,615,000
クニミネ工業	600	1,100.00	660,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,086.00	217,200
ニチアス	4,000	2,328.00	9,312,000
ニチハ	2,000	3,175.00	6,350,000
日本製鉄	65,600	1,101.00	72,225,600
神戸製鋼所	26,900	461.00	12,400,900
合同製鐵	800	1,913.00	1,530,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	39,600	801.00	31,719,600
東京製鐵	7,200	701.00	5,047,200
共英製鋼	1,700	1,388.00	2,359,600
大和工業	3,100	2,559.00	7,932,900
東京鐵鋼	600	2,041.00	1,224,600
大阪製鐵	800	1,154.00	923,200
淀川製鋼所	2,000	1,994.00	3,988,000
丸一鋼管	4,800	2,447.00	11,745,600
モリ工業	500	2,517.00	1,258,500
大同特殊鋼	2,400	3,695.00	8,868,000
日本高周波鋼業	600	342.00	205,200
日本冶金工業	1,200	1,519.00	1,822,800
山陽特殊製鋼	1,000	1,059.00	1,059,000
愛知製鋼	800	2,630.00	2,104,000

日立金属	15,800	1,393.00	22,009,400	
日本金属	400	640.00	256,000	
大太平洋金属	1,000	1,623.00	1,623,000	
新日本電工	9,700	251.00	2,434,700	
栗本鐵工所	700	1,889.00	1,322,300	
虹技	200	1,231.00	246,200	
日本鑄鉄管	200	1,314.00	262,800	
三菱製鋼	1,200	526.00	631,200	
日亜鋼業	2,300	306.00	703,800	
日本精線	200	3,435.00	687,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	538.00	376,600	
シンニッタン	2,600	198.00	514,800	
新家工業	400	1,156.00	462,400	
大紀アルミニウム工業所	2,500	661.00	1,652,500	
日本軽金属ホールディングス	3,700	1,724.00	6,378,800	
三井金属鉱業	3,900	2,736.00	10,670,400	
東邦亜鉛	800	2,099.00	1,679,200	
三菱マテリアル	9,700	1,934.00	18,759,800	
住友金属鉱山	18,700	3,458.00	64,664,600	
D O W Aホールディングス	3,700	3,175.00	11,747,500	
古河機械金属	2,600	1,140.00	2,964,000	
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	800.00	1,280,000	
東邦チタニウム	2,700	663.00	1,790,100	
U A C J	2,200	1,637.00	3,601,400	
C Kサンエツ	300	3,735.00	1,120,500	
古河電気工業	4,500	2,458.00	11,061,000	
住友電気工業	54,900	1,194.50	65,578,050	
フジクラ	17,700	382.00	6,761,400	
昭和電線ホールディングス	1,700	1,360.00	2,312,000	
タツタ電線	3,000	579.00	1,737,000	
カナレ電気	300	1,744.00	523,200	
平河ヒューテック	800	1,065.00	852,000	
リョービ	1,800	1,165.00	2,097,000	
アーレスティ	2,000	320.00	640,000	
アサヒホールディングス	2,600	3,735.00	9,711,000	

稲葉製作所	800	1,376.00	1,100,800
宮地エンジニアリンググループ	500	1,919.00	959,500
トーカロ	4,100	1,096.00	4,493,600
アルファC o	600	980.00	588,000
SUMCO	18,800	1,623.00	30,512,400
川田テクノロジーズ	300	4,385.00	1,315,500
RS Technologies	500	3,620.00	1,810,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,955.00	395,500
信和	900	720.00	648,000
東洋製罐グループホールディングス	9,300	1,016.00	9,448,800
ホッカンホールディングス	800	1,445.00	1,156,000
コロナ	800	987.00	789,600
横河ブリッジホールディングス	2,700	1,922.00	5,189,400
駒井ハルテック	300	1,505.00	451,500
高田機工	100	2,498.00	249,800
三和ホールディングス	13,800	1,260.00	17,388,000
文化シャッター	4,300	922.00	3,964,600
三協立山	1,900	922.00	1,751,800
アルインコ	1,100	910.00	1,001,000
東洋シャッター	300	738.00	221,400
LIXILグループ	21,600	2,322.00	50,155,200
日本フィルコン	1,000	545.00	545,000
ノーリツ	3,000	1,657.00	4,971,000
長府製作所	1,500	2,115.00	3,172,500
リンナイ	2,800	11,120.00	31,136,000
ダイニチ工業	800	790.00	632,000
日東精工	1,800	468.00	842,400
三洋工業	200	1,944.00	388,800
岡部	3,000	817.00	2,451,000
ジーテクト	1,800	1,322.00	2,379,600
東プレ	2,700	1,046.00	2,824,200
高周波熱錬	2,800	507.00	1,419,600
東京製綱	1,100	499.00	548,900
サンコール	1,200	423.00	507,600
モリテック スチール	1,200	303.00	363,600
パイオラックス	2,200	1,555.00	3,421,000

エイチワン	1,500	610.00	915,000	
日本発條	15,700	626.00	9,828,200	
中央発條	200	2,988.00	597,600	
アドバネクス	200	1,228.00	245,600	
立川ブラインド工業	700	1,277.00	893,900	
三益半導体工業	1,100	2,571.00	2,828,100	
日本ドライケミカル	400	1,509.00	603,600	
日本製鋼所	4,400	2,358.00	10,375,200	
三浦工業	6,300	5,400.00	34,020,000	
タクマ	4,900	1,666.00	8,163,400	
ツガミ	3,000	1,480.00	4,440,000	
オークマ	1,700	5,380.00	9,146,000	
芝浦機械	1,600	2,158.00	3,452,800	
アマダ	18,100	937.00	16,959,700	
アイダエンジニアリング	3,800	838.00	3,184,400	
滝澤鉄工所	400	980.00	392,000	
F U J I	6,300	2,224.00	14,011,200	
牧野フライス製作所	1,700	3,835.00	6,519,500	
オーエスジー	7,200	1,595.00	11,484,000	
ダイジェット工業	200	1,412.00	282,400	
旭ダイヤモンド工業	3,900	483.00	1,883,700	
D M G 森精機	9,200	1,513.00	13,919,600	
ソディック	3,200	800.00	2,560,000	
ディスコ	2,000	28,810.00	57,620,000	
日東工器	800	1,707.00	1,365,600	
日進工具	600	2,252.00	1,351,200	
パンチ工業	1,300	484.00	629,200	
富士ダイス	700	643.00	450,100	
豊和工業	800	815.00	652,000	
O K K	400	358.00	143,200	
東洋機械金属	1,100	406.00	446,600	
津田駒工業	300	904.00	271,200	
島精機製作所	2,300	1,611.00	3,705,300	
オプトラン	1,800	2,165.00	3,897,000	
N C ホールディングス	400	611.00	244,400	
イワキポンプ	900	821.00	738,900	

フリー	1,400	1,208.00	1,691,200	
ヤマシンフィルタ	3,100	1,059.00	3,282,900	
日阪製作所	1,800	907.00	1,632,600	
やまびこ	2,800	1,330.00	3,724,000	
平田機工	700	6,610.00	4,627,000	
ペガサスミシン製造	1,500	286.00	429,000	
マルマエ	500	906.00	453,000	
タツモ	600	1,688.00	1,012,800	
ナブテスコ	8,600	4,000.00	34,400,000	
三井海洋開発	1,600	1,594.00	2,550,400	
レオン自動機	1,400	1,040.00	1,456,000	
S M C	4,700	58,770.00	276,219,000	
ホソカワミクロン	500	5,410.00	2,705,000	
ユニオンツール	600	3,115.00	1,869,000	
オイレス工業	1,900	1,565.00	2,973,500	
日精エー・エス・ピー機械	400	4,165.00	1,666,000	
サトーホールディングス	2,100	2,057.00	4,319,700	
技研製作所	1,300	3,845.00	4,998,500	
日本エアテック	500	1,799.00	899,500	
カワタ	400	801.00	320,400	
日精樹脂工業	1,200	911.00	1,093,200	
オカダアイヨン	400	1,007.00	402,800	
ワイエイシイホールディングス	600	652.00	391,200	
小松製作所	67,100	2,427.00	162,851,700	
住友重機械工業	8,500	2,372.00	20,162,000	
日立建機	5,900	2,690.00	15,871,000	
日工	1,900	681.00	1,293,900	
巴工業	600	1,959.00	1,175,400	
井関農機	1,500	1,461.00	2,191,500	
T O W A	1,500	1,285.00	1,927,500	
丸山製作所	300	1,325.00	397,500	
北川鉄工所	700	1,362.00	953,400	
ローツェ	600	4,915.00	2,949,000	
タカキタ	500	699.00	349,500	
クボタ	78,600	2,018.50	158,654,100	
荏原実業	400	3,585.00	1,434,000	



三菱化工機	500	2,020.00	1,010,000	
月島機械	2,700	1,251.00	3,377,700	
帝国電機製作所	1,200	1,153.00	1,383,600	
新東工業	3,600	726.00	2,613,600	
澁谷工業	1,300	3,415.00	4,439,500	
アイチ コーポレーション	2,600	941.00	2,446,600	
小森コーポレーション	3,800	693.00	2,633,400	
鶴見製作所	1,100	1,783.00	1,961,300	
住友精密工業	200	1,921.00	384,200	
酒井重工業	300	2,371.00	711,300	
荏原製作所	6,100	2,885.00	17,598,500	
石井鐵工所	200	2,764.00	552,800	
西島製作所	1,500	804.00	1,206,000	
北越工業	1,500	1,067.00	1,600,500	
ダイキン工業	18,900	22,285.00	421,186,500	
オルガノ	500	5,550.00	2,775,000	
トーヨーカネツ	600	2,197.00	1,318,200	
栗田工業	8,000	3,345.00	26,760,000	
椿本チエイン	2,100	2,529.00	5,310,900	
大同工業	700	632.00	442,400	
木村化工機	1,200	454.00	544,800	
アネスト岩田	2,300	894.00	2,056,200	
ダイフク	7,600	11,880.00	90,288,000	
サムコ	400	2,725.00	1,090,000	
加藤製作所	800	1,049.00	839,200	
油研工業	300	1,479.00	443,700	
タダノ	7,100	757.00	5,374,700	
フジテック	5,400	2,254.00	12,171,600	
C K D	4,000	1,834.00	7,336,000	
キトー	1,100	1,441.00	1,585,100	
平和	4,100	1,714.00	7,027,400	
理想科学工業	1,300	1,243.00	1,615,900	
S A N K Y O	3,300	2,748.00	9,068,400	
日本金銭機械	1,700	531.00	902,700	
マースグループホールディングス	900	1,652.00	1,486,800	
フクシマガリレイ	900	3,950.00	3,555,000	

オーイズミ	600	375.00	225,000	
ダイコク電機	700	969.00	678,300	
竹内製作所	2,500	2,359.00	5,897,500	
アマノ	3,900	2,521.00	9,831,900	
J U K I	2,100	453.00	951,300	
サンデンホールディングス	1,800	352.00	633,600	
蛇の目マシン工業	1,300	592.00	769,600	
マックス	2,200	1,484.00	3,264,800	
グローリー	3,800	2,260.00	8,588,000	
新晃工業	1,400	1,569.00	2,196,600	
大和冷機工業	2,400	969.00	2,325,600	
セガサミーホールディングス	14,600	1,430.00	20,878,000	
日本ピストンリング	500	1,012.00	506,000	
リケン	700	2,547.00	1,782,900	
T P R	2,000	1,308.00	2,616,000	
ツバキ・ナカシマ	2,800	818.00	2,290,400	
ホシザキ	4,700	9,180.00	43,146,000	
大豊工業	1,200	586.00	703,200	
日本精工	27,800	858.00	23,852,400	
N T N	34,200	210.00	7,182,000	
ジェイテクト	14,200	864.00	12,268,800	
不二越	1,400	4,260.00	5,964,000	
日本トムソン	4,400	365.00	1,606,000	
T H K	9,200	2,872.00	26,422,400	
ユーシン精機	1,100	727.00	799,700	
前澤給装工業	500	2,201.00	1,100,500	
イーグル工業	1,900	877.00	1,666,300	
前澤工業	1,000	489.00	489,000	
日本ピラー工業	1,500	1,536.00	2,304,000	
キッツ	6,000	576.00	3,456,000	
マキタ	19,300	5,140.00	99,202,000	
日立造船	11,600	424.00	4,918,400	
三菱重工業	24,800	2,297.00	56,965,600	
I H I	10,600	1,340.00	14,204,000	
スター精密	2,300	1,445.00	3,323,500	
日清紡ホールディングス	9,100	720.00	6,552,000	

イビデン	9,100	4,350.00	39,585,000
コニカミノルタ	32,600	279.00	9,095,400
ブラザー工業	18,100	1,653.00	29,919,300
ミネベアミツミ	27,500	2,030.00	55,825,000
日立製作所	71,200	3,564.00	253,756,800
三菱電機	148,200	1,346.50	199,551,300
富士電機	8,900	3,410.00	30,349,000
東洋電機製造	600	1,128.00	676,800
安川電機	16,000	4,210.00	67,360,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,224.00	2,448,000
明電舎	2,700	1,681.00	4,538,700
オリジン	400	1,370.00	548,000
山洋電気	700	4,785.00	3,349,500
デンヨー	1,300	2,419.00	3,144,700
東芝テック	1,900	4,210.00	7,999,000
芝浦メカトロニクス	300	3,500.00	1,050,000
マブチモーター	4,100	4,380.00	17,958,000
日本電産	35,700	11,120.00	396,984,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	288.00	288,000
トレックス・セミコンダクター	900	1,379.00	1,241,100
東光高岳	800	1,127.00	901,600
ダイヘン	1,600	4,225.00	6,760,000
ヤーマン	2,400	1,647.00	3,952,800
JVCケンウッド	12,700	153.00	1,943,100
ミマキエンジニアリング	1,500	450.00	675,000
I - P E X	700	1,936.00	1,355,200
日新電機	3,500	1,121.00	3,923,500
大崎電気工業	3,100	570.00	1,767,000
オムロン	13,300	7,820.00	104,006,000
日東工業	2,200	2,027.00	4,459,400
I D E C	2,200	1,849.00	4,067,800
正興電機製作所	400	1,588.00	635,200
不二電機工業	300	1,303.00	390,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,000	1,861.00	9,305,000
サクサホールディングス	400	1,422.00	568,800
メルコホールディングス	500	2,916.00	1,458,000

テクノメディカ	400	1,595.00	638,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	796.00	318,400
日本電気	18,000	5,630.00	101,340,000
富士通	14,300	13,300.00	190,190,000
沖電気工業	6,000	964.00	5,784,000
岩崎通信機	700	854.00	597,800
電気興業	700	2,665.00	1,865,500
サンケン電気	1,600	3,395.00	5,432,000
ナカヨ	300	1,475.00	442,500
アイホン	800	1,517.00	1,213,600
ルネサスエレクトロニクス	63,400	911.00	57,757,400
セイコーエプソン	18,400	1,279.00	23,533,600
ワコム	10,000	755.00	7,550,000
アルバック	2,700	3,990.00	10,773,000
アクセル	700	905.00	633,500
E I Z O	1,200	3,670.00	4,404,000
日本信号	3,800	928.00	3,526,400
京三製作所	3,500	430.00	1,505,000
能美防災	2,000	2,422.00	4,844,000
ホーチキ	1,100	1,305.00	1,435,500
星和電機	800	625.00	500,000
エレコム	1,700	5,100.00	8,670,000
パナソニック	169,300	1,005.00	170,146,500
シャープ	17,200	1,300.00	22,360,000
アンリツ	9,500	2,315.00	21,992,500
富士通ゼネラル	4,000	3,200.00	12,800,000
ソニー	92,800	9,145.00	848,656,000
T D K	7,200	12,940.00	93,168,000
帝国通信工業	700	1,164.00	814,800
タムラ製作所	5,100	516.00	2,631,600
アルプスアルパイン	13,100	1,439.00	18,850,900
池上通信機	500	811.00	405,500
鈴木	800	691.00	552,800
日本トリム	200	3,765.00	753,000
ローランド ディー . ジー .	900	1,283.00	1,154,700

フォスター電機	1,600	1,204.00	1,926,400	
S M K	400	2,826.00	1,130,400	
ヨコオ	1,000	2,719.00	2,719,000	
ホシデン	4,100	960.00	3,936,000	
ヒロセ電機	2,300	14,230.00	32,729,000	
日本航空電子工業	3,400	1,489.00	5,062,600	
T O A	1,600	876.00	1,401,600	
マクセルホールディングス	3,200	1,113.00	3,561,600	
古野電気	2,000	1,206.00	2,412,000	
ユニデンホールディングス	400	2,015.00	806,000	
スミダコーポレーション	1,300	1,016.00	1,320,800	
アイコム	800	2,884.00	2,307,200	
リオン	600	2,540.00	1,524,000	
本多通信工業	1,300	470.00	611,000	
船井電機	1,500	440.00	660,000	
横河電機	13,600	1,676.00	22,793,600	
新電元工業	500	2,277.00	1,138,500	
アズビル	9,400	4,400.00	41,360,000	
東亜ディーケーケー	800	848.00	678,400	
日本光電工業	6,100	3,410.00	20,801,000	
チノー	500	1,382.00	691,000	
共和電業	1,600	435.00	696,000	
日本電子材料	600	1,826.00	1,095,600	
堀場製作所	2,900	5,410.00	15,689,000	
アドバンテスト	11,000	6,370.00	70,070,000	
小野測器	700	515.00	360,500	
エスベック	1,300	1,748.00	2,272,400	
キーエンス	13,400	51,010.00	683,534,000	
日置電機	700	3,900.00	2,730,000	
シスメックス	10,600	10,355.00	109,763,000	
日本マイクロニクス	2,600	1,079.00	2,805,400	
メガチップス	1,400	2,823.00	3,952,200	
O B A R A G R O U P	900	3,770.00	3,393,000	
澤藤電機	200	1,861.00	372,200	
原田工業	700	888.00	621,600	
コーセル	2,000	1,027.00	2,054,000	

イリソ電子工業	1,300	4,340.00	5,642,000
オブテックスグループ	2,500	1,654.00	4,135,000
千代田インテグレ	600	1,652.00	991,200
アイ・オー・データ機器	500	1,057.00	528,500
レーザーテック	6,500	9,510.00	61,815,000
スタンレー電気	10,400	3,000.00	31,200,000
岩崎電気	600	1,352.00	811,200
ウシオ電機	8,200	1,242.00	10,184,400
岡谷電機産業	1,300	345.00	448,500
ハリオス テクノ ホールディング	1,500	310.00	465,000
エノモト	500	1,105.00	552,500
日本セラミック	1,500	2,680.00	4,020,000
遠藤照明	800	572.00	457,600
古河電池	1,100	1,102.00	1,212,200
双信電機	800	407.00	325,600
山一電機	1,100	1,408.00	1,548,800
図研	1,000	2,880.00	2,880,000
日本電子	2,900	3,495.00	10,135,500
カシオ計算機	13,100	1,695.00	22,204,500
ファナック	13,900	22,715.00	315,738,500
日本シイエムケイ	3,700	435.00	1,609,500
エンプラス	800	2,220.00	1,776,000
大真空	600	2,200.00	1,320,000
ローム	6,200	8,240.00	51,088,000
浜松ホトニクス	10,600	5,720.00	60,632,000
三井ハイテック	1,700	2,211.00	3,758,700
新光電気工業	5,000	1,854.00	9,270,000
京セラ	20,900	5,810.00	121,429,000
太陽誘電	6,600	3,885.00	25,641,000
村田製作所	43,500	7,475.00	325,162,500
双葉電子工業	2,400	898.00	2,155,200
北陸電気工業	600	946.00	567,600
ニチコン	5,100	891.00	4,544,100
日本ケミコン	1,200	1,512.00	1,814,400
K O A	2,300	1,292.00	2,971,600
市光工業	2,300	461.00	1,060,300

小糸製作所	8,900	5,370.00	47,793,000	
ミツバ	2,800	441.00	1,234,800	
S C R E E Nホールディングス	2,600	5,750.00	14,950,000	
キャノン電子	1,400	1,477.00	2,067,800	
キャノン	73,600	1,810.00	133,216,000	代用有価証券 10,000株
リコー	37,700	638.00	24,052,600	
象印マホービン	4,000	1,909.00	7,636,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,487.00	297,400	
東京エレクトロン	9,400	29,030.00	272,882,000	
トヨタ紡織	4,300	1,481.00	6,368,300	
芦森工業	300	887.00	266,100	
ユニプレス	2,900	856.00	2,482,400	
豊田自動織機	12,000	6,750.00	81,000,000	
モリタホールディングス	2,600	1,993.00	5,181,800	
三櫻工業	1,900	618.00	1,174,200	
デンソー	32,600	4,882.00	159,153,200	
東海理化電機製作所	3,900	1,595.00	6,220,500	
三井E & Sホールディングス	5,400	345.00	1,863,000	
川崎重工業	11,500	1,383.00	15,904,500	
名村造船所	5,000	151.00	755,000	
サノヤスホールディングス	1,900	162.00	307,800	
日本車輛製造	600	2,409.00	1,445,400	
三菱ロジスネクスト	2,000	926.00	1,852,000	
近畿車輛	200	1,329.00	265,800	
日産自動車	174,900	386.10	67,528,890	
いすゞ自動車	42,900	891.00	38,223,900	
トヨタ自動車	165,300	7,019.00	1,160,240,700	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,500	847.00	15,669,500	
三菱自動車工業	54,700	195.00	10,666,500	
エフテック	1,100	548.00	602,800	
レシップホールディングス	600	558.00	334,800	
G M B	300	608.00	182,400	
ファルテック	300	619.00	185,700	
武蔵精密工業	3,300	1,275.00	4,207,500	
日産車体	2,900	933.00	2,705,700	

新明和工業	4,000	832.00	3,328,000	
極東開発工業	2,800	1,399.00	3,917,200	
トピー工業	1,200	1,119.00	1,342,800	
ティラド	600	1,259.00	755,400	
タチエス	2,500	1,115.00	2,787,500	
N O K	7,900	1,255.00	9,914,500	
フタバ産業	4,200	513.00	2,154,600	
K Y B	1,700	2,172.00	3,692,400	
大同メタル工業	2,900	545.00	1,580,500	
プレス工業	7,500	292.00	2,190,000	
ミクニ	1,900	275.00	522,500	
太平洋工業	3,100	1,026.00	3,180,600	
河西工業	2,000	368.00	736,000	
アイシン精機	12,200	3,125.00	38,125,000	
マツダ	43,600	596.00	25,985,600	
今仙電機製作所	1,400	634.00	887,600	
本田技研工業	116,700	2,589.50	302,194,650	
スズキ	29,400	4,983.00	146,500,200	
S U B A R U	46,100	2,091.50	96,418,150	
安永	700	1,107.00	774,900	
ヤマハ発動機	20,900	1,530.00	31,977,000	
T B K	1,900	442.00	839,800	
エクセディ	2,000	1,329.00	2,658,000	
豊田合成	4,800	2,611.00	12,532,800	
愛三工業	2,400	469.00	1,125,600	
盟和産業	200	880.00	176,000	
日本プラスト	1,200	440.00	528,000	
ヨロズ	1,400	1,196.00	1,674,400	
エフ・シー・シー	2,400	1,990.00	4,776,000	
シマノ	5,500	24,760.00	136,180,000	
テイ・エス テック	3,400	3,065.00	10,421,000	
ジャムコ	800	604.00	483,200	
テルモ	41,900	4,132.00	173,130,800	
クリエートメディック	500	1,006.00	503,000	
日機装	4,800	1,036.00	4,972,800	
日本エム・ディ・エム	900	2,271.00	2,043,900	



島津製作所	17,700	3,130.00	55,401,000	
JMS	1,200	907.00	1,088,400	
長野計器	1,100	804.00	884,400	
ブイ・テクノロジー	700	4,760.00	3,332,000	
東京計器	900	895.00	805,500	
愛知時計電機	200	4,430.00	886,000	
インターアクション	800	1,742.00	1,393,600	
オーバル	1,300	227.00	295,100	
東京精密	2,700	3,715.00	10,030,500	
マニー	5,900	2,824.00	16,661,600	
ニコン	22,600	680.00	15,368,000	
トプコン	7,500	1,215.00	9,112,500	
オリンパス	82,000	2,138.00	175,316,000	
理研計器	1,300	2,924.00	3,801,200	
タムロン	1,200	1,566.00	1,879,200	
HOYA	29,400	12,565.00	369,411,000	
シード	700	643.00	450,100	
ノーリツ鋼機	1,000	1,984.00	1,984,000	
エー・アンド・デイ	1,300	656.00	852,800	
朝日インテック	16,800	3,370.00	56,616,000	
シチズン時計	17,200	282.00	4,850,400	
リズム	500	630.00	315,000	
大研医器	1,000	527.00	527,000	
メニコン	2,100	7,600.00	15,960,000	
シンシア	200	399.00	79,800	
松風	700	1,550.00	1,085,000	
セイコーホールディングス	2,200	1,340.00	2,948,000	
ニプロ	10,200	1,142.00	11,648,400	
中本パックス	400	1,557.00	622,800	
スノーピーク	900	1,931.00	1,737,900	
パラマウントベッドホールディングス	1,600	4,470.00	7,152,000	
トランザクション	800	947.00	757,600	
粧美堂	400	354.00	141,600	
ニホンフラッシュ	1,400	1,362.00	1,906,800	
前田工織	1,600	2,864.00	4,582,400	
永大産業	1,900	307.00	583,300	

アートネイチャー	1,500	674.00	1,011,000
バンダイナムコホールディングス	15,300	8,191.00	125,322,300
アイフィスジャパン	400	731.00	292,400
共立印刷	2,600	129.00	335,400
S H O E I	1,300	3,245.00	4,218,500
フランスベッドホールディングス	2,100	894.00	1,877,400
パイロットコーポレーション	2,600	3,055.00	7,943,000
萩原工業	800	1,599.00	1,279,200
トッパン・フォームズ	3,200	1,000.00	3,200,000
フジシールインターナショナル	3,300	2,058.00	6,791,400
タカラトミー	6,600	950.00	6,270,000
廣済堂	1,000	624.00	624,000
エステールホールディングス	400	604.00	241,600
タカノ	700	608.00	425,600
プロネクサス	1,200	1,144.00	1,372,800
ホクシン	900	117.00	105,300
ウッドワン	500	1,161.00	580,500
大建工業	1,000	2,060.00	2,060,000
凸版印刷	20,900	1,393.00	29,113,700
大日本印刷	19,400	2,056.00	39,886,400
共同印刷	400	2,557.00	1,022,800
N I S S H A	3,100	1,229.00	3,809,900
光村印刷	100	1,673.00	167,300
T A K A R A & C O M P A N Y	700	1,997.00	1,397,900
アシックス	13,100	1,346.00	17,632,600
ツツミ	400	2,215.00	886,000
小松ウオール工業	500	1,746.00	873,000
ヤマハ	8,800	5,230.00	46,024,000
河合楽器製作所	400	2,558.00	1,023,200
クリナップ	1,400	446.00	624,400
ビジョン	9,500	4,505.00	42,797,500
オリバー	300	2,440.00	732,000
兼松サステック	100	1,612.00	161,200
キングジム	1,200	900.00	1,080,000
リンテック	3,500	2,396.00	8,386,000
イトーキ	2,700	331.00	893,700

任天堂	9,100	57,810.00	526,071,000	
三菱鉛筆	2,500	1,442.00	3,605,000	
タカスタンダード	3,100	1,467.00	4,547,700	
コクヨ	7,100	1,424.00	10,110,400	
ナカバヤシ	1,400	616.00	862,400	
グローブライド	700	3,675.00	2,572,500	
オカムラ	5,200	848.00	4,409,600	
美津濃	1,400	1,848.00	2,587,200	
東京電力ホールディングス	118,200	286.00	33,805,200	
中部電力	45,300	1,255.50	56,874,150	
関西電力	56,100	978.80	54,910,680	
中国電力	21,400	1,382.00	29,574,800	
北陸電力	13,500	776.00	10,476,000	
東北電力	37,000	946.00	35,002,000	
四国電力	13,400	781.00	10,465,400	
九州電力	30,500	900.00	27,450,000	
北海道電力	13,800	426.00	5,878,800	
沖縄電力	2,900	1,599.00	4,637,100	
電源開発	11,800	1,468.00	17,322,400	
エフオン	800	871.00	696,800	
イーレックス	2,100	1,214.00	2,549,400	
レノバ	2,500	1,751.00	4,377,500	
東京瓦斯	28,500	2,505.00	71,392,500	
大阪瓦斯	28,700	2,023.00	58,060,100	
東邦瓦斯	7,300	5,880.00	42,924,000	
北海道瓦斯	800	1,553.00	1,242,400	
広島ガス	3,000	378.00	1,134,000	
西部瓦斯	1,700	2,756.00	4,685,200	
静岡ガス	4,200	1,001.00	4,204,200	
メタウォーター	1,400	2,466.00	3,452,400	
SBSホールディングス	1,100	2,436.00	2,679,600	
東武鉄道	15,400	3,200.00	49,280,000	
相鉄ホールディングス	4,800	2,662.00	12,777,600	
東急	37,400	1,310.00	48,994,000	
京浜急行電鉄	19,000	1,558.00	29,602,000	
小田急電鉄	22,000	2,766.00	60,852,000	

京王電鉄	7,700	6,650.00	51,205,000
京成電鉄	10,300	3,230.00	33,269,000
富士急行	2,000	4,715.00	9,430,000
東日本旅客鉄道	26,100	5,660.00	147,726,000
西日本旅客鉄道	13,200	4,723.00	62,343,600
東海旅客鉄道	12,300	13,255.00	163,036,500
西武ホールディングス	19,400	1,112.00	21,572,800
鴻池運輸	2,400	1,126.00	2,702,400
西日本鉄道	4,100	2,950.00	12,095,000
ハマキョウレックス	1,100	3,090.00	3,399,000
サカイ引越センター	800	4,965.00	3,972,000
近鉄グループホールディングス	14,000	4,430.00	62,020,000
阪急阪神ホールディングス	18,700	3,360.00	62,832,000
南海電気鉄道	6,700	2,525.00	16,917,500
京阪ホールディングス	6,300	4,135.00	26,050,500
神戸電鉄	300	3,660.00	1,098,000
名古屋鉄道	11,500	2,896.00	33,304,000
山陽電気鉄道	1,000	2,152.00	2,152,000
日本通運	4,900	6,730.00	32,977,000
ヤマトホールディングス	24,600	2,587.00	63,640,200
山九	3,900	3,955.00	15,424,500
丸運	1,000	239.00	239,000
丸全昭和運輸	1,200	3,295.00	3,954,000
センコーグループホールディングス	7,800	975.00	7,605,000
トナミホールディングス	300	5,960.00	1,788,000
ニッコンホールディングス	5,000	2,113.00	10,565,000
日本石油輸送	200	2,556.00	511,200
福山通運	1,800	4,770.00	8,586,000
セイノーホールディングス	10,500	1,408.00	14,784,000
エスライン	500	990.00	495,000
神奈川中央交通	300	3,955.00	1,186,500
日立物流	2,600	3,505.00	9,113,000
丸和運輸機関	1,500	4,655.00	6,982,500
C & F ロジホールディングス	1,500	1,818.00	2,727,000
九州旅客鉄道	12,300	2,300.00	28,290,000
S Gホールディングス	29,500	2,655.00	78,322,500

日本郵船	11,700	2,014.00	23,563,800	
商船三井	8,900	2,461.00	21,902,900	
川崎汽船	4,300	1,390.00	5,977,000	
N S ユナイテッド海運	800	1,446.00	1,156,800	
明治海運	1,500	404.00	606,000	
飯野海運	6,700	371.00	2,485,700	
共栄タンカー	200	774.00	154,800	
乾汽船	800	893.00	714,400	
日本航空	24,800	1,843.00	45,706,400	
A N A ホールディングス	25,600	2,297.00	58,803,200	
パスコ	300	1,326.00	397,800	
ランコム	400	7,980.00	3,192,000	
日新	1,200	1,569.00	1,882,800	
三菱倉庫	4,400	3,010.00	13,244,000	
三井倉庫ホールディングス	1,600	2,034.00	3,254,400	
住友倉庫	5,000	1,317.00	6,585,000	
澁澤倉庫	800	2,282.00	1,825,600	
東陽倉庫	2,500	351.00	877,500	
日本トランスシティ	3,200	536.00	1,715,200	
ケイヒン	300	1,367.00	410,100	
中央倉庫	800	1,200.00	960,000	
川西倉庫	300	1,060.00	318,000	
安田倉庫	1,100	960.00	1,056,000	
ファイズホールディングス	300	1,100.00	330,000	
東洋埠頭	400	1,455.00	582,000	
宇徳	1,200	496.00	595,200	
上組	7,800	1,915.00	14,937,000	
サンリツ	300	647.00	194,100	
キムラユニティー	400	1,045.00	418,000	
キューソー流通システム	400	1,747.00	698,800	
近鉄エクスプレス	3,000	2,391.00	7,173,000	
東海運	800	308.00	246,400	
エーアイティー	1,000	1,028.00	1,028,000	
内外トランスライン	500	1,195.00	597,500	
日本コンセプト	400	1,573.00	629,200	
N E C ネットズエスアイ	4,100	1,917.00	7,859,700	

クロスキャット	400	1,413.00	565,200
システナ	5,200	1,963.00	10,207,600
デジタルアーツ	700	8,950.00	6,265,000
日鉄ソリューションズ	2,200	3,155.00	6,941,000
キューブシステム	800	1,408.00	1,126,400
エイジア	300	1,945.00	583,500
コア	600	1,368.00	820,800
ラクーンホールディングス	700	2,341.00	1,638,700
ソリトンシステムズ	700	2,182.00	1,527,400
ソフトクリエイティブホールディングス	600	3,945.00	2,367,000
T I S	14,500	2,159.00	31,305,500
J N Sホールディングス	600	677.00	406,200
電算システム	500	3,290.00	1,645,000
グリー	8,900	561.00	4,992,900
コーエーテクモホールディングス	3,000	5,450.00	16,350,000
三菱総合研究所	600	4,215.00	2,529,000
ボルテージ	400	531.00	212,400
電算	200	2,333.00	466,600
A G S	800	909.00	727,200
ファインデックス	1,300	1,329.00	1,727,700
ブレインパッド	400	4,125.00	1,650,000
K L a b	2,700	978.00	2,640,600
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	947.00	1,704,600
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,957.00	591,400
ネクソン	36,700	3,015.00	110,650,500
アイスタイル	4,100	385.00	1,578,500
エムアップホールディングス	400	2,580.00	1,032,000
エイチーム	1,000	880.00	880,000
エニグモ	1,400	1,440.00	2,016,000
テクノスジャパン	1,200	776.00	931,200
コロプラ	4,800	937.00	4,497,600
ブロードリーフ	7,200	598.00	4,305,600
クロス・マーケティンググループ	700	353.00	247,100
デジタルハーツホールディングス	800	1,055.00	844,000
システム情報	1,100	1,237.00	1,360,700

メディアドゥ	500	7,320.00	3,660,000
じげん	3,700	333.00	1,232,100
ブイキューブ	800	2,462.00	1,969,600
エンカレッジ・テクノロジー	300	856.00	256,800
サイバーリンクス	300	4,200.00	1,260,000
フィックスターズ	1,600	1,036.00	1,657,600
CARTA HOLDINGS	600	1,380.00	828,000
オブティム	800	3,170.00	2,536,000
セレス	500	2,072.00	1,036,000
SHIFT	600	14,350.00	8,610,000
ティーガイア	1,300	1,910.00	2,483,000
セック	200	3,095.00	619,000
日本アジアグループ	1,600	432.00	691,200
テクマトリックス	2,100	1,945.00	4,084,500
プロシップ	500	1,541.00	770,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,500	2,562.00	8,967,000
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	14,190.00	43,989,000
ザッパラス	700	460.00	322,000
システムリサーチ	400	1,615.00	646,000
インターネットイニシアティブ	2,200	4,865.00	10,703,000
さくらインターネット	1,600	765.00	1,224,000
ヴィンクス	400	1,292.00	516,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	11,930.00	3,579,000
SRAホールディングス	800	2,433.00	1,946,400
システムインテグレータ	500	722.00	361,000
朝日ネット	1,100	953.00	1,048,300
eBASE	1,800	1,023.00	1,841,400
アバント	1,400	1,119.00	1,566,600
アドソル日進	500	2,795.00	1,397,500
フリービット	800	874.00	699,200
コムチュア	1,600	2,818.00	4,508,800
サイバーコム	300	1,822.00	546,600
アステリア	900	787.00	708,300
アイル	800	1,376.00	1,100,800
マークライنز	600	2,536.00	1,521,600
メディカル・データ・ビジョン	1,700	2,589.00	4,401,300

g u m i	1,900	882.00	1,675,800	
ショーケース	300	800.00	240,000	
モバイルファクトリー	400	1,032.00	412,800	
テラスカイ	500	4,700.00	2,350,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	600	1,350.00	810,000	
P C Iホールディングス	600	1,136.00	681,600	
パイブドHD	200	1,716.00	343,200	
アイビーシー	200	1,082.00	216,400	
ネオジャパン	300	2,479.00	743,700	
P R T I M E S	300	3,605.00	1,081,500	
ランドコンピュータ	200	1,130.00	226,000	
ダブルスタンダード	200	4,780.00	956,000	
オープンドア	700	1,200.00	840,000	
マイネット	500	1,203.00	601,500	
アカツキ	500	5,070.00	2,535,000	
ベネフィットジャパン	100	1,809.00	180,900	
U b i c o mホールディングス	300	2,852.00	855,600	
L I N E	3,400	5,390.00	18,326,000	
カナミックネットワーク	1,400	803.00	1,124,200	
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	9,170.00	9,170,000	
シンクロ・フード	700	299.00	209,300	
オークネット	800	1,442.00	1,153,600	
セグエグループ	400	1,435.00	574,000	
エイトレッド	300	2,710.00	813,000	
A O I T Y O H o l d i n g s	1,600	405.00	648,000	
マクロミル	3,000	663.00	1,989,000	
ビーグリー	300	2,191.00	657,300	
オロ	500	3,580.00	1,790,000	
ユーザーローカル	200	4,610.00	922,000	
テモナ	300	1,254.00	376,200	
サインポスト	300	953.00	285,900	
ソルクシーズ	600	1,059.00	635,400	
フェイス	600	969.00	581,400	
プロトコーポレーション	1,300	1,136.00	1,476,800	



ハイマックス	400	1,227.00	490,800
野村総合研究所	20,600	3,285.00	67,671,000
サイバネットシステム	1,100	879.00	966,900
C Eホールディングス	800	621.00	496,800
日本システム技術	200	1,784.00	356,800
インテージホールディングス	1,900	1,000.00	1,900,000
東邦システムサイエンス	400	934.00	373,600
ソースネクスト	7,000	305.00	2,135,000
インフォコム	1,600	3,965.00	6,344,000
HEROZ	200	3,065.00	613,000
ラクスル	1,200	5,230.00	6,276,000
F I G	1,700	265.00	450,500
システムサポート	300	1,584.00	475,200
イーソル	800	1,272.00	1,017,600
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,768.00	2,828,800
東海ソフト	100	1,097.00	109,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,480.00	444,000
東名	100	1,278.00	127,800
ヴィッツ	100	2,700.00	270,000
トピラシステムズ	100	1,550.00	155,000
L i n k - U	100	1,788.00	178,800
フォーカスシステムズ	900	939.00	845,100
クレスコ	900	1,262.00	1,135,800
フジ・メディア・ホールディングス	14,000	1,028.00	14,392,000
オービック	5,000	20,120.00	100,600,000
ジャストシステム	2,400	7,420.00	17,808,000
T D Cソフト	1,300	1,041.00	1,353,300
Zホールディングス	199,700	651.50	130,104,550
トレンドマイクロ	7,800	6,130.00	47,814,000
I Dホールディングス	600	1,373.00	823,800
日本オラクル	2,900	11,240.00	32,596,000
アルファシステムズ	500	3,440.00	1,720,000
フューチャー	1,800	1,771.00	3,187,800
C A C H o l d i n g s	900	1,343.00	1,208,700
S Bテクノロジー	500	3,900.00	1,950,000

トーセ	400	895.00	358,000
オービックビジネスコンサルタント	1,500	6,090.00	9,135,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,600	3,820.00	25,212,000
アイティフォー	1,800	923.00	1,661,400
東計電算	200	4,390.00	878,000
エクスネット	200	1,039.00	207,800
大塚商会	7,900	5,100.00	40,290,000
サイボウズ	1,700	3,135.00	5,329,500
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	5,610.00	5,049,000
A C C E S S	1,400	799.00	1,118,600
デジタルガレージ	2,600	3,910.00	10,166,000
E Mシステムズ	2,100	811.00	1,703,100
ウェザーニューズ	500	5,510.00	2,755,000
C I J	1,000	1,022.00	1,022,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,710.00	742,000
日本エンタープライズ	1,600	237.00	379,200
WOWOW	700	2,897.00	2,027,900
スカラ	1,000	954.00	954,000
インテリジェント ウェイブ	900	698.00	628,200
I M A G I C A G R O U P	1,300	407.00	529,100
ネットワンシステムズ	5,500	3,680.00	20,240,000
システムソフト	3,300	96.00	316,800
アルゴグラフィックス	1,200	3,380.00	4,056,000
マーベラス	2,300	759.00	1,745,700
エイベックス	2,500	987.00	2,467,500
日本ユニシス	4,500	3,215.00	14,467,500
兼松エレクトロニクス	800	4,505.00	3,604,000
都築電気	500	1,514.00	757,000
T B Sホールディングス	8,800	1,652.00	14,537,600
日本テレビホールディングス	12,100	1,095.00	13,249,500
朝日放送グループホールディングス	1,500	695.00	1,042,500
テレビ朝日ホールディングス	4,000	1,605.00	6,420,000
スカパーJ S A Tホールディングス	9,600	478.00	4,588,800
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,441.00	2,929,200
日本BS放送	500	1,083.00	541,500

ビジョン	1,900	974.00	1,850,600
スマートバリュー	400	1,225.00	490,000
USEN - NEXT HOLDINGS	600	1,390.00	834,000
コネクシオ	800	1,237.00	989,600
クロップス	300	825.00	247,500
日本電信電話	194,300	2,294.50	445,821,350
KDDI	106,000	2,990.00	316,940,000
ソフトバンク	132,100	1,223.00	161,558,300
光通信	1,500	25,350.00	38,025,000
NTTドコモ	104,000	3,889.00	404,456,000
エムティーアイ	1,400	914.00	1,279,600
GMOインターネット	5,200	3,015.00	15,678,000
アйдママーケティングコミュニケーション	400	397.00	158,800
KADOKAWA	3,900	3,305.00	12,889,500
学研ホールディングス	2,000	1,452.00	2,904,000
ゼンリン	2,900	1,271.00	3,685,900
昭文社ホールディングス	700	455.00	318,500
インプレスホールディングス	1,300	177.00	230,100
アイネット	800	1,445.00	1,156,000
松竹	1,000	13,040.00	13,040,000
東宝	8,600	4,305.00	37,023,000
東映	500	17,200.00	8,600,000
エヌ・ティ・ティ・データ	38,700	1,358.00	52,554,600
ピー・シー・エー	300	4,795.00	1,438,500
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,522.00	761,000
DTS	3,300	2,273.00	7,500,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,200	6,470.00	40,114,000
シーイーシー	1,600	1,538.00	2,460,800
カプコン	6,900	5,710.00	39,399,000
アイ・エス・ピー	300	2,716.00	814,800
ジャステック	900	1,502.00	1,351,800
SCSK	3,400	5,780.00	19,652,000
日本システムウエア	500	2,092.00	1,046,000
アイネス	1,500	1,526.00	2,289,000
TKC	1,200	6,870.00	8,244,000
富士ソフト	1,600	5,980.00	9,568,000

N S D	4,700	1,967.00	9,244,900
コナミホールディングス	5,300	4,985.00	26,420,500
福井コンピュータホールディングス	600	3,410.00	2,046,000
J B C Cホールディングス	1,000	1,590.00	1,590,000
ミロク情報サービス	1,300	2,197.00	2,856,100
ソフトバンクグループ	115,400	6,722.00	775,718,800
ハウスイ	200	938.00	187,600
高千穂交易	600	950.00	570,000
カワニシホールディングス	200	1,336.00	267,200
伊藤忠食品	400	5,550.00	2,220,000
エレマテック	1,400	1,039.00	1,454,600
J A L U X	400	1,390.00	556,000
あらた	1,200	5,110.00	6,132,000
トーメンデバイス	200	3,700.00	740,000
東京エレクトロン デバイス	600	3,210.00	1,926,000
フィールズ	1,200	333.00	399,600
双日	80,700	232.00	18,722,400
アルフレッサ ホールディングス	16,200	2,020.00	32,724,000
横浜冷凍	3,900	871.00	3,396,900
神栄	300	624.00	187,200
ラサ商事	800	897.00	717,600
アルコニックス	1,600	1,452.00	2,323,200
神戸物産	10,100	2,972.00	30,017,200
ハイパー	300	572.00	171,600
あい ホールディングス	2,100	1,913.00	4,017,300
ディーブイエックス	600	1,042.00	625,200
ダイワボウホールディングス	1,200	6,610.00	7,932,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	2,035.00	7,122,500
ラクト・ジャパン	600	3,170.00	1,902,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	986.00	2,760,800
八洲電機	1,200	950.00	1,140,000
メディアスホールディングス	900	906.00	815,400
レスターホールディングス	1,500	2,332.00	3,498,000
ジューテックホールディングス	400	968.00	387,200
大光	700	707.00	494,900
O C H Iホールディングス	500	1,500.00	750,000

TO K A Iホールディングス	7,800	1,084.00	8,455,200	
黒谷	500	557.00	278,500	
C o m i n i x	300	713.00	213,900	
三洋貿易	1,500	1,049.00	1,573,500	
ビューティガレージ	300	2,879.00	863,700	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,111.00	1,222,100	
ミタチ産業	500	619.00	309,500	
シップヘルスケアホールディングス	2,300	5,270.00	12,121,000	
明治電機工業	500	1,308.00	654,000	
デリカフーズホールディングス	600	603.00	361,800	
スターティアホールディングス	400	718.00	287,200	
コメダホールディングス	3,200	1,865.00	5,968,000	
ピーバンドットコム	200	921.00	184,200	
アセンテック	300	2,165.00	649,500	
富士興産	500	928.00	464,000	
協栄産業	200	1,344.00	268,800	
小野建	1,300	1,217.00	1,582,100	
南陽	400	1,758.00	703,200	
佐島電機	1,100	820.00	902,000	
エコートレーディング	400	608.00	243,200	
伯東	900	1,136.00	1,022,400	
コンドーテック	1,200	1,061.00	1,273,200	
中山福	900	497.00	447,300	
ナガイレーベン	2,000	2,718.00	5,436,000	
三菱食品	1,600	2,792.00	4,467,200	
松田産業	1,100	1,606.00	1,766,600	
第一興商	2,200	3,725.00	8,195,000	
メディバルホールディングス	15,800	1,832.00	28,945,600	
S P K	600	1,303.00	781,800	
萩原電気ホールディングス	600	2,299.00	1,379,400	
アズワン	1,000	15,900.00	15,900,000	
スズデン	500	1,159.00	579,500	
シモジマ	900	1,328.00	1,195,200	
ドウシシャ	1,400	1,925.00	2,695,000	
小津産業	400	1,844.00	737,600	
高速	900	1,554.00	1,398,600	

たけびし	500	1,450.00	725,000
リックス	400	1,684.00	673,600
丸文	1,400	487.00	681,800
ハピネット	1,300	1,471.00	1,912,300
橋本総業ホールディングス	300	2,356.00	706,800
日本ライフライン	4,300	1,400.00	6,020,000
タカショー	1,000	685.00	685,000
マルカ	500	2,262.00	1,131,000
I D O M	4,000	568.00	2,272,000
進和	900	2,014.00	1,812,600
エスケイジャパン	400	602.00	240,800
ダイトロン	600	1,493.00	895,800
シークス	1,900	1,301.00	2,471,900
田中商事	500	702.00	351,000
オーハシテクニカ	800	1,463.00	1,170,400
白銅	600	1,309.00	785,400
ダイコー通産	100	1,395.00	139,500
伊藤忠商事	99,100	2,568.00	254,488,800
丸紅	152,000	577.20	87,734,400
高島	300	1,832.00	549,600
長瀬産業	8,200	1,395.00	11,439,000
蝶理	1,000	1,684.00	1,684,000
豊田通商	16,300	3,145.00	51,263,500
三共生興	2,300	439.00	1,009,700
兼松	5,500	1,294.00	7,117,000
ツカモトコーポレーション	300	1,231.00	369,300
三井物産	126,400	1,706.00	215,638,400
日本紙パルプ商事	800	3,815.00	3,052,000
カメイ	1,900	1,141.00	2,167,900
東都水産	200	4,045.00	809,000
O U G ホールディングス	200	2,849.00	569,800
スターゼン	600	4,310.00	2,586,000
山善	5,700	1,068.00	6,087,600
椿本興業	300	3,740.00	1,122,000
住友商事	92,100	1,217.00	112,085,700
内田洋行	600	5,440.00	3,264,000

三菱商事	95,700	2,389.50	228,675,150
第一実業	700	4,000.00	2,800,000
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	2,236.00	8,049,600
西華産業	800	1,211.00	968,800
佐藤商事	1,200	1,023.00	1,227,600
菱洋エレクトロ	1,500	2,966.00	4,449,000
東京産業	1,400	548.00	767,200
ユアサ商事	1,400	3,115.00	4,361,000
神鋼商事	400	1,843.00	737,200
トルク	1,000	293.00	293,000
阪和興業	2,700	2,099.00	5,667,300
正栄食品工業	1,000	3,865.00	3,865,000
カナデン	1,200	1,355.00	1,626,000
菱電商事	1,100	1,598.00	1,757,800
フルサト工業	800	1,371.00	1,096,800
岩谷産業	3,400	4,810.00	16,354,000
ナイス	700	1,361.00	952,700
昭光通商	500	602.00	301,000
ニチモウ	200	1,852.00	370,400
極東貿易	400	1,491.00	596,400
イワキ	2,000	532.00	1,064,000
三愛石油	3,600	1,100.00	3,960,000
稲畑産業	3,200	1,407.00	4,502,400
G S Iクレオス	400	1,964.00	785,600
明和産業	1,500	411.00	616,500
クワザワホールディングス	600	569.00	341,400
ヤマエ久野	1,100	1,238.00	1,361,800
ワキタ	3,200	1,131.00	3,619,200
東邦ホールディングス	4,700	2,054.00	9,653,800
サンゲツ	4,000	1,583.00	6,332,000
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,277.00	2,809,400
シナネンホールディングス	600	3,025.00	1,815,000
伊藤忠エネクス	3,300	968.00	3,194,400
サンリオ	4,100	1,793.00	7,351,300
サンワテクノス	1,100	944.00	1,038,400
リョーサン	1,600	1,984.00	3,174,400

新光商事	2,200	884.00	1,944,800
トーホー	700	1,932.00	1,352,400
三信電気	800	2,152.00	1,721,600
東陽テクニカ	1,600	1,110.00	1,776,000
モスフードサービス	1,900	2,858.00	5,430,200
加賀電子	1,500	2,072.00	3,108,000
ソーダニッカ	1,600	572.00	915,200
立花エレテック	1,100	1,765.00	1,941,500
フォーバル	700	942.00	659,400
PALTAC	2,300	5,600.00	12,880,000
三谷産業	2,000	440.00	880,000
太平洋興発	600	609.00	365,400
西本Wismettacホールディングス	300	1,847.00	554,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,429.00	285,800
コア商事ホールディングス	400	1,311.00	524,400
国際紙パルプ商事	3,600	251.00	903,600
ヤマタネ	700	1,404.00	982,800
丸紅建材リース	200	1,728.00	345,600
日鉄物産	1,100	3,165.00	3,481,500
泉州電業	400	2,975.00	1,190,000
トラスコ中山	3,400	2,812.00	9,560,800
オートバックスセブン	5,500	1,352.00	7,436,000
モリト	1,100	612.00	673,200
加藤産業	2,100	3,550.00	7,455,000
北恵	400	1,000.00	400,000
イノテック	800	975.00	780,000
イエローハット	2,800	1,708.00	4,782,400
JKホールディングス	1,400	820.00	1,148,000
日伝	1,300	2,301.00	2,991,300
北沢産業	1,200	291.00	349,200
杉本商事	800	2,176.00	1,740,800
因幡電機産業	4,200	2,597.00	10,907,400
東テク	500	2,525.00	1,262,500
ミスミグループ本社	18,300	3,245.00	59,383,500
アルテック	1,100	307.00	337,700
タキヒヨー	500	1,808.00	904,000



葺王産業	300	1,341.00	402,300	
スズケン	6,200	3,785.00	23,467,000	
ジェコス	1,000	952.00	952,000	
グローセル	1,600	408.00	652,800	
ローソン	3,700	4,945.00	18,296,500	
サンエー	1,200	4,415.00	5,298,000	
カワチ薬品	1,100	3,130.00	3,443,000	
エービーシー・マート	2,300	5,800.00	13,340,000	
ハードオフコーポレーション	600	669.00	401,400	
アスクル	1,500	4,090.00	6,135,000	
ゲオホールディングス	2,600	1,583.00	4,115,800	
アダストリア	2,000	1,731.00	3,462,000	
ジーフット	1,000	445.00	445,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	430.00	129,000	
くら寿司	900	6,210.00	5,589,000	
キャンドウ	700	1,944.00	1,360,800	
パルグループホールディングス	1,500	1,200.00	1,800,000	
エディオン	6,700	1,019.00	6,827,300	
サーラコーポレーション	3,000	596.00	1,788,000	
ワッツ	700	800.00	560,000	
ハローズ	600	3,390.00	2,034,000	
フジオフードグループ本社	1,200	1,421.00	1,705,200	
あみやき亭	300	2,913.00	873,900	
ひらまつ	2,800	196.00	548,800	
大黒天物産	400	5,680.00	2,272,000	
ハニーズホールディングス	1,300	986.00	1,281,800	
ファーマライズホールディングス	400	768.00	307,200	
アルペン	1,100	2,517.00	2,768,700	
ハブ	400	607.00	242,800	
クオールホールディングス	2,200	1,128.00	2,481,600	
ジズホールディングス	800	7,860.00	6,288,000	
ビックカメラ	8,600	1,154.00	9,924,400	
DCMホールディングス	8,800	1,291.00	11,360,800	
Monotaro	10,400	5,820.00	60,528,000	
東京一番フーズ	400	579.00	231,600	
きちりホールディングス	400	668.00	267,200	

アークランドサービスホールディングス	1,200	2,083.00	2,499,600	
J.フロント リテイリング	17,400	809.00	14,076,600	
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,464.00	3,074,400	
マツモトキヨシホールディングス	6,000	4,150.00	24,900,000	
ブロンコビリー	800	2,317.00	1,853,600	
Z O Z O	10,000	2,855.00	28,550,000	
トレジャー・ファクトリー	400	718.00	287,200	
物語コーポレーション	400	11,200.00	4,480,000	
ココカラファイン	1,500	6,970.00	10,455,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	516.00	13,158,000	
H a m e e	500	1,809.00	904,500	
ウエルシアホールディングス	8,600	4,325.00	37,195,000	
クリエイトSDホールディングス	2,500	3,615.00	9,037,500	
丸善C H Iホールディングス	1,800	369.00	664,200	
ミサワ	300	787.00	236,100	
ティーライフ	200	1,157.00	231,400	
チムニー	500	1,235.00	617,500	
シュッピン	1,100	915.00	1,006,500	
オイシックス・ラ・大地	1,400	3,490.00	4,886,000	
ネクステージ	2,500	1,240.00	3,100,000	
ジョイフル本田	4,300	1,621.00	6,970,300	
鳥貴族	400	1,573.00	629,200	
キリン堂ホールディングス	600	3,505.00	2,103,000	
ホットランド	1,100	1,232.00	1,355,200	
すかいらーくホールディングス	16,300	1,537.00	25,053,100	
S F Pホールディングス	800	1,303.00	1,042,400	
綿半ホールディングス	1,100	1,360.00	1,496,000	
ヨシックス	200	1,655.00	331,000	
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	1,140.00	4,788,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	866.00	692,800	
B E E N O S	700	2,155.00	1,508,500	
あさひ	1,100	1,628.00	1,790,800	
日本調剤	900	1,682.00	1,513,800	
コスモス薬品	1,300	18,200.00	23,660,000	
トーエル	700	793.00	555,100	

オンリー	300	483.00	144,900
セブン&アイ・ホールディングス	57,100	3,240.00	185,004,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,800	562.00	4,383,600
ツルハホールディングス	3,200	14,950.00	47,840,000
サンマルクホールディングス	1,200	1,506.00	1,807,200
フェリシモ	300	1,329.00	398,700
トリドールホールディングス	3,600	1,379.00	4,964,400
T O K Y O B A S E	1,300	414.00	538,200
ウイルプラスホールディングス	200	570.00	114,000
J Mホールディングス	1,100	2,423.00	2,665,300
サツドラホールディングス	200	1,997.00	399,400
アレンザホールディングス	700	1,394.00	975,800
串カツ田中ホールディングス	400	1,758.00	703,200
パロックジャパンリミテッド	1,000	675.00	675,000
クスリのアオキホールディングス	1,300	8,770.00	11,401,000
力の源ホールディングス	700	612.00	428,400
スシローグローバルホールディングス	8,000	2,922.00	23,376,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	444.00	666,000
はるやまホールディングス	700	676.00	473,200
ノジマ	2,600	3,050.00	7,930,000
カップ・クリエイト	2,100	1,448.00	3,040,800
ライトオン	1,100	650.00	715,000
ジーンズメイト	500	307.00	153,500
良品計画	19,300	2,137.00	41,244,100
三城ホールディングス	1,600	285.00	456,000
アドヴァン	2,200	1,365.00	3,003,000
アルピス	500	2,617.00	1,308,500
コナカ	1,800	243.00	437,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,639.00	327,800
G - 7ホールディングス	900	2,342.00	2,107,800
イオン北海道	1,900	894.00	1,698,600
コジマ	2,600	678.00	1,762,800
ヒマラヤ	600	893.00	535,800
コーナン商事	2,100	3,570.00	7,497,000
エコス	500	2,345.00	1,172,500

ワタミ	1,700	983.00	1,671,100
マルシェ	400	543.00	217,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	32,100	2,294.00	73,637,400
西松屋チェーン	3,200	1,705.00	5,456,000
ゼンショーホールディングス	7,000	2,526.00	17,682,000
幸楽苑ホールディングス	900	1,818.00	1,636,200
ハークスレイ	300	923.00	276,900
サイゼリヤ	2,200	1,838.00	4,043,600
V Tホールディングス	6,100	374.00	2,281,400
魚力	400	1,759.00	703,600
フジ・コーポレーション	400	2,215.00	886,000
ユナイテッドアローズ	1,500	1,358.00	2,037,000
ハイデイ日高	2,100	1,705.00	3,580,500
京都きもの友禅	1,000	231.00	231,000
コロワイド	4,800	1,623.00	7,790,400
ピーシーデボコーポレーション	1,900	666.00	1,265,400
壱番屋	1,000	5,420.00	5,420,000
P L A N T	400	798.00	319,200
スギホールディングス	2,900	7,190.00	20,851,000
薬王堂ホールディングス	600	2,591.00	1,554,600
スクロール	2,300	737.00	1,695,100
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,850.00	2,775,000
木曽路	1,900	2,497.00	4,744,300
S R Sホールディングス	1,700	911.00	1,548,700
千趣会	2,700	330.00	891,000
タカキュー	1,300	139.00	180,700
リテールパートナーズ	1,900	1,457.00	2,768,300
ケーヨー	3,000	785.00	2,355,000
上新電機	1,700	2,644.00	4,494,800
日本瓦斯	2,300	5,060.00	11,638,000
ロイヤルホールディングス	2,500	1,869.00	4,672,500
東天紅	100	970.00	97,000
いなげや	1,800	1,832.00	3,297,600
島忠	2,700	5,510.00	14,877,000
チヨダ	1,500	961.00	1,441,500

ライフコーポレーション	1,100	3,755.00	4,130,500
リンガーハット	1,800	2,228.00	4,010,400
MrMaxHD	2,000	822.00	1,644,000
テンアライド	1,400	356.00	498,400
AOKIホールディングス	2,900	446.00	1,293,400
オークワ	2,300	1,413.00	3,249,900
コメリ	2,200	3,025.00	6,655,000
青山商事	3,000	497.00	1,491,000
しまむら	1,700	11,310.00	19,227,000
はせがわ	400	285.00	114,000
高島屋	10,600	809.00	8,575,400
松屋	3,000	711.00	2,133,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,900	621.00	4,284,900
近鉄百貨店	600	3,290.00	1,974,000
丸井グループ	13,300	1,987.00	26,427,100
アクシアル リテイリング	1,200	4,700.00	5,640,000
イオン	56,100	2,808.00	157,528,800
イズミ	3,000	3,505.00	10,515,000
平和堂	3,000	2,153.00	6,459,000
フジ	1,800	2,016.00	3,628,800
ヤオコー	1,700	7,620.00	12,954,000
ゼビオホールディングス	1,800	712.00	1,281,600
ケーズホールディングス	14,000	1,346.00	18,844,000
Olympicグループ	700	960.00	672,000
日産東京販売ホールディングス	2,200	263.00	578,600
シルバーライフ	200	1,996.00	399,200
Genky DrugStores	600	4,380.00	2,628,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	785.00	235,500
ブックオフグループホールディングス	800	858.00	686,400
アインホールディングス	1,800	7,710.00	13,878,000
元気寿司	400	2,336.00	934,400
ヤマダホールディングス	44,300	507.00	22,460,100
アークランドサカモト	2,300	2,004.00	4,609,200
ニトリホールディングス	6,300	22,250.00	140,175,000
愛眼	1,200	227.00	272,400
ケーユーホールディングス	800	790.00	632,000

吉野家ホールディングス	4,800	1,942.00	9,321,600	
松屋フーズホールディングス	700	3,480.00	2,436,000	
サガミホールディングス	2,000	1,291.00	2,582,000	
関西スーパーマーケット	1,200	1,251.00	1,501,200	
王将フードサービス	1,100	6,060.00	6,666,000	
プレナス	1,600	1,730.00	2,768,000	
ミニストップ	1,100	1,375.00	1,512,500	
アークス	3,000	2,297.00	6,891,000	
パローホールディングス	3,200	2,625.00	8,400,000	
藤久	300	997.00	299,100	
ベルク	700	6,610.00	4,627,000	
大庄	800	1,097.00	877,600	
ファーストリテイリング	2,000	75,480.00	150,960,000	
サンドラッグ	5,500	4,155.00	22,852,500	
サックスパー ホールディングス	1,300	538.00	699,400	
ヤマザワ	400	1,738.00	695,200	
やまや	300	2,188.00	656,400	
ベルーナ	3,200	873.00	2,793,600	
島根銀行	400	597.00	238,800	
じもとホールディングス	1,000	1,047.00	1,047,000	
めぶきフィナンシャルグループ	75,800	216.00	16,372,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	1,177.00	2,354,000	
九州フィナンシャルグループ	31,900	513.00	16,364,700	
ゆうちょ銀行	41,400	859.00	35,562,600	
富山第一銀行	3,500	302.00	1,057,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,400	362.00	30,190,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,700	732.00	7,100,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,600	408.00	3,508,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,404.00	1,965,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,074.00	5,185,000	
ひろぎんホールディングス	21,500	576.00	12,384,000	
新生銀行	10,700	1,350.00	14,445,000	
あおぞら銀行	8,700	1,764.00	15,346,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	999,600	426.80	426,629,280	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	158,800	354.00	56,215,200	

三井住友トラスト・ホールディングス	27,600	2,884.50	79,612,200	
三井住友フィナンシャルグループ	101,100	2,957.00	298,952,700	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	48,700	567.00	27,612,900	
群馬銀行	28,100	343.00	9,638,300	
武蔵野銀行	2,200	1,563.00	3,438,600	
千葉興業銀行	4,000	250.00	1,000,000	
筑波銀行	6,000	188.00	1,128,000	
七十七銀行	4,900	1,535.00	7,521,500	
青森銀行	1,100	2,411.00	2,652,100	
秋田銀行	900	1,577.00	1,419,300	
山形銀行	1,700	1,320.00	2,244,000	
岩手銀行	1,000	2,415.00	2,415,000	
東邦銀行	13,100	236.00	3,091,600	
東北銀行	700	1,100.00	770,000	
みちのく銀行	900	1,175.00	1,057,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,300	1,861.00	22,890,300	
静岡銀行	35,600	726.00	25,845,600	
十六銀行	1,800	1,993.00	3,587,400	
スルガ銀行	14,900	356.00	5,304,400	
八十二銀行	35,300	400.00	14,120,000	
山梨中央銀行	1,700	903.00	1,535,100	
大垣共立銀行	2,900	2,460.00	7,134,000	
福井銀行	1,300	1,978.00	2,571,400	
北國銀行	1,500	2,899.00	4,348,500	
清水銀行	600	1,800.00	1,080,000	
富山銀行	300	3,245.00	973,500	
滋賀銀行	2,900	2,372.00	6,878,800	
南都銀行	2,400	1,937.00	4,648,800	
百五銀行	13,100	329.00	4,309,900	
京都銀行	5,200	4,885.00	25,402,000	
紀陽銀行	5,200	1,673.00	8,699,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	1,022.00	9,913,400	
山陰合同銀行	8,700	553.00	4,811,100	
中国銀行	12,600	951.00	11,982,600	
鳥取銀行	500	1,147.00	573,500	

伊予銀行	20,800	684.00	14,227,200
百十四銀行	1,600	1,706.00	2,729,600
四国銀行	2,300	761.00	1,750,300
阿波銀行	2,400	2,690.00	6,456,000
大分銀行	800	2,568.00	2,054,400
宮崎銀行	1,000	2,382.00	2,382,000
佐賀銀行	900	1,388.00	1,249,200
沖縄銀行	1,300	3,095.00	4,023,500
琉球銀行	3,400	896.00	3,046,400
セブン銀行	48,800	245.00	11,956,000
みずほフィナンシャルグループ	198,600	1,341.00	266,322,600
高知銀行	500	748.00	374,000
山口フィナンシャルグループ	18,200	717.00	13,049,400
長野銀行	500	1,440.00	720,000
名古屋銀行	1,100	2,752.00	3,027,200
北洋銀行	22,000	227.00	4,994,000
愛知銀行	500	3,130.00	1,565,000
中京銀行	600	2,180.00	1,308,000
大光銀行	500	1,364.00	682,000
愛媛銀行	2,000	1,170.00	2,340,000
トマト銀行	600	1,025.00	615,000
京葉銀行	6,300	492.00	3,099,600
栃木銀行	7,000	188.00	1,316,000
北日本銀行	500	2,051.00	1,025,500
東和銀行	2,600	719.00	1,869,400
福島銀行	1,400	233.00	326,200
大東銀行	800	619.00	495,200
トモニホールディングス	11,300	333.00	3,762,900
フィデアホールディングス	14,100	108.00	1,522,800
池田泉州ホールディングス	17,000	161.00	2,737,000
F P G	4,600	479.00	2,203,400
マーキュリアインベストメント	600	640.00	384,000
S B Iホールディングス	16,800	2,596.00	43,612,800
ジャフコ グループ	2,200	4,830.00	10,626,000
大和証券グループ本社	117,300	435.10	51,037,230
野村ホールディングス	257,200	497.80	128,034,160



岡三証券グループ	12,500	346.00	4,325,000
丸三証券	4,400	475.00	2,090,000
東洋証券	5,500	120.00	660,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,800	285.00	4,788,000
光世証券	400	654.00	261,600
水戸証券	4,200	223.00	936,600
いちよし証券	2,800	423.00	1,184,400
松井証券	8,400	850.00	7,140,000
マネックスグループ	10,800	268.00	2,894,400
極東証券	2,000	706.00	1,412,000
岩井コスモホールディングス	1,400	1,295.00	1,813,000
藍澤證券	2,700	702.00	1,895,400
マネーパートナーズグループ	1,600	202.00	323,200
スパークス・グループ	7,000	237.00	1,659,000
かんぽ生命保険	5,100	1,671.00	8,522,100
S O M P Oホールディングス	27,500	3,957.00	108,817,500
アニコム ホールディングス	4,800	1,215.00	5,832,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	38,200	2,908.50	111,104,700
第一生命ホールディングス	82,700	1,575.50	130,293,850
東京海上ホールディングス	51,700	4,796.00	247,953,200
T & Dホールディングス	43,600	1,058.00	46,128,800
アドバンスクリエイト	300	2,065.00	619,500
全国保証	4,100	4,470.00	18,327,000
ジェイリース	400	772.00	308,800
イントラスト	500	920.00	460,000
日本モーゲージサービス	600	1,076.00	645,600
C a s a	500	1,287.00	643,500
アルヒ	2,300	2,155.00	4,956,500
プレミアグループ	800	2,105.00	1,684,000
クレディセゾン	10,200	1,198.00	12,219,600
芙蓉総合リース	1,500	6,220.00	9,330,000
みずほリース	2,200	2,677.00	5,889,400
東京センチュリー	2,900	5,660.00	16,414,000
日本証券金融	6,500	514.00	3,341,000
アイフル	22,300	322.00	7,180,600

リコーリース	1,200	2,907.00	3,488,400
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,119.00	10,071,000
アコム	29,400	487.00	14,317,800
ジャックス	1,600	1,850.00	2,960,000
オリエントコーポレーション	39,600	112.00	4,435,200
日立キャピタル	3,500	2,261.00	7,913,500
オリックス	90,700	1,348.50	122,308,950
三菱UFJリース	37,100	454.00	16,843,400
九州リースサービス	800	610.00	488,000
日本取引所グループ	42,000	2,550.00	107,100,000
イー・ギャランティ	1,700	2,105.00	3,578,500
アサックス	800	745.00	596,000
NECキャピタルソリューション	600	1,792.00	1,075,200
いちご	18,800	313.00	5,884,400
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	1,481.00	1,184,800
ADワークスグループ	3,200	155.00	496,000
ヒューリック	31,000	1,025.00	31,775,000
三栄建築設計	600	1,822.00	1,093,200
野村不動産ホールディングス	8,900	1,924.00	17,123,600
三重交通グループホールディングス	3,100	477.00	1,478,700
サムティ	2,100	1,755.00	3,685,500
ディア・ライフ	2,200	395.00	869,000
コーセーアールイー	600	547.00	328,200
日本商業開発	1,000	1,780.00	1,780,000
プレサンスコーポレーション	2,500	1,554.00	3,885,000
THEグローバル社	1,000	208.00	208,000
ハウスコム	300	1,290.00	387,000
日本管理センター	800	1,444.00	1,155,200
サンセイランディック	500	757.00	378,500
エストラスト	300	756.00	226,800
フージャースホールディングス	3,000	695.00	2,085,000
オープンハウス	4,600	3,940.00	18,124,000
東急不動産ホールディングス	39,800	472.00	18,785,600
飯田グループホールディングス	12,200	1,961.00	23,924,200
イーランド	300	788.00	236,400

ムゲンエステート	1,000	535.00	535,000	
ビーロット	800	786.00	628,800	
ファーストブラザーズ	300	992.00	297,600	
ハウストゥ	800	1,325.00	1,060,000	
シーアールイー	400	1,415.00	566,000	
プロパティエージェント	300	1,462.00	438,600	
ケイアイスター不動産	500	2,716.00	1,358,000	
アグレ都市デザイン	400	630.00	252,000	
グッドコムアセット	800	1,437.00	1,149,600	
ジェイ・エス・ビー	300	3,020.00	906,000	
テンポイノベーション	400	888.00	355,200	
グローバル・リンク・マネジメント	400	742.00	296,800	
パーク24	7,900	1,395.00	11,020,500	
パラカ	400	1,681.00	672,400	
三井不動産	71,100	1,855.00	131,890,500	
三菱地所	102,400	1,625.00	166,400,000	
平和不動産	2,700	3,180.00	8,586,000	
東京建物	14,500	1,261.00	18,284,500	
ダイビル	3,800	1,289.00	4,898,200	
京阪神ビルディング	2,400	2,177.00	5,224,800	
住友不動産	32,900	3,006.00	98,897,400	
テーオーシー	3,000	649.00	1,947,000	
東京楽天地	300	4,505.00	1,351,500	
スターツコーポレーション	2,000	2,569.00	5,138,000	
フジ住宅	1,900	603.00	1,145,700	
空港施設	1,700	471.00	800,700	
明和地所	1,000	477.00	477,000	
ゴールドクレスト	1,200	1,418.00	1,701,600	
エスリード	600	1,366.00	819,600	
日神グループホールディングス	2,400	396.00	950,400	
日本エスコン	2,700	908.00	2,451,600	
タカラレーベン	6,900	298.00	2,056,200	
A V A N T I A	900	893.00	803,700	
イオンモール	7,400	1,702.00	12,594,800	
毎日コムネット	500	729.00	364,500	
ファースト住建	700	1,016.00	711,200	

カチタス	3,600	3,200.00	11,520,000
トーセイ	2,100	1,100.00	2,310,000
サンフロンティア不動産	2,200	898.00	1,975,600
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	1,025.00	1,332,500
インテリックス	600	522.00	313,200
ランドビジネス	700	335.00	234,500
グランディハウス	1,300	358.00	465,400
日本空港ビルデング	4,700	4,520.00	21,244,000
明豊ファシリティワークス	700	623.00	436,100
日本工営	1,000	2,875.00	2,875,000
L I F U L L	5,000	401.00	2,005,000
ミクシィ	2,700	2,846.00	7,684,200
ジェイエシーリクルートメント	900	1,359.00	1,223,100
日本M&Aセンター	10,800	6,330.00	68,364,000
メンバーズ	400	2,029.00	811,600
中広	200	453.00	90,600
UTグループ	2,200	3,335.00	7,337,000
アイティメディア	600	2,824.00	1,694,400
タケエイ	1,600	1,069.00	1,710,400
E・Jホールディングス	300	2,266.00	679,800
ビーネックスグループ	1,800	1,048.00	1,886,400
コシダカホールディングス	3,400	392.00	1,332,800
アルトナー	300	889.00	266,700
パソナグループ	1,600	1,740.00	2,784,000
C D S	400	1,310.00	524,000
リンクアンドモチベーション	2,600	422.00	1,097,200
G C A	1,800	675.00	1,215,000
エス・エム・エス	4,400	3,180.00	13,992,000
サニーサイドアップグループ	500	671.00	335,500
パーソルホールディングス	14,100	1,666.00	23,490,600
リニカル	700	765.00	535,500
クックパッド	4,600	386.00	1,775,600
エスクリ	500	332.00	166,000
アイ・ケイ・ケイ	700	663.00	464,100
学情	500	1,002.00	501,000
スタジオアリス	700	1,980.00	1,386,000

シミックホールディングス	700	1,340.00	938,000	
エプコ	300	1,062.00	318,600	
N J S	300	1,938.00	581,400	
総合警備保障	5,600	5,100.00	28,560,000	
カカクコム	10,500	2,944.00	30,912,000	
アイロムグループ	500	1,907.00	953,500	
セントケア・ホールディング	900	730.00	657,000	
サイネックス	300	859.00	257,700	
ルネサンス	800	810.00	648,000	
ディップ	1,900	2,090.00	3,971,000	
デジタルホールディングス	1,000	1,378.00	1,378,000	
新日本科学	1,500	691.00	1,036,500	
ツクイホールディングス	3,400	554.00	1,883,600	
キャリアデザインセンター	300	1,031.00	309,300	
ベネフィット・ワン	5,200	2,845.00	14,794,000	
エムスリー	31,200	7,769.00	242,392,800	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	251.00	276,100	
プラス	200	423.00	84,600	
アウトソーシング	8,100	1,184.00	9,590,400	
ウェルネット	1,400	525.00	735,000	
ワールドホールディングス	500	2,253.00	1,126,500	
ディー・エヌ・エー	6,000	1,817.00	10,902,000	
博報堂D Yホールディングス	19,700	1,405.00	27,678,500	
ぐるなび	2,400	623.00	1,495,200	
タカミヤ	1,500	565.00	847,500	
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	1,067.00	1,173,700	
ファンコミュニケーションズ	3,900	471.00	1,836,900	
ライク	500	2,295.00	1,147,500	
ビジネス・ブレークスルー	600	400.00	240,000	
エスプール	3,700	730.00	2,701,000	
W D Bホールディングス	600	3,260.00	1,956,000	
手間いらず	100	5,160.00	516,000	
ティア	800	404.00	323,200	
C D G	100	1,624.00	162,400	
バリューコマース	1,000	3,415.00	3,415,000	
インフォマート	14,300	949.00	13,570,700	

J Pホールディングス	4,400	302.00	1,328,800	
エコナックホールディングス	2,400	90.00	216,000	
E P Sホールディングス	1,900	987.00	1,875,300	
レグス	400	1,522.00	608,800	
プレステージ・インターナショナル	5,300	913.00	4,838,900	
アミューズ	800	2,571.00	2,056,800	
ドリームインキュベータ	400	1,537.00	614,800	
クイック	900	1,096.00	986,400	
T A C	900	229.00	206,100	
ケネディクス	12,200	654.00	7,978,800	
電通グループ	15,900	3,035.00	48,256,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	550.00	275,000	
ぴあ	400	2,967.00	1,186,800	
イオンファンタジー	500	2,199.00	1,099,500	
シーティーエス	1,600	927.00	1,483,200	
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	4,000	2,720.00	10,880,000	
アルプス技研	1,300	2,096.00	2,724,800	
ダイオーズ	300	943.00	282,900	
日本空調サービス	1,500	763.00	1,144,500	
オリエンタルランド	15,100	15,705.00	237,145,500	
ダスキン	3,500	2,786.00	9,751,000	
明光ネットワークジャパン	1,800	624.00	1,123,200	
ファルコホールディングス	800	1,645.00	1,316,000	
秀英予備校	300	411.00	123,300	
ラウンドワン	4,000	868.00	3,472,000	
リゾートトラスト	6,500	1,532.00	9,958,000	
ビー・エム・エル	1,800	3,050.00	5,490,000	
ワタベウェディング	200	277.00	55,400	
りらいあコミュニケーションズ	2,500	1,233.00	3,082,500	
リソー教育	6,500	331.00	2,151,500	
早稲田アカデミー	600	986.00	591,600	
ユー・エス・エス	15,800	1,992.00	31,473,600	
東京個別指導学院	500	612.00	306,000	
サイバーエージェント	8,700	6,350.00	55,245,000	
楽天	66,000	1,078.00	71,148,000	

クリーク・アンド・リバー社	700	1,041.00	728,700	
テー・オー・ダブリュー	2,400	288.00	691,200	
山田コンサルティンググループ	900	1,035.00	931,500	
セントラルスポーツ	500	2,291.00	1,145,500	
フルキャストホールディングス	1,200	1,623.00	1,947,600	
エン・ジャパン	2,500	2,560.00	6,400,000	
リソルホールディングス	200	3,715.00	743,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,800	7,070.00	19,796,000	
アトラ	400	266.00	106,400	
インターワークス	300	332.00	99,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	12,690.00	7,614,000	
K e e P e r 技研	1,000	1,513.00	1,513,000	
ファーストロジック	300	836.00	250,800	
三機サービス	300	983.00	294,900	
G u n o s y	900	777.00	699,300	
デザインワン・ジャパン	500	235.00	117,500	
イー・ガーディアン	600	3,480.00	2,088,000	
リブセンス	800	267.00	213,600	
ジャパンマテリアル	4,300	1,478.00	6,355,400	
ベクトル	1,800	895.00	1,611,000	
ウチヤマホールディングス	700	309.00	216,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,223.00	1,467,600	
キャリアリンク	500	1,541.00	770,500	
I B J	1,100	973.00	1,070,300	
アサンテ	600	1,580.00	948,000	
N・フィールド	1,000	722.00	722,000	
バリューHR	600	1,688.00	1,012,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	5,730.00	6,303,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	2,369.00	1,184,500	
E R Iホールディングス	400	650.00	260,000	
アビスト	200	2,791.00	558,200	
シグマクシス	1,000	1,549.00	1,549,000	
ウィルグループ	900	848.00	763,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,100	316.00	663,600	
メドピア	700	5,680.00	3,976,000	
リクルートホールディングス	101,400	4,434.00	449,607,600	

エラン	1,000	2,609.00	2,609,000
土木管理総合試験所	700	404.00	282,800
ネットマーケティング	600	599.00	359,400
日本郵政	116,000	739.80	85,816,800
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,650.00	3,960,000
鎌倉新書	1,100	1,104.00	1,214,400
S MN	300	810.00	243,000
一蔵	200	365.00	73,000
L I T A L I C O	500	3,160.00	1,580,000
グローバルキッズCOMPANY	300	769.00	230,700
エアトリ	700	1,346.00	942,200
ハイアス・アンド・カンパニー	900	159.00	143,100
アトラエ	400	2,735.00	1,094,000
ストライク	500	5,890.00	2,945,000
ソラスト	3,900	1,373.00	5,354,700
セラク	400	2,062.00	824,800
インソース	600	3,560.00	2,136,000
ベikalレント・コンサルティング	900	16,190.00	14,571,000
Orchestra Holdings	300	2,300.00	690,000
アイモバイル	500	1,283.00	641,500
キャリアインデックス	600	482.00	289,200
MS - Japan	500	819.00	409,500
船場	300	915.00	274,500
グレイステクノロジー	700	5,930.00	4,151,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,600	4,250.00	6,800,000
フルテック	200	1,443.00	288,600
グリーンズ	400	481.00	192,400
ツナググループ・ホールディングス	300	410.00	123,000
GameWith	400	555.00	222,000
ソウルドアウト	300	1,466.00	439,800
MS&Consulting	300	615.00	184,500
エル・ティー・エス	100	5,000.00	500,000
ミダック	200	2,823.00	564,600
日総工産	1,000	820.00	820,000
キュービーネットホールディングス	600	1,584.00	950,400



R P Aホールディングス	1,100	718.00	789,800	
スプリックス	400	906.00	362,400	
マネジメントソリューションズ	700	1,493.00	1,045,100	
プロレド・パートナーズ	200	5,060.00	1,012,000	
and factory	100	851.00	85,100	
フロンティア・マネジメント	100	5,350.00	535,000	
ピアラ	100	2,518.00	251,800	
コプロ・ホールディングス	100	3,270.00	327,000	
ギークス	100	1,171.00	117,100	
カーブスホールディングス	3,900	678.00	2,644,200	
フォーラムエンジニアリング	700	918.00	642,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	701.00	490,700	
リログループ	7,700	2,580.00	19,866,000	
東祥	900	1,183.00	1,064,700	
エイチ・アイ・エス	2,200	1,467.00	3,227,400	
ラックランド	400	2,264.00	905,600	
共立メンテナンス	2,300	3,990.00	9,177,000	
イチネンホールディングス	1,600	1,278.00	2,044,800	
建設技術研究所	900	2,043.00	1,838,700	
スペース	900	794.00	714,600	
長大	600	1,276.00	765,600	
燦ホールディングス	600	1,250.00	750,000	
スバル興業	100	8,000.00	800,000	
東京テアトル	600	1,285.00	771,000	
タナベ経営	300	1,394.00	418,200	
ナガワ	500	8,600.00	4,300,000	
よみうりランド	300	4,800.00	1,440,000	
東京都競馬	900	5,170.00	4,653,000	
常磐興産	600	1,485.00	891,000	
カナモト	2,500	2,212.00	5,530,000	
東京ドーム	5,700	882.00	5,027,400	
西尾レントオール	1,300	2,040.00	2,652,000	
トランス・コスモス	1,300	3,160.00	4,108,000	
乃村工藝社	6,100	729.00	4,446,900	
藤田観光	600	1,526.00	915,600	
K N T - C Tホールディングス	900	925.00	832,500	

日本管財	1,500	2,117.00	3,175,500	
トーカイ	1,400	2,074.00	2,903,600	
白洋舎	200	2,350.00	470,000	
セコム	15,000	9,167.00	137,505,000	
セントラル警備保障	700	3,365.00	2,355,500	
丹青社	2,700	748.00	2,019,600	
メイテック	1,700	5,240.00	8,908,000	
応用地質	1,700	1,250.00	2,125,000	
船井総研ホールディングス	2,900	2,540.00	7,366,000	
進学会ホールディングス	300	422.00	126,600	
オオバ	1,000	791.00	791,000	
いであ	300	1,708.00	512,400	
学究社	400	1,065.00	426,000	
ベネッセホールディングス	4,700	2,551.00	11,989,700	
イオンディライト	1,700	2,825.00	4,802,500	
ナック	800	928.00	742,400	
ダイセキ	2,400	2,775.00	6,660,000	
ステップ	500	1,596.00	798,000	
合 計	15,605,600		34,394,247,690	

## (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11月 6日現在	2020年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	3,385,904,342	972,711,865
コール・ローン	2,246,438,511	1,762,909,076
出資金	20,426,058	-
株式	187,851,868,008	221,987,720,686
投資証券	5,220,260,729	5,247,863,381
派生商品評価勘定	53,527,984	121,431,199
未収入金	394,306	591,236
未収配当金	119,754,780	145,728,858
差入委託証拠金	463,621,612	518,140,681
流動資産合計	199,362,196,330	230,757,096,982
資産合計	199,362,196,330	230,757,096,982
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	1,070,934	30,276,948
未払金	3,240,224,432	-
未払解約金	50,156,950	8,098,832
未払利息	1,230	1,219
流動負債合計	3,291,453,546	38,376,999
負債合計	3,291,453,546	38,376,999
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	73,251,955,905	80,972,691,731
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	122,818,786,879	149,746,028,252
元本等合計	196,070,742,784	230,718,719,983
純資産合計	196,070,742,784	230,718,719,983
負債純資産合計	199,362,196,330	230,757,096,982

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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11月 6日現在	2020年11月 6日現在
1.	期首	2018年11月 7日	2019年11月 7日
	期首元本額	38,317,225,037円	73,251,955,905円
	期首からの追加設定元本額	38,499,125,495円	31,186,546,669円
	期首からの一部解約元本額	3,564,394,627円	23,465,810,843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）	18,595,869,724円	21,583,842,358円
	DCインデックスバランス（株式20）	110,317,988円	130,747,619円
	DCインデックスバランス（株式40）	288,800,098円	335,931,303円
	DCインデックスバランス（株式60）	561,418,014円	637,019,208円
	DCインデックスバランス（株式80）	581,624,073円	647,750,426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	2,057,388,555円	1,781,110,445円
	日興五大陸株式ファンド	5,056,376,911円	4,645,954,046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）	75,570,864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）	6,841,725,259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）	30,194,406,371円	36,336,826,466円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,906,163円	4,550,352円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,124,497円	3,666,871円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,185,915円	5,390,061円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	5,933,515円	4,882,516円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,123,233,076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）	27,634,168円	27,306,646円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	78,393,098円	74,179,157円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	114,845,746円	108,997,787円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	110,709,565円	102,138,945円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,270,778,006円	4,281,364,537円
計	73,251,955,905円	80,972,691,731円
2. 受益権の総数	73,251,955,905口	80,972,691,731口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2019年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	363,504
株式	3,073,358,088
投資証券	144,037,547
合計	2,929,684,045

（2020年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,767,873,639
投資証券	15,981,608
合計	2,783,855,247

(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11月 6日現在）

（単位：円）

--	--	--	--

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

(2020年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,360,505,367	-	3,476,085,248	115,579,881
合計		3,360,505,367	-	3,476,085,248	115,579,881

## (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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,700,387,290	-	3,718,292,000	17,904,710
	米ドル	3,023,475,500	-	3,040,664,000	17,188,500
	ユーロ	669,399,550	-	670,117,000	717,450
	豪ドル	7,512,240	-	7,511,000	1,240
合計		3,700,387,290	-	3,718,292,000	17,904,710

(2020年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,969,028,120	-	1,944,575,000	24,453,120
	米ドル	1,586,771,460	-	1,564,805,000	21,966,460
	ユーロ	382,256,660	-	379,770,000	2,486,660
	売建	37,790,840	-	37,763,350	27,490
	加ドル	17,062,400	-	17,051,650	10,750
	シンガポールドル	20,728,440	-	20,711,700	16,740
合計		2,006,818,960	-	1,982,338,350	24,425,630

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2019年11月 6日現在		2020年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.6767円	1口当たり純資産額	2.8493円
(1万口当たり純資産額)	(26,767円)	(1万口当たり純資産額)	(28,493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	15.73	640,918.85	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,070	16.45	379,501.50	
	CHENIERE ENERGY INC	12,390	49.50	613,305.00	
	CHEVRON CORP	97,201	72.14	7,012,080.14	
	CONCHO RESOURCES INC	11,125	43.63	485,383.75	
	CONOCOPHILLIPS	53,210	30.12	1,602,685.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,850	26.20	179,470.00	
	EOG RESOURCES INC	30,042	35.60	1,069,495.20	
	EXXON MOBIL CORP	213,501	33.17	7,081,828.17	
	HALLIBURTON CO	47,837	12.57	601,311.09	
	HESS CORP	16,170	37.00	598,290.00	
	KINDER MORGAN INC	108,650	11.90	1,292,935.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	34,972	31.83	1,113,158.76	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,851	9.30	212,514.30	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,231	10.47	536,388.57	
	ONEOK INC	22,780	28.54	650,141.20	
	PHILLIPS 66	21,765	48.19	1,048,855.35	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,810	79.58	621,519.80	
	SCHLUMBERGER LTD	68,001	15.52	1,055,375.52	
	VALERO ENERGY CORP	22,292	39.53	881,202.76	
	WILLIAMS COS INC	56,454	19.11	1,078,835.94	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,245	303.34	3,411,058.30	
	ALBEMARLE CORP	5,730	105.50	604,515.00	
	AMCOR PLC	86,480	11.51	995,384.80	
	AVERY DENNISON CORP	4,640	147.04	682,265.60	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,010	26.53	265,565.30	
	BALL CORP	17,440	97.16	1,694,470.40	
CELANESE CORP	5,120	119.67	612,710.40		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,140	27.34	331,907.60		
CORTEVA INC	37,162	33.94	1,261,278.28		

CROWN HOLDINGS INC	5,715	95.37	545,039.55
DOW INC	36,435	48.97	1,784,221.95
DUPONT DE NEMOURS INC	38,992	60.19	2,346,928.48
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,115	86.42	701,298.30
ECOLAB INC	13,150	196.42	2,582,923.00
FMC CORP	6,990	109.14	762,888.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	69,008	18.82	1,298,730.56
INTERNATIONAL PAPER CO	20,830	46.89	976,718.70
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,715	107.55	399,548.25
LINDE PLC	26,520	249.76	6,623,635.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,030	74.21	966,956.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,895	260.21	753,307.95
MOSAIC CO/THE	17,190	17.17	295,152.30
NEWMONT CORP	39,342	67.85	2,669,354.70
NUCOR CORP	17,449	48.80	851,511.20
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,220	122.54	639,658.80
PPG INDUSTRIES INC	12,704	138.26	1,756,455.04
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	91.51	511,540.90
SEALED AIR CORP	7,116	42.42	301,860.72
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,057	729.82	2,960,879.74
STEEL DYNAMICS INC	12,240	32.25	394,740.00
VULCAN MATERIALS CO	6,303	137.47	866,473.41
WESTROCK CO	13,449	39.23	527,604.27
3M CO	29,016	163.20	4,735,411.20
AERCAP HOLDINGS NV	6,440	28.19	181,543.60
ALLEGION PLC	3,850	104.13	400,900.50
AMETEK INC	10,633	109.05	1,159,528.65
BOEING CO/THE	27,032	157.09	4,246,456.88
CARRIER GLOBAL CORP	41,688	38.20	1,592,481.60
CATERPILLAR INC	27,296	163.09	4,451,704.64
CUMMINS INC	7,205	229.57	1,654,051.85
DEERE & CO	15,120	246.02	3,719,822.40
DOVER CORP	8,100	117.37	950,697.00
EATON CORP PLC	20,866	109.81	2,291,295.46
EMERSON ELECTRIC CO	29,590	70.47	2,085,207.30

FASTENAL CO	28,226	46.34	1,307,992.84
FORTIVE CORP	16,594	67.95	1,127,562.30
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,000	89.13	623,910.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,972	139.15	1,805,053.80
GENERAL ELECTRIC CO	445,493	7.99	3,559,489.07
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	42.89	383,865.50
HEICO CORP	2,000	114.04	228,080.00
HEICO CORP-CLASS A	4,130	99.75	411,967.50
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	35,436	183.28	6,494,710.08
HOWMET AEROSPACE INC	20,893	18.84	393,624.12
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,230	151.81	338,536.30
IDEX CORP	3,890	177.77	691,525.30
ILLINOIS TOOL WORKS	15,915	208.88	3,324,325.20
INGERSOLL-RAND INC	16,138	39.80	642,292.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,640	97.76	551,366.40
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,370	45.80	520,746.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	13,200	22.00	290,400.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,654	43.48	1,680,675.92
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,525	181.04	2,086,486.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	304.07	425,698.00
LOCKHEED MARTIN CORP	12,736	364.70	4,644,819.20
MASCO CORP	11,689	57.67	674,104.63
NORDSON CORP	3,030	208.47	631,664.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,034	307.40	2,469,651.60
OTIS WORLDWIDE CORP	20,494	62.63	1,283,539.22
OWENS CORNING	6,290	70.86	445,709.40
PACCAR INC	18,394	90.61	1,666,680.34
PARKER HANNIFIN CORP	6,240	237.98	1,484,995.20
PENTAIR PLC	8,438	53.77	453,711.26
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	76,266	58.28	4,444,782.48
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,273	250.30	1,570,131.90
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,100	386.00	1,968,600.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	45.19	292,379.30
SMITH (A.O.) CORP	7,970	53.82	428,945.40
SNAP-ON INC	3,080	161.71	498,066.80

STANLEY BLACK & DECKER INC	7,946	177.83	1,413,037.18
SUNRUN INC	6,000	58.00	348,000.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,600	336.21	537,936.00
TEXTRON INC	11,916	38.77	461,983.32
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,636	141.12	1,783,192.32
TRANSDIGM GROUP INC	2,500	519.29	1,298,225.00
UNITED RENTALS INC	3,570	188.47	672,837.90
WABTEC CORP	8,020	62.40	500,448.00
WW GRAINGER INC	2,127	378.84	805,792.68
XYLEM INC	8,028	90.82	729,102.96
CINTAS CORP	4,457	339.07	1,511,234.99
COPART INC	11,450	123.95	1,419,227.50
COSTAR GROUP INC	1,945	903.60	1,757,502.00
EQUIFAX INC	6,004	151.65	910,506.60
IHS MARKIT LTD	20,423	88.27	1,802,738.21
NIELSEN HOLDINGS PLC	20,905	14.13	295,387.65
REPUBLIC SERVICES INC	10,230	95.51	977,067.30
ROBERT HALF INTL INC	4,405	52.22	230,029.10
ROLLINS INC	8,030	63.29	508,218.70
TRANSUNION	8,490	88.07	747,714.30
VERISK ANALYTICS INC	7,280	194.41	1,415,304.80
WASTE CONNECTIONS INC	12,786	105.93	1,354,420.98
WASTE MANAGEMENT INC	21,294	119.69	2,548,678.86
AMERCO	375	400.09	150,033.75
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,210	88.80	640,248.00
CSX CORP	38,913	87.03	3,386,598.39
DELTA AIR LINES INC	8,455	31.98	270,390.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,507	87.41	656,186.87
FEDEX CORP	12,498	279.07	3,487,816.86
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	125.96	566,820.00
KANSAS CITY SOUTHERN	5,040	183.61	925,394.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,140	38.51	274,961.40
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,080	225.79	2,953,333.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,575	206.17	943,227.75
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,120	41.05	333,326.00

UBER TECHNOLOGIES INC	48,720	41.96	2,044,291.20
UNION PACIFIC CORP	34,276	192.07	6,583,391.32
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	35,737	163.56	5,845,143.72
XPO LOGISTICS INC	4,830	98.57	476,093.10
APTIV PLC	14,350	104.78	1,503,593.00
AUTOLIV INC	4,250	80.43	341,827.50
BORGWARNER INC	9,890	37.02	366,127.80
FORD MOTOR COMPANY	198,895	7.99	1,589,171.05
GENERAL MOTORS CORP	64,025	37.14	2,377,888.50
LEAR CORP	2,710	130.32	353,167.20
TESLA INC	37,565	438.09	16,456,850.85
DR HORTON INC	16,856	72.91	1,228,970.96
GARMIN LTD	7,065	113.27	800,252.55
HASBRO INC	6,698	84.10	563,301.80
LENNAR CORP-CL A	14,960	78.72	1,177,651.20
LULULEMON ATHLETICA INC	6,240	347.18	2,166,403.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,268	122.17	399,251.56
NEWELL BRANDS INC	16,126	19.56	315,424.56
NIKE INC -CL B	62,668	129.70	8,128,039.60
NVR INC	160	4,261.90	681,904.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,000	126.63	1,266,300.00
PULTE GROUP INC	15,390	46.02	708,247.80
RALPH LAUREN CORP	2,895	69.93	202,447.35
VF CORP	17,460	71.44	1,247,342.40
WHIRLPOOL CORP	2,864	198.76	569,248.64
ARAMARK	9,340	30.24	282,441.60
CARNIVAL CORP	23,087	14.18	327,373.66
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,320	1,310.32	1,729,622.40
DARDEN RESTAURANTS INC	6,553	101.52	665,260.56
DOMINO'S PIZZA INC	2,090	396.22	828,099.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,270	94.08	1,248,441.60
LAS VEGAS SANDS CORP	17,060	52.60	897,356.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,583	100.91	1,471,570.53
MCDONALD'S CORP	37,641	216.31	8,142,124.71
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	13,580	16.46	223,526.80

MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,070	21.84	482,008.80
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,248	60.17	436,112.16
STARBUCKS CORP	58,944	90.62	5,341,505.28
VAIL RESORTS INC	2,220	241.66	536,485.20
WYNN RESORTS LTD	5,560	80.13	445,522.80
YUM! BRANDS INC	15,314	100.70	1,542,119.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,190	80.14	3,140,686.60
ALPHABET INC-CL A	15,185	1,762.50	26,763,562.50
ALPHABET INC-CL C	15,322	1,763.37	27,018,355.14
ALTICE USA INC- A	16,770	29.37	492,534.90
CABLE ONE INC	250	1,953.32	488,330.00
CHARTER COMMUNICATION-A	7,376	647.36	4,774,927.36
COMCAST CORP-CLASS A	231,274	44.35	10,257,001.90
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,520	21.43	204,013.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	19.36	240,257.60
DISH NETWORK CORP-A	12,729	27.39	348,647.31
ELECTRONIC ARTS INC	14,674	128.33	1,883,114.42
FACEBOOK INC-CLASS A	121,760	294.68	35,880,236.80
FOX CORP - CLASS A	17,524	26.61	466,313.64
FOX CORP- CLASS B	7,486	26.37	197,405.82
IAC/INTERACTIVECORP	4,350	130.47	567,544.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	23,496	19.53	458,876.88
LIBERTY BROADBAND-A	1,280	151.33	193,702.40
LIBERTY BROADBAND-C	4,920	152.36	749,611.20
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	38.51	128,045.75
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	9,296	38.78	360,498.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,160	39.26	398,881.60
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,820	56.43	441,282.60
MATCH GROUP INC	12,562	134.97	1,695,493.14
NETFLIX INC	22,300	513.76	11,456,848.00
NEWS CORP - CLASS A	18,680	14.00	261,520.00
OMNICOM GROUP	11,727	49.32	578,375.64
PINTEREST INC- CLASS A	18,920	63.47	1,200,852.40
ROKU INC	4,850	225.06	1,091,541.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.09	287,691.60

SNAP INC - A	47,130	41.55	1,958,251.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,740	168.68	968,223.20
THE WALT DISNEY CO.	91,672	126.96	11,638,677.12
TWITTER INC	40,760	43.71	1,781,619.60
VIACOMCBS INC - CLASS B	31,833	31.29	996,054.57
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	103.85	703,064.50
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,278	156.43	512,777.54
AMAZON.COM INC	21,480	3,322.00	71,356,560.00
AUTOZONE INC	1,147	1,149.51	1,318,487.97
BEST BUY CO INC	12,554	123.06	1,544,895.24
BOOKING HOLDINGS INC	2,083	1,768.31	3,683,389.73
BURLINGTON STORES INC	3,120	204.82	639,038.40
CARMAX INC	7,819	93.32	729,669.08
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	13,000	218.01	2,834,130.00
DOLLAR TREE INC	11,976	95.10	1,138,917.60
EBAY INC	37,547	49.41	1,855,197.27
EXPEDIA INC	7,412	103.10	764,177.20
GENUINE PARTS CO	7,831	96.22	753,498.82
HOME DEPOT INC	54,420	285.85	15,555,957.00
LKQ CORP	16,840	34.84	586,705.60
LOWE'S COS INC	38,132	169.25	6,453,841.00
MERCADOLIBRE INC	2,290	1,437.80	3,292,562.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,685	450.11	1,658,655.35
ROSS STORES INC	17,422	94.94	1,654,044.68
TARGET CORP	25,270	158.63	4,008,580.10
TIFFANY & CO	5,820	131.16	763,351.20
TJX COMPANIES INC	60,316	54.61	3,293,856.76
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,990	138.98	832,490.20
ULTA BEAUTY INC	3,150	214.26	674,919.00
WAYFAIR INC- CLASS A	3,350	297.22	995,687.00
COSTCO WHOLESALE CORP	22,389	385.23	8,624,914.47
KROGER CO	42,890	32.72	1,403,360.80
SYSCO CORP	24,036	60.83	1,462,109.88
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,972	37.53	1,350,029.16
WALMART INC	71,862	143.47	10,310,041.14

ALTRIA GROUP INC	94,588	37.31	3,529,078.28
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,963	47.91	1,387,617.33
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,270	75.11	1,146,929.70
BUNGE LTD	5,457	58.50	319,234.50
CAMPBELL SOUP CO	8,995	48.06	432,299.70
COCA-COLA CO/THE	206,312	49.44	10,200,065.28
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,620	35.65	378,603.00
CONAGRA BRANDS INC	23,430	36.16	847,228.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,700	183.48	1,596,276.00
GENERAL MILLS INC	29,749	60.56	1,801,599.44
HERSHEY CO/THE	6,795	144.60	982,557.00
HORMEL FOODS CORP	13,870	49.56	687,397.20
INGREDION INC	3,120	71.31	222,487.20
JM SMUCKER CO/THE	6,390	115.80	739,962.00
KELLOGG CO	11,848	64.30	761,826.40
KEURIG DR PEPPER INC	19,450	28.80	560,160.00
KRAFT HEINZ CO/THE	36,031	31.70	1,142,182.70
LAMB WESTON HOLDING INC	6,490	67.76	439,762.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,035	188.54	1,137,838.90
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,590	38.25	443,317.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	72,705	55.64	4,045,306.20
MONSTER BEVERAGE CORP	20,350	83.68	1,702,888.00
PEPSICO INC	70,141	138.05	9,682,965.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	78,628	70.90	5,574,725.20
TYSON FOODS INC-CL A	14,326	57.71	826,753.46
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,740	90.03	1,056,952.20
CLOROX COMPANY	6,206	212.98	1,321,753.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,380	83.01	3,434,953.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,390	236.86	2,697,835.40
KIMBERLY-CLARK CORP	17,353	134.32	2,330,854.96
PROCTER & GAMBLE CO	125,559	142.38	17,877,090.42
ABBOTT LABORATORIES	89,766	113.53	10,191,133.98
ABIOMED INC	2,390	272.40	651,036.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,960	491.91	1,947,963.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,934	105.42	730,982.28



ANTHEM INC	12,821	319.60	4,097,591.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	25,169	77.76	1,957,141.44
BECTON DICKINSON AND CO	14,597	234.65	3,425,186.05
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,578	35.21	2,520,261.38
CARDINAL HEALTH INC	13,565	53.06	719,758.90
CENTENE CORP	30,987	67.88	2,103,397.56
CERNER CORP	16,450	72.40	1,190,980.00
CIGNA CORP	18,570	214.16	3,976,951.20
COOPER COS INC/THE	2,840	332.00	942,880.00
CVS HEALTH CORP	66,548	61.41	4,086,712.68
DANAHER CORP	32,349	240.34	7,774,758.66
DAVITA INC	3,068	98.15	301,124.20
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	46.61	536,108.22
DEXCOM INC	4,620	355.11	1,640,608.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	31,100	77.55	2,411,805.00
HCA HEALTHCARE INC	13,815	137.56	1,900,391.40
HENRY SCHEIN INC	8,370	61.57	515,340.90
HOLOGIC INC	11,868	76.67	909,919.56
HUMANA INC	6,645	440.79	2,929,049.55
IDEXX LABORATORIES INC	4,270	467.97	1,998,231.90
INSULET CORP	3,390	255.68	866,755.20
INTUITIVE SURGICAL INC	5,885	728.28	4,285,927.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,815	214.42	1,032,432.30
MASIMO CORP	2,870	249.99	717,471.30
MCKESSON CORP	7,824	170.95	1,337,512.80
MEDTRONIC PLC	67,738	104.01	7,045,429.38
MOLINA HEALTHCARE INC	3,380	216.82	732,851.60
QUEST DIAGNOSTICS	6,396	128.05	819,007.80
RESMED INC	7,260	212.81	1,545,000.60
STERIS PLC	4,210	179.16	754,263.60
STRYKER CORP	17,023	210.60	3,585,043.80
TELADOC HEALTH INC	5,430	208.51	1,132,209.30
TELEFLEX INC	2,650	337.27	893,765.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	47,990	354.40	17,007,656.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,440	117.82	523,120.80

VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,944	173.38	857,190.72
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,900	297.17	2,050,473.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,640	295.02	1,073,872.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,062	139.35	1,541,489.70
ABBVIE INC	89,196	93.69	8,356,773.24
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,870	110.34	1,640,755.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,740	125.44	1,347,225.60
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,580	137.86	769,258.80
AMGEN INC	29,801	231.97	6,912,937.97
AVANTOR INC	22,000	25.38	558,360.00
BEIGENE LTD-ADR	2,040	300.00	612,000.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,150	630.57	725,155.50
BIOGEN INC	8,153	328.90	2,681,521.70
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,200	75.05	690,460.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	114,035	63.75	7,269,731.25
CATALENT INC	8,690	102.48	890,551.20
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,836	32.58	678,836.88
ELI LILLY & CO	43,674	145.52	6,355,440.48
EXACT SCIENCES CORP	8,580	126.68	1,086,914.40
GILEAD SCIENCES INC	63,884	59.63	3,809,402.92
ILLUMINA INC	7,780	311.72	2,425,181.60
INCYTE CORP	8,950	84.65	757,617.50
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,080	48.72	247,497.60
IQVIA HOLDINGS INC	9,503	171.71	1,631,760.13
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,140	152.50	478,850.00
JOHNSON & JOHNSON	133,431	139.76	18,648,316.56
MERCK & CO. INC.	127,563	80.46	10,263,718.98
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,275	1,103.74	1,407,268.50
MODERNA INC	15,100	71.48	1,079,348.00
MYLAN NV	26,285	15.14	397,954.90
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,230	100.32	424,353.60
PERKINELMER INC	6,460	138.41	894,128.60
PERRIGO CO PLC	7,139	45.21	322,754.19
PFIZER INC	280,700	36.39	10,214,673.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,150	588.81	3,032,371.50

SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,730	145.15	541,409.50
SEAGEN INC	6,080	181.75	1,105,040.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	59,050	8.61	508,420.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,014	514.76	10,302,406.64
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,190	219.48	2,894,941.20
WATERS CORP	3,036	217.70	660,937.20
ZOETIS INC	24,180	170.90	4,132,362.00
BANK OF AMERICA CORP	394,499	24.61	9,708,620.39
CITIGROUP INC	104,937	43.07	4,519,636.59
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,680	28.91	684,588.80
COMERICA INC	7,850	46.47	364,789.50
EAST WEST BANCORP INC	7,460	37.73	281,465.80
FIFTH THIRD BANCORP	34,439	24.00	826,536.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,440	127.72	1,077,956.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	50,560	10.57	534,419.20
JPMORGAN CHASE & CO	154,080	104.35	16,078,248.00
KEYCORP	41,558	13.16	546,903.28
M & T BANK CORP	7,243	103.56	750,085.08
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	16,310	11.01	179,573.10
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,520	117.17	2,404,328.40
REGIONS FINANCIAL CORP	41,044	13.68	561,481.92
SIGNATURE BANK	3,150	78.44	247,086.00
SVB FINANCIAL GROUP	2,285	312.67	714,450.95
TRUIST FINANCIAL CORP	68,460	44.93	3,075,907.80
US BANCORP	67,861	40.46	2,745,656.06
WELLS FARGO & CO	196,420	22.33	4,386,058.60
ZIONS BANCORP NA	9,240	32.58	301,039.20
ALLY FINANCIAL INC	20,430	28.30	578,169.00
AMERICAN EXPRESS CO	34,464	98.11	3,381,263.04
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,520	172.69	1,125,938.80
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,500	41.70	396,150.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	42,962	35.60	1,529,447.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,050	207.45	14,531,872.50
BLACKROCK INC	7,675	668.19	5,128,358.25
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	32,120	57.45	1,845,294.00

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,715	78.70	1,866,370.50	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,170	27.39	196,386.30	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,300	83.05	523,215.00	
CME GROUP INC	18,230	150.45	2,742,703.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,630	68.50	1,002,155.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	23,170	22.98	532,446.60	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	332.97	532,752.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	15,725	20.13	316,544.25	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,618	202.96	3,372,789.28	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,430	100.96	2,870,292.80	
INVESCO LTD	22,157	14.43	319,725.51	
KKR & CO INC -A	22,540	38.19	860,802.60	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,060	581.17	1,197,210.20	
MOODY'S CORP	8,267	291.06	2,406,193.02	
MORGAN STANLEY	68,913	52.20	3,597,258.60	
MSCI INC	4,540	417.73	1,896,494.20	
NASDAQ INC	5,835	133.21	777,280.35	
NORTHERN TRUST CORP	10,690	81.58	872,090.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,360	79.64	426,870.40	
S&P GLOBAL INC	12,137	355.99	4,320,650.63	
SCHWAB (CHARLES) CORP	76,473	41.45	3,169,805.85	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,725	52.71	407,184.75	
STATE STREET CORP	18,797	62.83	1,181,015.51	
SYNCHRONY FINANCIAL	28,380	27.48	779,882.40	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,015	137.38	1,650,620.70	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	60.79	265,044.40	
VOYA FINANCIAL INC	5,580	50.84	283,687.20	
AFLAC INC	35,714	37.20	1,328,560.80	
ALLEGHANY CORP	820	581.47	476,805.40	
ALLSTATE CORP	16,523	90.41	1,493,844.43	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	78.03	226,287.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,685	33.43	1,493,819.55	
AON PLC	12,042	185.38	2,232,345.96	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,685	31.91	691,968.35	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,000	109.77	1,097,700.00	

ASSURANT INC	3,300	127.36	420,288.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	6,360	35.18	223,744.80
BROWN & BROWN INC	10,380	45.50	472,290.00
CHUBB LTD	21,965	136.73	3,003,274.45
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,940	74.55	666,477.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	238.80	284,172.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,314	211.83	490,174.62
FNF GROUP	15,131	33.45	506,131.95
GLOBE LIFE INC	5,426	86.30	468,263.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,482	39.94	618,351.08
LINCOLN NATIONAL CORP	8,243	35.90	295,923.70
LOEWS CORP	10,835	37.89	410,538.15
MARKEL CORP	795	991.42	788,178.90
MARSH & MCLENNAN COS	25,933	108.40	2,811,137.20
METLIFE INC	41,615	41.13	1,711,624.95
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,700	43.01	675,257.00
PROGRESSIVE CORP	29,580	97.29	2,877,838.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,602	65.37	1,346,752.74
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,610	106.31	383,779.10
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,437	166.79	406,467.23
TRAVELERS COS INC/THE	13,654	127.51	1,741,021.54
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,918	186.72	1,291,728.96
WR BERKLEY CORP	7,264	62.90	456,905.60
CBRE GROUP INC - A	16,420	52.92	868,946.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	3.90	191,880.00
JONES LANG LASALLE INC	2,800	119.84	335,552.00
ACCENTURE PLC-CL A	32,188	233.99	7,531,670.12
ADOBE INC	24,369	496.47	12,098,477.43
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,840	102.71	907,956.40
ANSYS INC	4,560	328.35	1,497,276.00
AUTODESK INC	11,180	255.92	2,861,185.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21,851	162.71	3,555,376.21
AVALARA INC	4,050	162.26	657,153.00
BLACK KNIGHT INC	6,530	94.55	617,411.50
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,490	86.30	646,387.00

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	6,100	144.68	882,548.00
CADENCE DESIGN SYS INC	13,940	124.07	1,729,535.80
CDK GLOBAL INC	5,890	46.83	275,828.70
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,170	121.23	747,989.10
CITRIX SYSTEMS INC	6,348	119.42	758,078.16
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	27,918	74.24	2,072,632.32
COUPA SOFTWARE INC	3,410	311.48	1,062,146.80
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,680	138.92	789,065.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,090	108.49	226,744.10
DATADOG INC-CLASS A	5,760	101.95	587,232.00
DOCUSIGN INC	8,840	236.77	2,093,046.80
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	20.12	215,485.20
DYNATRACE INC	6,630	38.68	256,448.40
EPAM SYSTEMS INC	3,010	346.63	1,043,356.30
FAIR ISAAC CORP	1,620	444.60	720,252.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	31,138	132.59	4,128,587.42
FISERV INC	28,924	102.16	2,954,875.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,540	240.00	1,089,600.00
FORTINET INC	6,710	119.51	801,912.10
GARTNER INC	4,890	146.25	715,162.50
GLOBAL PAYMENTS INC	15,359	174.24	2,676,152.16
GODADDY INC-CLASS A	9,240	75.76	700,022.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,370	104.53	456,796.10
INTL BUSINESS MACHINES CORP	44,792	114.77	5,140,777.84
INTUIT INC	13,146	350.96	4,613,720.16
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,240	153.66	651,518.40
LEIDOS HOLDINGS INC	6,620	91.40	605,068.00
MASTERCARD INC	45,220	316.53	14,313,486.60
MICROSOFT CORP	364,954	223.29	81,490,578.66
MONGODB INC	2,470	253.15	625,280.50
NORTONLIFELOCK INC	28,405	22.02	625,478.10
OKTA INC	5,930	233.19	1,382,816.70
ORACLE CORP	103,503	56.66	5,864,479.98
PALO ALTO NETWORKS INC	5,080	244.22	1,240,637.60
PAYCHEX INC	17,382	86.60	1,505,281.20

PAYCOM SOFTWARE INC	2,590	373.26	966,743.40
PAYPAL HOLDINGS INC	56,417	204.56	11,540,661.52
PTC INC	5,940	93.94	558,003.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,000	287.03	1,148,120.00
SALESFORCE.COM INC	45,495	260.22	11,838,708.90
SERVICENOW INC	9,620	531.08	5,108,989.60
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	17,030	27.45	467,473.50
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,300	263.21	342,173.00
SPLUNK INC	8,490	208.98	1,774,240.20
SQUARE INC - A	18,280	175.23	3,203,204.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,900	64.94	707,846.00
SYNOPSYS INC	7,237	240.56	1,740,932.72
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,080	647.30	1,346,384.00
TWILIO INC - A	6,210	307.54	1,909,823.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,030	409.90	832,097.00
VERISIGN INC	4,860	208.32	1,012,435.20
VISA INC-CLASS A SHARES	85,382	197.64	16,874,898.48
VMWARE INC	4,435	140.74	624,181.90
WESTERN UNION CO	24,501	20.88	511,580.88
WIX.COM LTD	2,700	278.12	750,924.00
WORKDAY INC-CLASS A	8,880	225.23	2,000,042.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,055	496.73	4,001,160.15
ZSCALER INC	3,600	150.07	540,252.00
AMPHENOL CORP-CL A	14,050	119.46	1,678,413.00
APPLE INC	878,518	119.03	104,569,997.54
ARISTA NETWORKS INC	2,870	257.00	737,590.00
ARROW ELECTRONICS INC	3,370	84.02	283,147.40
CDW CORP/DE	6,680	138.18	923,042.40
CISCO SYSTEMS INC	213,270	37.23	7,940,042.10
COGNEX CORP	8,920	73.90	659,188.00
CORNING INC	36,448	34.49	1,257,091.52
DELL TECHNOLOGIES -C	10,272	64.51	662,646.72
F5 NETWORKS INC	2,385	140.85	335,927.25
FLIR SYSTEMS INC	8,145	35.65	290,369.25
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	71,155	9.28	660,318.40

HP INC	69,365	19.13	1,326,952.45
IPG PHOTONICS CORP	1,840	197.55	363,492.00
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	20.51	378,471.03
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,550	111.13	1,061,291.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,195	160.85	1,479,015.75
NETAPP INC	10,616	46.71	495,873.36
SEAGATE TECHNOLOGY	9,694	52.75	511,358.50
TE CONNECTIVITY LTD	15,865	104.78	1,662,334.70
TRIMBLE INC	13,610	55.83	759,846.30
WESTERN DIGITAL CORP	17,778	39.15	696,008.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,910	340.12	989,749.20
AT&T INC	360,057	27.51	9,905,168.07
CENTURYLINK INC	39,606	9.28	367,543.68
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	19.81	150,258.85
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	20,111	19.35	389,147.85
T-MOBILE US INC	28,329	117.26	3,321,858.54
VERIZON COMMUNICATIONS INC	209,717	58.15	12,195,043.55
AES CORP	34,668	20.97	726,987.96
ALLIANT ENERGY CORP	12,340	54.88	677,219.20
AMEREN CORPORATION	12,032	82.47	992,279.04
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,748	90.71	2,335,601.08
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,345	158.21	1,478,472.45
ATMOS ENERGY CORP	7,060	95.02	670,841.20
CENTERPOINT ENERGY INC	24,962	22.67	565,888.54
CMS ENERGY CORP	16,110	64.44	1,038,128.40
CONSOLIDATED EDISON INC	16,076	79.73	1,281,739.48
DOMINION ENERGY INC	42,691	83.14	3,549,329.74
DTE ENERGY COMPANY	9,308	125.13	1,164,710.04
DUKE ENERGY CORP	37,386	94.22	3,522,508.92
EDISON INTERNATIONAL	20,859	59.38	1,238,607.42
ENTERGY CORP	9,367	106.82	1,000,582.94
ESSENTIAL UTILITIES INC	14,140	42.23	597,132.20
EVERGY INC	12,630	55.19	697,049.70
EVERSOURCE ENERGY	17,950	92.20	1,654,990.00
EXELON CORP	46,796	43.07	2,015,503.72



FIRSTENERGY CORP	26,905	29.39	790,737.95	
NEXTERA ENERGY INC	98,620	74.75	7,371,845.00	
NISOURCE INC	19,580	23.65	463,067.00	
NRG ENERGY INC	10,000	32.12	321,200.00	
OGE ENERGY CORP	12,270	31.97	392,271.90	
P G & E CORP	54,000	9.83	530,820.00	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	84.48	374,161.92	
PPL CORP	36,218	28.06	1,016,277.08	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	26,338	58.79	1,548,411.02	
SEMPRA ENERGY	14,107	127.01	1,791,730.07	
SOUTHERN CO	53,085	60.17	3,194,124.45	
UGI CORP	12,640	33.27	420,532.80	
VISTRA CORP	20,980	18.49	387,920.20	
WEC ENERGY GROUP INC	15,380	101.60	1,562,608.00	
XCEL ENERGY INC	26,384	73.73	1,945,292.32	
ADVANCED MICRO DEVICES	59,250	83.00	4,917,750.00	
ANALOG DEVICES INC	18,340	130.40	2,391,536.00	
APPLIED MATERIALS INC	45,953	69.95	3,214,412.35	
BROADCOM INC	20,140	380.87	7,670,721.80	
INTEL CORP	214,122	45.68	9,781,092.96	
KLA CORP	7,619	228.10	1,737,893.90	
LAM RESEARCH CORP	7,567	399.71	3,024,605.57	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,974	41.48	1,492,201.52	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,220	77.89	1,107,595.80	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,844	118.38	1,402,092.72	
MICRON TECHNOLOGY INC	55,647	54.58	3,037,213.26	
NVIDIA CORP	31,150	566.40	17,643,360.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,917	144.38	2,153,716.46	
ON SEMICONDUCTOR CORP	21,090	26.45	557,830.50	
QORVO INC	6,090	146.69	893,342.10	
QUALCOMM INC	56,922	145.41	8,277,028.02	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,320	149.12	1,240,678.40	
TERADYNE INC	8,220	99.32	816,410.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	46,412	155.56	7,219,850.72	
XILINX INC	11,675	129.93	1,516,932.75	

米ドル小計		15,723,181		1,549,848,852.73 (160,719,326,028)
加ドル	CAMECO CORP	19,892	12.07	240,096.44
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,694	21.90	1,197,798.60
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	4.76	262,671.08
	ENBRIDGE INC	102,937	37.12	3,821,021.44
	IMPERIAL OIL LTD	16,232	18.61	302,077.52
	INTER PIPELINE LTD	24,540	12.16	298,406.40
	KEYERA CORP	12,200	18.85	229,970.00
	PARKLAND CORP	7,370	38.04	280,354.80
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,932	28.58	826,876.56
	SUNCOR ENERGY INC	80,249	15.50	1,243,859.50
	TC ENERGY CORP	49,663	52.29	2,596,878.27
	AGNICO EAGLE MINES LTD	11,625	108.43	1,260,498.75
	B2GOLD CORP	55,700	9.10	506,870.00
	BARRICK GOLD CORP	92,164	38.48	3,546,470.72
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	53.76	430,080.00
	FRANCO-NEVADA CORP	9,775	195.96	1,915,509.00
	KINROSS GOLD CORP	61,865	11.54	713,922.10
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,580	64.36	809,648.80
	LUNDIN MINING CORP	35,450	8.41	298,134.50
	NUTRIEN LTD	28,588	52.67	1,505,729.96
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,120	47.14	524,196.80
	SSR MINING INC	10,000	27.24	272,400.00
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	17.70	449,137.50
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,085	64.31	1,484,596.35
	YAMANA GOLD INC	50,700	7.78	394,446.00
	CAE INC	14,195	23.97	340,254.15
	WSP GLOBAL INC	5,830	87.85	512,165.50
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,810	89.35	519,123.50
	THOMSON REUTERS CORP	8,516	111.98	953,621.68
	AIR CANADA	7,190	16.36	117,628.40
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,228	136.51	4,945,484.28
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,915	416.86	2,882,586.90
	MAGNA INTERNATIONAL INC	13,248	72.16	955,975.68

GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	28.90	287,555.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,698	70.56	1,107,650.88
QUEBECOR INC -CL B	10,270	31.74	325,969.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,755	22.63	447,055.65
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,110	157.55	489,980.50
DOLLARAMA INC	15,530	49.89	774,791.70
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	43,680	45.69	1,995,739.20
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	37.95	314,605.50
LOBLAW COMPANIES LTD	9,209	65.87	606,596.83
METRO INC	12,590	64.03	806,137.70
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	96.69	324,685.02
SAPUTO INC	9,620	32.44	312,072.80
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	21.86	277,272.24
CANOPY GROWTH CORP	11,710	27.68	324,132.80
CRONOS GROUP INC	7,240	8.45	61,178.00
BANK OF MONTREAL	33,551	82.09	2,754,201.59
BANK OF NOVA SCOTIA	60,449	56.63	3,423,226.87
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,025	101.91	2,244,567.75
NATIONAL BANK OF CANADA	18,230	66.75	1,216,852.50
ROYAL BANK OF CANADA	72,539	96.27	6,983,329.53
TORONTO-DOMINION BANK	92,380	59.43	5,490,143.40
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	66,629	43.86	2,922,347.94
CI FINANCIAL CORP	9,990	16.10	160,839.00
IGM FINANCIAL INC	3,335	31.16	103,918.60
ONEX CORPORATION	4,665	58.90	274,768.50
TMX GROUP LTD	3,030	128.85	390,415.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,460	383.71	560,216.60
GREAT-WEST LIFECO INC	14,894	28.16	419,415.04
IA FINANCIAL CORP INC	6,525	52.92	345,303.00
INTACT FINANCIAL CORP	8,055	145.05	1,168,377.75
MANULIFE FINANCIAL CORP	90,681	18.87	1,711,150.47
POWER CORP OF CANADA	23,289	26.71	622,049.19
SUN LIFE FINANCIAL INC	27,004	56.40	1,523,025.60
BLACKBERRY LTD	27,808	6.34	176,302.72
CGI INC	10,430	85.06	887,175.80

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	990	1,531.72	1,516,402.80	
	OPEN TEXT CORP	13,750	51.27	704,962.50	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	5,460	1,352.84	7,386,506.40	
	BCE INC	5,900	53.23	314,057.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,575	55.65	866,748.75	
	TELUS CORP	21,332	23.03	491,275.96	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	20.72	561,097.60	
	ALTAGAS LTD	11,770	17.60	207,152.00	
	ATCO LTD -CLASS I	4,130	37.33	154,172.90	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,320	30.60	223,992.00	
	EMERA INC	12,030	54.46	655,153.80	
	FORTIS INC	24,915	53.80	1,340,427.00	
	HYDRO ONE LTD	19,820	29.40	582,708.00	
加ドル小計		1,945,586		93,476,198.86 (7,414,532,093)	
ユーロ	ENI SPA	139,816	6.59	922,226.33	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	7.15	152,429.61	
	NESTE OYJ	22,830	49.23	1,123,920.90	
	OMV AG	7,890	21.46	169,319.40	
	REPSOL SA	81,149	5.78	469,365.81	
	TENARIS SA	19,915	5.06	100,769.90	
	TOTAL SE	125,907	27.50	3,463,072.03	
	VOPAK	3,530	46.84	165,345.20	
	AIR LIQUIDE SA	24,100	137.10	3,304,110.00	
	AKZO NOBEL	10,697	87.50	935,987.50	
	ARCELORMITTAL	35,962	12.31	442,836.06	
	ARKEMA	3,045	86.62	263,757.90	
	BASF SE	46,685	50.54	2,359,459.90	
	COVESTRO AG	9,190	42.46	390,207.40	
	CRH PLC	42,390	31.66	1,342,067.40	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,440	21.74	248,705.60	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	46.48	134,792.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	53.76	405,619.20	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,082	146.85	1,333,691.70	
	LANXESS AG	5,195	45.66	237,203.70	

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,840	36.10	427,424.00
SOLVAY SA	3,231	75.42	243,682.02
STORA ENSO OYJ-R SHS	29,305	13.28	389,170.40
SYMRISE AG	6,400	110.55	707,520.00
THYSSENKRUPP AG	19,305	4.22	81,486.40
UMICORE	10,350	32.22	333,477.00
UPM-KYMMENE OYJ	29,468	24.95	735,226.60
VOESTALPINE AG	7,119	24.65	175,483.35
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	22.59	236,878.74
AIRBUS GROUP SE	28,718	70.38	2,021,172.84
ALSTOM	8,950	38.81	347,349.50
ANDRITZ AG	3,810	31.34	119,405.40
BOUYGUES SA	11,990	29.90	358,501.00
BRENTAG AG	6,735	60.16	405,177.60
CNH INDUSTRIAL NV	61,720	7.72	476,725.28
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	28,726	37.14	1,066,883.64
DASSAULT AVIATION SA	135	773.00	104,355.00
EIFFAGE	3,250	69.00	224,250.00
FERROVIAL SA	23,315	20.02	466,766.30
FERROVIAL SA -RTS(N)	23,315	0.20	4,663.00
GEA GROUP AG	6,680	28.66	191,448.80
HOCHTIEF AG	1,490	66.45	99,010.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,880	82.45	649,706.00
KION GROUP AG	3,820	70.46	269,157.20
KNORR-BREMSE AG	2,970	103.88	308,523.60
KONE OYJ-B	16,134	72.98	1,177,459.32
LEGRAND SA	13,818	67.18	928,293.24
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	22,040	4.67	103,103.12
MTU AERO ENGINES AG	2,510	166.30	417,413.00
PRYSMIAN SPA	13,115	24.65	323,284.75
SAFRAN SA	16,840	99.86	1,681,642.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,138	113.60	3,196,476.80
SIEMENS AG-REG	38,556	110.08	4,244,244.48
SIEMENS ENERGY AG	20,123	20.22	406,887.06
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	26.56	312,345.60

THALES SA	5,655	62.50	353,437.50
VINCI SA	26,050	74.28	1,934,994.00
WARTSILA OYJ ABP	21,180	7.04	149,276.64
BUREAU VERITAS SA	14,440	20.43	295,009.20
RANDSTAD NV	4,965	45.96	228,191.40
TELEPERFORMANCE	2,640	289.10	763,224.00
WOLTERS KLUWER	13,177	77.78	1,024,907.06
ADP	1,740	89.10	155,034.00
AENA SA	3,970	125.10	496,647.00
ATLANTIA SPA	30,320	14.58	442,217.20
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	7.98	95,376.72
DEUTSCHE POST AG-REG	50,843	41.35	2,102,358.05
FRAPORT AG	2,750	33.66	92,565.00
GETLINK	24,830	12.56	311,864.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,335	64.79	1,123,134.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	48.98	141,062.40
CONTINENTAL AG	5,955	94.34	561,794.70
DAIMLER AG	42,742	49.41	2,112,095.93
FAURECIA	4,660	32.67	152,242.20
FERRARI NV	6,584	174.55	1,149,237.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	60,657	11.42	692,945.56
MICHELIN (CGDE)-B	8,259	98.12	810,373.08
PEUGEOT SA	27,870	16.92	471,560.40
PIRELLI & C SPA	24,100	3.71	89,627.90
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	8,230	50.84	418,413.20
RENAULT SA	10,857	23.45	254,596.65
VALEO SA	12,380	27.39	339,088.20
VOLKSWAGEN AG	1,951	145.60	284,065.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,153	135.92	1,244,075.76
ADIDAS AG	9,631	275.10	2,649,488.10
ESSILORLUXOTTICA	15,065	111.40	1,678,241.00
HERMES INTERNATIONAL	1,587	845.40	1,341,649.80
KERING	3,717	565.10	2,100,476.70
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,014	436.75	6,120,614.50
MONCLER SPA	8,860	37.82	335,085.20

PUMA SE	4,530	79.78	361,403.40
SEB SA	1,300	147.60	191,880.00
ACCOR SA	7,646	23.55	180,063.30
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,866	152.90	1,202,711.40
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	34.71	135,369.00
SODEXO	4,090	57.82	236,483.80
BOLLORE	47,430	3.26	154,811.52
JC DECAUX SA	5,130	13.80	70,794.00
PUBLICIS GROUPE	8,645	32.15	277,936.75
SCOUT24 AG	5,880	71.30	419,244.00
SES	21,670	7.75	167,942.50
TELENET GROUP HOLDING NV	2,110	31.34	66,127.40
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,800	81.48	391,104.00
VIVENDI	38,320	25.76	987,123.20
DELIVERY HERO SE	6,940	114.80	796,712.00
INDITEX	52,245	23.23	1,213,651.35
JUST EAT TAKEAWAY	6,500	103.10	670,150.00
PROSUS	24,410	94.50	2,306,745.00
ZALANDO SE	7,390	87.50	646,625.00
CARREFOUR SA	31,793	13.57	431,431.01
COLRUYT SA	2,305	50.98	117,508.90
JERONIMO MARTINS	15,165	13.93	211,324.27
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	57,488	23.89	1,373,388.32
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	5,840	8.48	49,534.88
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	37,201	47.69	1,774,115.69
DANONE	32,214	50.30	1,620,364.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	31,170	9.20	286,951.02
HEINEKEN HOLDING NV	6,325	71.80	454,135.00
HEINEKEN NV	12,123	82.32	997,965.36
KERRY GROUP PLC-A	8,460	105.90	895,914.00
PERNOD-RICARD SA	11,126	147.45	1,640,528.70
REMY COINTREAU	1,360	150.20	204,272.00
BEIERSDORF AG	5,415	93.60	506,844.00
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	82.50	370,425.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	9,853	88.52	872,187.56

L'OREAL	12,816	298.80	3,829,420.80
UNILEVER NV	74,335	51.38	3,819,332.30
BIOMERIEUX	2,140	133.10	284,834.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	115.30	219,070.00
DIASORIN SPA	1,330	199.70	265,601.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,483	71.02	815,522.66
FRESENIUS SE & CO KGAA	22,885	34.14	781,293.90
KONINKLIJKE PHILIPS NV	46,220	43.29	2,000,863.80
ORPEA	2,780	93.22	259,151.60
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,810	404.20	731,602.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	38.32	430,333.60
ARGENX SE	2,260	234.60	530,196.00
BAYER AG-REG	51,024	43.79	2,234,596.08
EUROFINS SCIENTIFIC	595	728.60	433,517.00
GALAPAGOS NV	1,710	108.10	184,851.00
GRIFOLS SA	16,550	25.08	415,074.00
IPSEN	2,270	85.60	194,312.00
MERCK KGAA	6,090	136.20	829,458.00
ORION OYJ-CLASS B	5,150	39.64	204,146.00
QIAGEN N.V.	12,144	43.24	525,106.56
RECORDATI SPA	6,540	46.23	302,344.20
SANOFI	57,496	85.67	4,925,682.32
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,160	355.40	412,264.00
UCB SA	6,838	95.18	650,840.84
ABN AMRO BANK NV-CVA	22,380	7.41	165,970.08
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	309,673	2.56	792,762.88
BANCO SANTANDER SA	844,049	1.83	1,545,116.09
BANKINTER SA	40,610	3.29	133,850.56
BNP PARIBAS	59,472	33.88	2,014,911.36
CAIXABANK S.A	150,050	1.63	245,031.65
COMMERZBANK AG	48,544	4.01	194,952.70
CREDIT AGRICOLE SA	70,292	7.54	530,423.43
ERSTE GROUP BANK AG	12,928	18.02	232,962.56
FINECOBANK SPA	26,120	12.47	325,847.00
ING GROEP NV-CVA	193,135	6.09	1,177,737.23



INTESA SANPAOLO	829,593	1.63	1,358,209.65
KBC GROEP NV	14,349	44.10	632,790.90
MEDIOBANCA SPA	33,950	6.71	227,804.50
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	13.10	101,656.00
SOCIETE GENERALE	41,059	13.22	543,128.45
UNICREDIT SPA	113,836	7.02	799,356.39
AMUNDI SA	3,300	61.75	203,775.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	106,645	8.54	910,748.30
DEUTSCHE BOERSE AG	9,000	134.25	1,208,250.00
EURAZEO SE	1,877	42.58	79,922.66
EXOR NV	5,564	50.84	282,873.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,252	74.22	464,023.44
NATIXIS	49,540	2.21	109,780.64
SOFINA	800	236.50	189,200.00
WENDEL	1,690	81.80	138,242.00
AEGON NV	77,949	2.44	190,819.15
AGEAS	9,104	34.71	315,999.84
ALLIANZ SE-REG	21,248	166.94	3,547,141.12
ASSICURAZIONI GENERALI	49,048	12.38	607,214.24
AXA SA	103,232	15.74	1,625,284.60
CNP ASSURANCES	10,340	10.56	109,190.40
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	130.50	398,677.50
MAPFRE SA	59,864	1.38	82,672.18
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,896	208.40	1,437,126.40
NN GROUP NV	14,100	31.97	450,777.00
POSTE ITALIANE SPA	25,780	7.71	198,763.80
SAMPO OYJ-A SHS	24,259	34.02	825,291.18
SCOR SE	7,452	22.86	170,352.72
AROUNDTOWN SA	56,420	4.24	239,220.80
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,170	46.31	748,832.70
LEG IMMOBILIEN AG	3,800	123.88	470,744.00
VONOVIA SE	27,608	59.10	1,631,632.80
ADYEN NV	900	1,614.00	1,452,600.00
AMADEUS IT GROUP SA	23,150	46.62	1,079,253.00
ATOS SE	5,240	62.40	326,976.00

CAP GEMINI SA	8,799	110.40	971,409.60
DASSAULT SYSTEMES SA	7,260	154.60	1,122,396.00
EDENRED	13,336	41.67	555,711.12
NEMETSCHKE SE	3,020	66.45	200,679.00
NEXI SPA	20,200	14.26	288,052.00
SAP SE	52,702	98.21	5,175,863.42
TEAMVIEWER AG	7,050	38.80	273,540.00
WORLDLINE SA	10,250	68.62	703,355.00
NOKIA OYJ	301,566	3.00	906,959.74
ALTICE EUROPE NV	34,400	4.22	145,408.80
CELLNEX TELECOM SA	15,470	57.10	883,337.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	162,266	13.90	2,256,308.73
ELISA OYJ	5,465	44.31	242,154.15
ILIAD SA	566	173.30	98,087.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	10,000	9.86	98,600.00
KONINKLIJKE KPN NV	194,906	2.28	444,385.68
ORANGE S.A.	91,354	9.56	873,892.36
PROXIMUS	8,290	15.61	129,448.35
TELECOM ITALIA SPA	317,713	0.31	100,301.99
TELECOM ITALIA-RSP	334,757	0.33	110,469.81
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	54,770	2.29	125,642.38
TELEFONICA SA	267,639	2.89	774,547.26
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,700	30.78	206,226.00
E.ON SE	119,489	9.36	1,118,417.04
EDF	32,475	10.60	344,235.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,171	4.44	676,400.09
ELIA GROUP SA/NV	1,600	87.90	140,640.00
ENAGAS SA	12,350	18.78	231,994.75
ENDESA SA	16,390	24.27	397,785.30
ENEL SPA	413,917	7.61	3,150,322.28
ENGIE	89,854	11.24	1,010,408.23
FORTUM OYJ	27,245	17.07	465,072.15
IBERDROLA SA	302,352	11.00	3,325,872.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	17.19	260,462.88
RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	15.97	307,039.50

	RWE AG	31,835	34.22	1,089,393.70
	SNAM SPA	119,980	4.37	524,312.60
	SUEZ	20,969	16.03	336,133.07
	TERNA SPA	77,357	6.10	472,187.12
	UNIPER SE	11,740	27.26	320,032.40
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,224	17.24	521,212.88
	VERBUND AG	2,780	54.20	150,676.00
	ASML HOLDING NV	21,502	335.25	7,208,545.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	65,425	26.38	1,725,911.50
	STMICROELECTRONICS NV	32,603	28.80	938,966.40
ユーロ小計		9,660,670		193,198,327.21 (23,662,931,116)
英ポンド	BP PLC	1,024,538	2.00	2,055,735.49
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	201,658	10.07	2,032,309.32
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	184,849	9.67	1,787,674.67
	ANGLO AMERICAN PLC	60,604	18.60	1,127,598.02
	ANTOFAGASTA PLC	20,030	10.39	208,211.85
	BHP GROUP PLC	105,851	15.55	1,646,194.75
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	63.68	351,577.28
	EVRAZ PLC	27,180	3.62	98,636.22
	GLENCORE PLC	540,713	1.64	887,526.31
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,079	22.21	246,064.59
	MONDI PLC	20,970	15.88	333,003.60
	RIO TINTO PLC	57,215	44.92	2,570,383.87
	ASHTREAD GROUP PLC	24,840	30.44	756,129.60
	BAE SYSTEMS PLC ORD	175,515	4.31	757,698.25
	BUNZL PLC	13,836	25.46	352,264.56
	DCC PLC	5,200	51.96	270,192.00
	FERGUSON PLC	11,232	83.78	941,016.96
	MELROSE INDUSTRIES PLC	222,780	1.29	288,054.54
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	98,015	0.74	73,040.77
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-NIL-RTS	326,716	0.42	139,181.01
	SMITHS GROUP PLC	21,173	13.97	295,892.67
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	119.05	469,057.00
	EXPERIAN PLC	44,268	31.23	1,382,489.64

INTERTEK GROUP PLC	8,415	58.72	494,128.80
RELX PLC	100,565	16.77	1,686,977.87
RENTOKIL INITIAL PLC	94,500	5.71	539,595.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	5.34	217,689.12
BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	43.20	288,576.00
BURBERRY GROUP PLC	23,124	14.44	333,910.56
PERSIMMON PLC	13,570	25.73	349,156.10
TAYLOR WIMPEY PLC	207,190	1.22	253,807.75
COMPASS GROUP PLC	91,108	11.33	1,032,253.64
GVC HOLDINGS PLC	30,970	9.85	305,302.26
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,283	42.29	392,578.07
WHITBREAD PLC	10,770	23.80	256,326.00
AUTO TRADER GROUP PLC	48,880	6.00	293,671.04
INFORMA PLC	72,880	4.60	335,320.88
PEARSON PLC	44,059	5.41	238,623.54
WPP PLC	50,104	6.53	327,179.12
JD SPORTS FASHION PLC	22,530	7.52	169,425.60
KINGFISHER PLC	114,937	3.02	348,029.23
NEXT PLC	6,767	61.36	415,223.12
OCADO GROUP PLC	24,680	25.55	630,574.00
SAINSBURY (J) PLC	97,801	1.98	193,645.98
TESCO PLC	462,864	2.12	983,586.00
WM MORRISON SUPERMARKETS	129,955	1.61	210,202.21
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,905	16.81	317,887.57
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	116,837	25.00	2,920,925.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	18.23	140,227.15
DIAGEO PLC	119,042	26.58	3,164,136.36
IMPERIAL BRANDS PLC	51,242	12.37	634,119.75
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,225	70.74	2,562,556.50
UNILEVER PLC	59,477	46.68	2,776,386.36
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	45,766	14.02	641,868.15
ASTRAZENECA PLC	66,293	85.29	5,654,129.97
GLAXOSMITHKLINE PLC	252,731	14.04	3,548,343.24
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	26.36	202,708.40

	BARCLAYS PLC	881,851	1.10	971,447.06
	HSBC HOLDINGS PLC	1,037,241	3.36	3,486,685.62
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,635,236	0.27	1,007,323.89
	NATWEST GROUP PLC	302,430	1.25	378,793.57
	STANDARD CHARTERED PLC	131,430	3.66	481,953.81
	3I GROUP PLC	50,419	10.37	523,097.12
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	14.47	188,464.50
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,937	88.12	1,492,488.44
	M&G PLC	134,322	1.53	206,788.71
	SCHRODERS PLC	6,901	27.77	191,640.77
	ST JAMES'S PLACE PLC	32,650	9.38	306,257.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	2.39	297,610.11
	ADMIRAL GROUP PLC	10,865	29.18	317,040.70
	AVIVA PLC	199,265	2.71	541,801.53
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	2.77	203,962.46
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	329,201	1.94	640,295.94
	PRUDENTIAL PLC	126,302	10.47	1,322,381.94
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	6.70	369,424.60
	AVEVA GROUP PLC	3,440	41.62	143,172.80
	SAGE GROUP PLC/THE	57,710	6.60	381,116.84
	HALMA PLC	16,450	25.21	414,704.50
	BT GROUP PLC	471,052	1.02	480,473.04
	VODAFONE GROUP PLC	1,300,728	1.06	1,380,072.40
	NATIONAL GRID PLC	168,978	9.50	1,605,628.95
	SEVERN TRENT PLC	11,503	24.73	284,469.19
	SSE PLC	50,927	13.40	682,676.43
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	37,015	8.75	324,103.34
英債券小計		14,988,942		70,552,878.57 (9,602,952,302)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	16.41	124,261.55
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	460	833.00	383,180.00
	GIVAUDAN-REG	468	3,924.00	1,836,432.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	26,539	42.76	1,134,807.64
	SIKA AG-REG	7,250	243.50	1,765,375.00
	ABB LTD-REG	89,325	23.84	2,129,508.00

GEBERIT AG-REG	1,920	565.60	1,085,952.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	247.00	259,350.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,220	248.20	551,004.00	
ADECCO GROUP AG-REG	8,977	48.67	436,910.59	
SGS SA-REG	333	2,400.00	799,200.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,570	195.25	501,792.50	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	24,859	63.40	1,576,060.60	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,670	210.20	351,034.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,150	40.20	126,630.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	175	1,943.00	340,025.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	7,500.00	330,000.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	81,700.00	490,200.00	
NESTLE SA-REG	150,383	107.16	16,115,042.28	
ALCON INC	25,204	56.24	1,417,472.96	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,381	229.60	546,677.60	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	450	997.60	448,920.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,633	622.20	2,260,452.60	
NOVARTIS AG-REG	112,193	76.51	8,583,886.43	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	35,478	320.90	11,384,890.20	
VIFOR PHARMA AG	2,520	115.20	290,304.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,500	93.60	140,400.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	128,868	9.53	1,228,885.24	
JULIUS BAER GROUP LTD	11,750	44.86	527,105.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,050	933.40	980,070.00	
UBS GROUP AG-REG	187,122	11.75	2,198,683.50	
BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	135.70	337,893.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,510	341.30	515,363.00	
SWISS RE AG	15,149	71.90	1,089,213.10	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,871	324.00	2,550,204.00	
SWISS PRIME SITE-REG	4,291	78.85	338,345.35	
TEMENOS AG	3,470	106.75	370,422.50	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,070	84.80	769,136.00	
SWISSCOM AG-REG	1,514	477.60	723,086.40	
スイスフラン小計	886,483		67,038,176.04 (7,682,574,974)	

スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	10,270	180.70	1,855,789.00	
	BOLIDEN AB	14,670	257.00	3,770,190.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	32,900	127.45	4,193,105.00	
	ALFA LAVAL AB	17,850	182.30	3,254,055.00	
	ASSA ABLOY AB-B	51,380	198.95	10,222,051.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	33,225	416.40	13,834,890.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,120	361.70	6,915,704.00	
	EPIROC AB-A	38,955	146.20	5,695,221.00	
	EPIROC AB-B	15,450	140.00	2,163,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	235.00	1,598,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,840	244.90	4,124,116.00	
	SANDVIK AB	57,840	164.30	9,503,112.00	
	SKANSKA AB-B SHS	19,210	186.60	3,584,586.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	196.10	3,904,154.90	
	VOLVO AB-B SHS-B	70,800	189.15	13,391,820.00	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	137.95	2,018,070.55	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,585	210.80	2,863,718.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,170	96.70	2,433,939.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,910	701.20	4,845,292.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	37,258	154.05	5,739,594.90	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	426.60	1,804,518.00	
	SWEDISH MATCH AB	8,140	695.80	5,663,812.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	27,565	265.70	7,324,020.50	
	NORDEA BANK ABP	171,022	71.48	12,224,652.56	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	78,050	81.62	6,370,441.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	66,610	76.50	5,095,665.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,490	148.50	5,864,265.00	
	EQT AB	12,440	186.60	2,321,304.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,060	249.40	2,508,964.00	
	INVESTOR AB-B SHS	21,615	573.40	12,394,041.00	
	KINNEVIK AB - B	12,405	410.35	5,090,391.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	430.40	1,712,992.00	
ERICSSON LM-B SHS	146,815	105.10	15,430,256.50		
HEXAGON AB-B SHS	15,580	693.20	10,800,056.00		
TELE2 AB-B SHS	31,215	109.10	3,405,556.50		

	TELIA CO AB	112,830	35.27	3,979,514.10
スウェーデンクローネ小計		1,284,818		207,900,858.26 (2,474,020,213)
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	50,344	125.60	6,323,206.40
	NORSK HYDRO A S	62,840	28.73	1,805,393.20
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,470	344.40	3,261,468.00
	ADEVINTA ASA	11,400	146.60	1,671,240.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	365.00	1,876,100.00
	MOWI ASA	25,740	153.65	3,954,951.00
	ORKLA ASA	38,170	90.72	3,462,782.40
	DNB ASA	49,935	134.65	6,723,747.75
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,470	189.20	2,170,124.00
	TELENOR ASA	43,115	152.40	6,570,726.00
ノルウェークローネ小計		307,624		37,819,738.75 (426,228,455)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,350	682.60	3,651,910.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,675	399.30	4,661,827.50
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	9,950	1,152.50	11,467,375.00
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	195	9,780.00	1,907,100.00
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	338	10,550.00	3,565,900.00
	DSV PANALPINA A S	10,880	1,116.00	12,142,080.00
	PANDORA A/S	4,490	544.40	2,444,356.00
	CARLSBERG AS-B	5,350	862.40	4,613,840.00
	AMBU A/S-B	8,710	203.90	1,775,969.00
	COLOPLAST-B	5,385	950.60	5,118,981.00
	DEMANT A/S	4,410	213.30	940,653.00
	GN STORE NORD A/S	6,950	499.50	3,471,525.00
	GENMAB A/S	3,150	2,492.00	7,849,800.00
	H LUNDBECK A/S	4,200	179.70	754,740.00
	NOVO NORDISK A/S-B	86,885	451.70	39,245,954.50
	DANSKE BANK A/S	31,805	91.32	2,904,432.60
	TRYG A/S	6,075	186.30	1,131,772.50
ORSTED A/S	9,960	1,070.00	10,657,200.00	
デンマーククローネ小計		215,758		118,305,416.10 (1,944,941,040)
豪ドル	AMPOL LTD	14,105	25.30	356,856.50



OIL SEARCH LTD	77,602	2.78	215,733.56
ORIGIN ENERGY LTD	89,820	4.21	378,142.20
SANTOS LTD	94,995	4.95	470,225.25
WOODSIDE PETROLEUM LTD	52,353	18.33	959,630.49
BHP GROUP LTD	147,816	34.24	5,061,219.84
BLUESCOPE STEEL LTD	30,460	14.84	452,026.40
EVOLUTION MINING LTD	87,400	5.86	512,164.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	91,055	16.63	1,514,244.65
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	23,075	37.24	859,313.00
NEWCREST MINING LTD	41,779	29.67	1,239,582.93
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	40,200	15.45	621,090.00
ORICA LIMITED	20,325	15.48	314,631.00
RIO TINTO LTD	19,068	91.95	1,753,302.60
SOUTH32 LTD	255,347	2.08	531,121.76
CIMIC GROUP LTD	4,887	21.74	106,243.38
BRAMBLES LTD	78,698	10.22	804,293.56
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.76	276,623.20
QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.56	200,640.00
SYDNEY AIRPORT	66,676	5.93	395,388.68
TRANSURBAN GROUP	134,769	13.95	1,880,027.55
ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,900	31.91	890,289.00
CROWN RESORTS LTD	19,095	8.58	163,835.10
TABCORP HOLDINGS LTD	84,274	3.54	298,329.96
REA GROUP LTD	3,030	128.47	389,264.10
SEEK LTD	17,930	22.28	399,480.40
WESFARMERS LTD	59,585	47.69	2,841,608.65
COLES GROUP LTD	62,585	18.26	1,142,802.10
WOOLWORTHS GROUP LTD	63,272	39.15	2,477,098.80
COCA-COLA AMATIL LTD	30,530	12.60	384,678.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,246	7.96	288,518.16
COCHLEAR LTD	2,917	224.50	654,866.50
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,995	64.05	576,129.75
SONIC HEALTHCARE LTD	26,720	36.16	966,195.20
CSL LTD	22,952	301.63	6,923,011.76
AUST AND NZ BANKING GROUP	137,689	19.47	2,680,804.83

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	88,287	69.67	6,150,955.29	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	139,793	19.31	2,699,402.83	
	WESTPAC BANKING CORP	186,991	17.70	3,309,740.70	
	AMP LTD	156,627	1.67	261,567.09	
	ASX LTD	10,195	81.61	832,013.95	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,714	132.45	2,213,769.30	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	7,680	60.14	461,875.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	106,375	4.83	513,791.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	142,760	2.73	389,734.80	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	68,340	8.50	580,890.00	
	SUNCORP GROUP LTD	70,376	8.19	576,379.44	
	AFTERPAY LTD	11,530	103.25	1,190,472.50	
	COMPUTERSHARE LTD	25,050	12.80	320,640.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,500	31.09	264,265.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	231,884	2.78	644,637.52	
	TPG TELECOM LTD	21,450	7.27	155,941.50	
	AGL ENERGY LTD	35,761	12.93	462,389.73	
	APA GROUP	66,218	11.02	729,722.36	
	AUSNET SERVICES	117,310	2.03	238,139.30	
	豪ドル小計	3,603,561		61,975,740.62 (4,666,153,511)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	7.08	400,126.20	
	A2 MILK CO LTD	38,820	14.35	557,067.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,340	36.90	1,156,446.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	19,940	14.50	289,130.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.61	353,019.97	
	MERCURY NZ LTD	34,000	5.37	182,580.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	77,080	5.39	415,461.20	
	ニュージーランドドル小計	334,272		3,353,830.37 (235,505,968)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,708	52.80	7,376,582.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	76,500	114.90	8,789,850.00	
	MTR CORP	82,000	39.20	3,214,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	120,000	55.75	6,690,000.00	
	SANDS CHINA LTD	130,600	29.40	3,839,640.00	

	SJM HOLDINGS LTD	91,000	8.56	778,960.00	
	WYNN MACAU LTD	93,800	11.66	1,093,708.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	22.95	1,558,305.00	
	WH GROUP LTD	530,500	6.25	3,315,625.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	30,000	29.70	891,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	76,040	14.76	1,122,350.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	207,500	22.80	4,731,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	44,700	124.70	5,574,090.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	60,400	383.20	23,145,280.00	
	AIA GROUP LTD	610,190	80.30	48,998,257.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	127,708	38.25	4,884,831.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	20.60	1,606,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	29.45	2,146,934.45	
	KERRY PROPERTIES LTD	31,950	20.00	639,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	37.80	2,746,774.80	
	SINO LAND CO	143,050	9.40	1,344,670.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	69,980	101.90	7,130,962.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,017	37.75	1,133,141.75	
	SWIRE PROPERTIES LTD	66,000	21.60	1,425,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	33.80	2,156,440.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	214,000	9.92	2,122,880.00	
	PCCW LTD	231,000	4.76	1,099,560.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	42,000	38.40	1,612,800.00	
	CLP HOLDINGS LTD	75,500	72.90	5,503,950.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	159,500	7.92	1,263,240.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	592,655	11.40	6,756,267.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	40.65	2,235,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,800	78.10	1,390,180.00	
香港ドル小計		4,504,365		168,318,828.80 (2,250,422,741)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	89,860	4.67	419,646.20	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	86,700	3.62	313,854.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	3.47	187,033.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	352,600	0.68	239,768.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	18.25	109,500.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	120,260	4.32	519,523.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	88,615	22.43	1,987,634.45	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	167,240	8.93	1,493,453.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,500	20.44	1,195,740.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,700	9.10	361,270.00	
	CAPITALAND LTD	145,700	2.63	383,191.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.60	114,180.00	
	UOL GROUP LTD	26,150	6.44	168,406.00	
	VENTURE CORP LTD	16,600	19.94	331,004.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	470,580	2.19	1,030,570.20	
シンガポールドル小計		1,739,705		8,854,773.25	(679,338,203)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	36,890	12.10	446,369.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	390.00	468,000.00	
	BANK HAPOALIM BM	60,335	20.52	1,238,074.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	16.87	961,674.35	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,400	9.94	640,200.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	70.05	574,410.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	176.70	236,778.00	
	NICE LTD	3,355	862.70	2,894,358.50	
イスラエルシュケル小計		232,725		7,459,864.45	(228,794,042)
合 計		55,427,690		221,987,720,686	(221,987,720,686)

(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	455,252.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,530	1,034,286.70	
		AMERICAN TOWER CORP	22,369	5,366,770.48	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	450,051.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,785	1,005,808.40	

BOSTON PROPERTIES INC	8,457	632,076.18	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,330	519,461.80	
CROWN CASTLE INTL CORP	21,200	3,453,904.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,105	2,080,628.55	
DUKE REALTY CORPORATION	19,465	790,084.35	
EQUINIX INC	4,458	3,481,920.90	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,990	615,583.80	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,430	959,465.80	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,140	710,048.20	
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,100	808,690.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,945	284,434.50	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,055	804,056.30	
HOST HOTELS & RESORTS INC	39,369	430,303.17	
INVITATION HOMES INC	30,340	878,949.80	
IRON MOUNTAIN INC	11,725	322,203.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,900	599,082.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,520	684,645.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,590	288,538.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	331,898.40	
PROLOGIS INC	37,598	3,980,876.24	
PUBLIC STORAGE	8,079	1,863,502.14	
REALTY INCOME CORP	18,530	1,074,740.00	
REGENCY CENTERS CORP	6,695	242,225.10	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,620	1,718,708.40	
SIMON PROPERTY GROUP INC	15,394	977,057.18	
SUN COMMUNITIES INC	4,380	614,908.20	
UDR INC	16,160	547,016.00	
VENTAS INC	20,225	831,652.00	
VEREIT INC	64,364	424,158.76	
VICI PROPERTIES INC	21,340	514,934.20	
VORNADO REALTY TRUST	6,851	218,204.35	
WELLTOWER INC	19,850	1,128,472.50	
WEYERHAEUSER CO	36,698	1,056,902.40	
WP CAREY INC	9,580	630,843.00	
	702,197	42,812,344.30	

米ドル小計				(4,439,640,103)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	4,700	208,398.00
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,760	85,987.20
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	139,935.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	36,216.70
加ドル小計			22,650	470,536.90 (37,322,986)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	2,655	143,370.00
		GECINA SA	2,350	267,195.00
		ICADE	1,965	88,700.10
		KLEPIERRE	10,512	122,517.36
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,700	271,194.00
ユーロ小計			25,182	892,976.46 (109,371,756)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	49,131	189,645.66
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	186,439.90
		SEGRO PLC	62,233	592,458.16
英ポンド小計			145,498	968,543.72 (131,828,485)
豪ドル	投資証券	DEXUS	57,587	521,738.22
		GOODMAN GROUP	59,282	1,163,705.66
		GPT GROUP	120,435	514,257.45
		LENDLEASE GROUP	28,927	371,133.41
		MIRVAC GROUP	208,775	480,182.50
		SCENTRE GROUP	218,771	520,674.98
		STOCKLAND	96,900	421,515.00
		VICINITY CENTRES	191,002	265,492.78
豪ドル小計			981,679	4,258,700.00 (320,637,523)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	101,800	6,250,520.00
香港ドル小計			101,800	6,250,520.00 (83,569,452)
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	160,312	514,601.52
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	249,428	471,418.92
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,400	231,874.00

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	136,800	288,648.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST-R-RTS	2,599	311.88	
	SUNTEC REIT	91,400	128,874.00	
シンガポールドドル小計		761,939	1,635,728.32 (125,493,076)	
	合計		5,247,863,381 (5,247,863,381)	

(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%		70.6%
	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 240銘柄	99.5%		10.4%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 85銘柄	98.6%		4.2%
	投資証券 3銘柄		1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.4%
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%		0.9%
豪ドル	株式 55銘柄	93.6%		2.1%
	投資証券 8銘柄		6.4%	0.1%
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	96.4%		1.0%
	投資証券 1銘柄		3.6%	0.0%
シンガポールドドル	株式 15銘柄	84.4%		0.3%
	投資証券 6銘柄		15.6%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 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11月 6日現在	2020年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	60,850,776	85,551,647
国債証券	32,055,271,267	33,376,926,138
地方債証券	3,161,772,000	3,356,957,000
特殊債券	3,461,736,000	4,509,028,000
社債券	2,750,637,000	2,433,657,584
未収利息	90,239,114	94,079,545
前払費用	2,211,474	1,010,091
流動資産合計	41,582,717,631	43,857,210,005
資産合計	41,582,717,631	43,857,210,005
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	42,305,900	-
未払解約金	9,613,484	65,496,104
未払利息	33	59
流動負債合計	51,919,417	65,496,163
負債合計	51,919,417	65,496,163
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	29,082,509,839	30,950,687,612
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,448,288,375	12,841,026,230
元本等合計	41,530,798,214	43,791,713,842
純資産合計	41,530,798,214	43,791,713,842
負債純資産合計	41,582,717,631	43,857,210,005

## 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。
-----------------	--



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

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
1.	期首	2018年11月 7日	2019年11月 7日
	期首元本額	27,717,750,995円	29,082,509,839円
	期首からの追加設定元本額	3,602,070,698円	6,157,737,938円
	期首からの一部解約元本額	2,237,311,854円	4,289,560,165円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	2,581,135,782円	3,316,182,665円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,359,105,762円	2,937,621,572円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,707,355,366円	2,060,335,630円
	DCインデックスバランス（株式80）	264,743,804円	315,604,302円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,961,614,809円	2,134,845,421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	3,616,810,930円	3,488,595,537円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,528,015,066円	1,593,046,655円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,328,632円	4,546,069円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	25,139,548円	24,342,419円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	103,120,055円	96,411,222円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	273,499,884円	252,398,632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	4,090,395,680円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,319,530,163円	1,382,028,729円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,282,950,890円	1,312,918,382円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	685,055,821円	714,291,650円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	99,244,443円	101,570,081円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,686,660,099円	6,809,834,414円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	303,459,608円	315,718,552円
	計	29,082,509,839円	30,950,687,612円

2. 受益権の総数	29,082,509,839口	30,950,687,612口
-----------	-----------------	-----------------

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2019年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	99,485,861
地方債証券	5,000,000
特殊債券	4,916,000
社債券	2,413,000
合計	111,814,861

（2020年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	52,169,736
地方債証券	112,000
特殊債券	247,000
社債券	156,854
合計	51,653,882

(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11月 6日現在		2020年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.4280円	1口当たり純資産額	1.4149円
(1万口当たり純資産額)	(14,280円)	(1万口当たり純資産額)	(14,149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	102,625,600	
	第2回利付国債(40年)	95,000,000	135,111,850	
	第3回利付国債(40年)	70,000,000	99,953,000	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	136,309,800	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	48,638,450	
	第6回利付国債(40年)	70,000,000	95,958,800	
	第7回利付国債(40年)	50,000,000	66,021,500	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	117,317,400	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	120,136,900	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	135,383,750	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	147,197,400	
	第12回利付国債(40年)	175,000,000	166,428,500	
	第13回利付国債(40年)	80,000,000	76,000,800	
	第313回利付国債(10年)	320,000,000	321,778,564	
	第317回利付国債(10年)	105,000,000	106,146,926	
	第318回利付国債(10年)	185,000,000	186,860,100	
	第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,068,750	
	第320回利付国債(10年)	190,000,000	192,401,600	
	第321回利付国債(10年)	175,000,000	177,716,000	
	第322回利付国債(10年)	75,000,000	76,061,250	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	45,759,150		

第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,381,250	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	213,706,500	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,540,300	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	66,308,450	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	117,027,450	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	235,694,800	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	215,735,100	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,724,800	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	215,243,700	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	123,222,000	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	502,176,500	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,100,000	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,539,400	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	399,145,500	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	379,094,600	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	430,680,600	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	715,302,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,541,800	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	248,042,900	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,649,500	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	618,259,400	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	496,904,100	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	162,291,200	
第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,338,300	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	497,374,500	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	487,113,600	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	441,333,600	
第352回利付国債(10年)	390,000,000	395,553,600	
第353回利付国債(10年)	200,000,000	202,772,000	
第354回利付国債(10年)	125,000,000	126,680,000	
第355回利付国債(10年)	150,000,000	151,879,500	
第356回利付国債(10年)	200,000,000	202,400,000	
第357回利付国債(10年)	820,000,000	828,979,000	
第358回利付国債(10年)	510,000,000	515,253,000	
第359回利付国債(10年)	100,000,000	100,912,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	62,519,000	

第14回利付国債(30年)	108,000,000	139,732,560	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	192,819,900	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	46,044,950	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	142,441,200	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,103,400	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	53,549,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	73,814,400	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	91,553,840	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,370,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	227,441,300	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,462,040	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	128,651,220	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	238,865,440	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	197,812,020	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	160,131,600	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	67,923,000	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	176,532,750	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	270,316,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	221,250,960	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	178,380,900	
第37回利付国債(30年)	131,000,000	170,848,890	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	122,295,400	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	98,327,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	116,149,500	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	50,840,000	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	171,757,800	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	197,404,900	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	191,227,500	
第45回利付国債(30年)	160,000,000	196,971,200	
第46回利付国債(30年)	250,000,000	307,962,500	
第47回利付国債(30年)	165,000,000	207,271,350	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	102,826,200	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	108,921,600	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	26,687,750	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	66,294,200	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	89,385,300	

第53回利付国債(30年)	105,000,000	106,685,250	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	117,003,700	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	116,925,600	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	53,112,000	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	106,148,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	106,071,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	175,900,700	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	130,147,200	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	72,204,300	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	117,375,600	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	85,500,000	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	94,846,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	104,160,100	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	170,163,000	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	109,586,400	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	238,896,276	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	39,525,772	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	15,390,150	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	67,926,540	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	53,717,040	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	140,169,150	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	34,293,600	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	304,687,800	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	27,734,940	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	32,580,070	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	57,174,660	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	106,376,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,061,760	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	36,340,560	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	84,158,880	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	113,586,720	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	121,720,480	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	122,950,780	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	128,878,420	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,977,500	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	22,868,790	

第77回利付国債(20年)	40,000,000	43,734,800	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	175,768,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	66,499,200	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	146,266,900	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	341,010,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,191,680	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	285,722,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	68,201,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	68,150,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	57,112,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	95,160,180	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	112,422,660	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	52,188,300	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	108,365,080	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	135,486,000	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,102,100	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	78,202,740	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	96,455,610	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,014,650	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	38,538,060	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	90,246,310	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,359,880	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	153,015,200	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	155,536,480	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,445,820	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	115,783,080	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,851,500	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	94,833,600	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	345,044,900	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	62,063,560	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	150,332,500	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	66,386,100	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	410,793,950	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,916,400	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,172,900	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	196,047,400	



第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,084,080	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	19,988,430	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	235,813,500	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	227,849,900	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	61,173,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	126,295,050	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	77,732,850	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	100,753,050	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	178,168,500	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,123,880	
第132回利付国債(20年)	75,000,000	88,479,750	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,722,500	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,680,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,470,500	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	257,642,000	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	237,000,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	139,442,400	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	269,907,300	
第140回利付国債(20年)	448,000,000	532,035,840	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	232,059,750	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	150,250,000	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	110,941,620	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	502,265,800	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	424,150,450	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	161,609,850	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,187,600	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	105,773,400	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	135,346,950	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	104,850,900	
第151回利付国債(20年)	70,000,000	79,716,700	
第152回利付国債(20年)	350,000,000	398,853,000	
第153回利付国債(20年)	450,000,000	519,529,500	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	182,566,400	
第155回利付国債(20年)	250,000,000	278,112,500	
第156回利付国債(20年)	110,000,000	112,439,800	
第157回利付国債(20年)	50,000,000	49,512,500	

	第158回利付国債(20年)	170,000,000	176,080,900	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	157,642,500	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	149,314,200	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	125,994,000	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	73,429,300	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	172,915,050	
	第164回利付国債(20年)	285,000,000	293,675,400	
	第165回利付国債(20年)	60,000,000	61,749,000	
	第166回利付国債(20年)	100,000,000	106,241,000	
	第167回利付国債(20年)	160,000,000	164,227,200	
	第168回利付国債(20年)	100,000,000	100,775,000	
	第169回利付国債(20年)	160,000,000	158,187,200	
	第170回利付国債(20年)	140,000,000	138,271,000	
	第171回利付国債(20年)	170,000,000	167,725,400	
	第172回利付国債(20年)	230,000,000	230,828,000	
	第173回利付国債(20年)	150,000,000	150,409,500	
国債証券 合計		30,240,000,000	33,376,926,138	
地方債証券	第708回東京都公募公債	100,000,000	101,416,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	101,238,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	202,824,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	102,182,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,084,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	202,898,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	204,424,000	
	平成26年度第12回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,988,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,519,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,870,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	200,000,000	204,650,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	101,485,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,783,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,996,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	102,301,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	102,117,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	101,523,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,179,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	102,296,000	

	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	204,566,000	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,213,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,009,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,039,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	100,027,000	
	平成25年度第2回福井県公募公債	200,000,000	203,944,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	101,386,000	
	地方債証券 合計	3,300,000,000	3,356,957,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,523,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,380,000	
	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,891,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,469,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,706,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,269,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,608,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,158,000	
	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	101,452,000	
	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	99,975,000	
	第17回道路債券	100,000,000	103,210,000	
	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	114,468,000	
	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	116,008,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,900,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,264,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,632,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,200,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,803,000	
	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	101,108,000	
	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	102,362,000	
	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	201,172,000	

	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	100,992,000	
	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,117,000	
	第13回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,849,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,586,000	
	F63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,169,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,616,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,810,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,977,000	
	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	101,487,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,884,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,228,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,327,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,206,000	
	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		4,400,000,000	4,509,028,000	
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	102,280,000	
	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	102,403,000	
	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	200,852,000	
	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	200,346,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,400,000	
	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	101,289,000	
	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	99,916,000	
	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	101,452,000	
	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	103,113,000	
	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	105,649,000	
	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	203,112,000	

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	102,265,000	
第11回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,242,000	
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	202,188,000	
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	99,824,000	
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	101,437,000	
第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,056,000	
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	201,840,584	
社債券 合計	2,400,000,000	2,433,657,584	
合計	40,340,000,000	43,676,568,722	

## 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11月6日現在	2020年11月6日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	973,316,910	101,245,794
コール・ローン	108,974,090	82,145,228
国債証券	153,202,979,354	151,146,024,706
派生商品評価勘定	49	-
未収入金	1,323,670,238	-
未収利息	1,163,080,368	975,927,211
前払費用	24,183,944	25,312,852
流動資産合計	156,796,204,953	152,330,655,791

資産合計	156,796,204,953	152,330,655,791
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	24,791
未払金	1,951,776,714	31,167,517
未払解約金	78,195,310	83,200,031
未払利息	59	56
流動負債合計	2,029,972,083	114,392,395
負債合計	2,029,972,083	114,392,395
純資産の部		
元本等		
元本	66,109,940,367	62,261,620,781
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	88,656,292,503	89,954,642,615
元本等合計	154,766,232,870	152,216,263,396
純資産合計	154,766,232,870	152,216,263,396
負債純資産合計	156,796,204,953	152,330,655,791

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
1.	期首	2018年11月 7日	2019年11月 7日
	期首元本額	66,186,471,666円	66,109,940,367円
	期首からの追加設定元本額	2,787,676,829円	7,395,350,288円

期首からの一部解約元本額	2,864,208,128円	11,243,669,874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)	12,722,484,813円	13,675,807,907円
DCインデックスバランス(株式20)	243,150,997円	295,093,711円
DCインデックスバランス(株式40)	320,858,961円	376,111,949円
DCインデックスバランス(株式60)	418,393,550円	474,657,419円
DCインデックスバランス(株式80)	324,789,751円	363,175,635円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,778,254,264円	22,033,058,132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	2,265,552,164円	2,007,884,611円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	17,528,361,096円	15,811,534,905円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	889,412,344円	1,006,798,808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)	2,677,723円	2,599,441円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,073,745円	2,810,203円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,985,542円	6,167,512円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	12,955,389円	11,212,682円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	857,949,169円	792,797,616円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	896,266,419円	782,118,041円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	61,966,468円	61,424,959円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	87,293,527円	84,106,678円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	84,281,427円	82,193,886円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	61,191,546円	58,416,254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	4,119,195,200円	3,903,607,480円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	267,273,437円	279,434,306円
計	66,109,940,367円	62,261,620,781円
2. 受益権の総数	66,109,940,367口	62,261,620,781口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)



種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	768,286,961
合計	768,286,961

(2020年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	865,881,536
合計	865,881,536

(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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	27,159,750	-	27,159,799	49
	米ドル	27,159,750	-	27,159,799	49
	売建	27,159,750	-	27,159,750	-
	ユーロ	27,159,750	-	27,159,750	-
合計		54,319,500	-	54,319,549	49

(2020年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	15,530,169	-	15,554,960	24,791
	ユーロ	15,530,169	-	15,554,960	24,791

合計	15,530,169	-	15,554,960	24,791
----	------------	---	------------	--------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2019年11月 6日現在		2020年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.3410円	1口当たり純資産額	2.4448円
(1万口当たり純資産額)	(23,410円)	(1万口当たり純資産額)	(24,448円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,900,697.97	
		US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	2,022,073.00	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	9,995,339.10	

US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,076,977.60	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	610,377.18	
US TREASURY N/B-1.5%-21/11/30	3,370,000.00	3,419,332.75	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,191,235.84	
US TREASURY N/B-2.5%-22/01/15	5,000,000.00	5,140,625.00	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	4,840,000.00	4,921,580.13	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,559,814.25	
US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,120,624.80	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,553,076.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/02/28	2,000,000.00	2,045,742.00	
US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,060,546.80	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,840,605.30	
US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,060,742.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,071,601.30	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,897,745.88	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,049,179.60	
US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	1,200,000.00	1,236,234.36	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,512,647.11	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,077,226.30	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,581,396.25	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/30	2,500,000.00	2,566,064.25	
US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,108,359.20	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	4,055,805.98	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	5,700,000.00	5,870,443.11	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	4,500,000.00	4,618,212.75	
US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,600,000.00	2,662,511.54	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,959,486.15	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	2,750,000.00	2,823,637.57	
US TREASURY N/B-1.5%-22/09/15	1,950,000.00	1,998,750.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,657,955.85	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,410,000.00	2,488,748.43	
US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	3,070,898.40	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,102,538.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,487,843.60	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,059,531.20	

US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,540,006.25	
US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,103,431.14	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	4,064,911.89	
US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,088,359.30	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,071,093.60	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,658,321.07	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,396,222.57	
US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,541,425.65	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,196,027.15	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	930,118.72	
US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,016,093.60	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,064,140.60	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,249,396.29	
US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,507,519.40	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,202,050.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,830,625.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,755,792.77	
US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,967,041.61	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,555,956.90	
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,385,820.28	
US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,504,931.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,547,753.85	
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,064,804.60	
US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,676,126.56	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,088,007.70	
US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,210,585.90	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,642,015.36	
US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	860,000.00	858,723.43	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,912,220.68	
US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,994,609.36	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,586,523.25	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	711,381.99	
US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,397,429.68	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,773,113.26	
US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	972,035.10	

US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,309,374.80	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,839,125.00	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,958,547.24	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,129,062.40	
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,228,515.40	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,132,343.60	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,706,834.31	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,574,956.99	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,595,097.60	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,746,901.48	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,514,771.50	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,123,671.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,211,523.40	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,650,400.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,114,595.99	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,448,331.83	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,807,338.99	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,720,000.00	2,911,568.51	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	3,820,000.00	4,034,725.63	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,992,306.85	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,508,306.25	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,388,271.47	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,574,843.60	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,307,250.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,176,178.12	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,952,091.76	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,750,000.00	4,049,560.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,505,601.44	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	4,000,000.00	4,200,937.20	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	2,055,859.28	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	3,300,000.00	3,502,253.70	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,640,566.35	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,770,000.00	3,944,951.37	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,334,013.23	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,277,989.81	

US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,140,000.00	1,181,458.49	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,849,280.92	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,584,657.36	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,452,913.98	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,157,894.37	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,194,874.88	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,284,181.54	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	2,015,660.13	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,000,000.00	1,112,773.40	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,613,250.00	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,990,976.57	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,419,834.96	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,348,398.40	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,310,632.46	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,584,078.02	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,628,300.00	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,487,732.79	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,231,953.00	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	2,067,158.18	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,330,437.50	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	2,000,000.00	2,131,250.00	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,990,885.43	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,277,080.73	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,215,781.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	5,180,000.00	5,528,233.27	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	3,120,000.00	3,416,156.01	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,163,750.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	3,990,000.00	4,318,707.37	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,244,843.60	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,731,817.90	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,620,064.30	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,504,821.56	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	3,070,563.63	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,156,015.60	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,125,781.20	

US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	5,327,624.64	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	1,039,609.30	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,219,736.62	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	999,609.38	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,955,530.20	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,598,500.00	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,500,000.00	3,494,873.06	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,979,531.24	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	3,299,821.61	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	460,000.00	458,706.25	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,966,462.50	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,373,906.25	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,620,156.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,768,607.44	
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	686,562.50	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,919,578.02	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,459,170.66	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,387,864.28	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,372,890.60	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,970,000.00	5,756,657.56	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,425,928.02	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,850,000.00	4,156,796.87	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	4,480,000.00	4,890,899.77	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,640,409.15	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,602,546.05	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	6,590,000.00	6,511,743.75	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	1,500,000.00	1,478,789.07	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	962,414.04	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	1,195,343.68	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,199,179.65	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	1,017,562.50	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	220,000.00	339,315.61	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	1,109,093.68	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	2,196,523.36	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	2,217,252.32	

US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,157,343.75	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	1,081,571.82	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,465,617.92	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,590,156.25	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	2,105,493.69	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,549,245.26	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,444,179.65	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,360,734.37	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,392,149.95	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	669,121.05	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	1,012,531.20	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,529,843.60	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,680,156.20	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,647,302.55	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	2,020,000.00	2,913,692.03	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	3,072,300.00	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	2,680,000.00	3,876,473.40	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	3,352,406.16	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,896,536.97	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	3,041,210.88	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	4,019,167.68	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	4,239,000.00	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,400,000.00	4,418,804.56	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	5,183,495.85	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,418,187.36	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	3,053,808.50	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,510,964.79	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,613,125.00	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,743,468.68	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,587,012.50	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,566,093.60	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,646,959.30	
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,691,982.25	
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	3,294,937.44	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	5,517,222.40	



		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	4,238,665.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	4,451,390.46	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,961,054.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	3,455,187.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,727,386.68	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	4,116,250.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,450,000.00	1,348,386.72	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	2,466,597.64	
	米ドル小計		569,420,000.00	633,068,101.15 (65,649,162,089)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-21/11/01	960,000.00	970,300.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/02/01	690,000.00	701,267.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,210,000.00	1,214,961.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/05/01	960,000.00	978,480.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,019,062.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/08/01	810,000.00	810,445.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,691,000.00	1,714,792.37	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/11/01	1,440,000.00	1,440,446.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,286,974.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,052,752.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,542,147.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	841,587.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,208,076.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	1,145,000.00	1,197,189.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	860,000.00	893,849.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	1,031,804.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,178,704.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,120,000.00	1,187,188.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	550,515.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	860,000.00	890,942.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	917,000.00	1,020,336.73	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	820,000.00	1,176,544.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	770,395.48	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	2,324,780.64	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,254,508.50	

		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	750,000.00	1,225,365.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	935,000.00	1,451,877.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,145,000.00	1,740,102.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	995,000.00	1,370,911.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	1,468,000.00	1,772,565.96	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	511,920.20	
加ドル小計			33,843,000.00	38,330,796.68	(3,040,398,792)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	15,500,000.00	15,984,061.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	20,700,000.00	21,377,519.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	13,100,000.00	13,767,111.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,900,000.00	18,545,726.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	16,100,000.00	17,913,421.89	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	18,100,000.00	21,527,164.41	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	13,150,000.00	13,485,327.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,800,000.00	23,116,036.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	20,370,000.00	24,092,973.97	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	10,500,000.00	11,863,905.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,800,000.00	7,642,122.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	5,600,000.00	7,494,305.84	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,150,000.00	14,391,687.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	13,700,000.00	15,065,378.99	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	11,870,000.00	13,354,417.09			
メキシコペソ小計			215,340,000.00	239,621,160.73	(1,198,105,803)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	930,000.00	991,394.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,050,000.00	1,150,242.13	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,010,000.00	1,090,531.34	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	550,000.00	565,492.78	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,050,000.00	1,178,993.86	

BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	890,000.00	934,079.20
BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,145,000.00	1,226,320.19
BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	770,000.00	988,624.40
BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,129,833.60
BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	860,000.00	940,917.40
BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	50,000.00	52,004.15
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,375,000.00	2,004,464.82
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,065,890.75
BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,070,000.00	1,199,753.55
BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	960,000.00	1,008,211.77
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,030,000.00	1,179,975.10
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	991,290.10
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	1,115,000.00	1,330,351.10
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	953,000.00	1,374,983.63
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,445,000.00	2,537,989.33
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	531,285.27
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	945,000.00	1,264,383.54
BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	350,258.66
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,150,000.00	2,112,570.70
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	640,000.00	1,185,612.80
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	1,035,756.95
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	628,612.42
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	569,331.07
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	666,701.51
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/10/31	700,000.00	704,206.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,790,000.00	1,931,499.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,430,000.00	1,451,081.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,420,000.00	1,449,472.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,425,000.00	1,616,266.35
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 23/04/30	1,213,000.00	1,229,769.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-	1,290,000.00	1,321,761.09

23/07/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,540,000.00	1,768,942.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,560,611.89	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,340,000.00	1,543,095.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	1,090,000.00	1,121,146.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,720,000.00	1,943,967.22	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 25/01/31	1,030,000.00	1,049,389.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,450,000.00	1,583,675.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,630,000.00	2,024,592.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,745,000.00	1,969,141.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,535,000.00	1,731,149.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,490,000.00	2,027,876.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	2,040,000.00	2,239,928.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,645,688.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,260,000.00	1,346,152.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,725,000.00	1,923,697.57	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,890,000.00	2,110,597.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,550,000.00	1,735,068.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,155,000.00	1,641,554.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,900,000.00	2,854,385.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	2,210,000.00	2,492,760.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-	1,470,000.00	1,551,435.06	

29/10/31		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,900,000.00	1,984,702.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,660,000.00	1,966,716.54
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,600,000.00	1,784,356.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,801,325.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,450,000.00	1,826,753.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,345,000.00	1,624,107.67
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,500,000.00	2,388,142.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,410,000.00	2,548,843.74
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%- 40/10/31	530,000.00	585,464.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,800,000.00	3,223,395.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	940,000.00	1,854,644.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,320,000.00	1,972,775.77
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	985,000.00	1,440,983.09
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 50/10/31	900,000.00	925,425.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	735,000.00	1,335,424.44
BUNDESobligation-0.0%-22/04/08	1,000,000.00	1,011,023.50
BUNDESobligation-0.0%-22/10/07	1,000,000.00	1,015,382.00
BUNDESobligation-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,785,549.50
BUNDESobligation-0.0%-23/10/13	2,800,000.00	2,869,762.00
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,000,000.00	1,028,901.00
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,000,000.00	1,033,308.50
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	3,000,000.00	3,111,147.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,065,100.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-	2,370,000.00	2,470,355.28

22/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,667,746.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,001,344.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,822,001.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	1,997,210.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	969,734.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,335,899.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,113,361.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,959,241.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,873,109.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,766,707.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,956,939.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,720,000.00	2,850,744.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,695,982.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,695,626.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,340,000.00	2,549,625.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,150,000.00	1,212,767.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,694,495.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,845,000.00	2,020,324.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,170,000.00	1,680,968.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,803,806.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-	2,160,000.00	2,340,272.08	

29/02/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,370,000.00	1,457,170.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,126,735.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,110,000.00	1,181,167.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	420,000.00	448,069.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,830,793.48
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,265,000.00	2,219,947.74
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	170,000.00	181,423.62
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,730,000.00	3,036,272.83
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	2,363,198.43
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,330,000.00	2,743,574.54
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,740,896.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	3,105,000.00	5,280,657.97
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,732,000.00	4,778,186.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	2,925,564.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,180,000.00	1,263,796.52
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/09/16	3,000,000.00	3,044,361.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	1,370,000.00	1,381,122.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,090,897.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	1,695,000.00	1,816,602.69
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,421,502.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	994,676.80

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	1,100,000.00	1,125,857.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,298,686.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,700,000.00	1,881,985.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,354,998.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,233,147.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 23/01/15	500,000.00	504,405.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	936,983.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,236,028.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,529,315.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 23/06/15	1,000,000.00	1,024,143.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,936,572.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,310,000.00	1,413,686.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,160,000.00	1,191,512.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	1,098,248.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,907,237.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,151,803.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,360,000.00	1,454,357.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,450,000.00	1,664,534.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,350,000.00	1,435,216.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,480,000.00	1,636,499.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,560,000.00	1,588,087.80	



BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,876,849.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	1,175,000.00	1,252,765.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,497,578.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	800,000.00	868,701.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,460,318.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,480,000.00	1,626,719.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	290,000.00	296,165.11
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,730,000.00	2,132,847.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,330,828.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,354,417.03
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,280,000.00	1,818,483.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,640,000.00	1,745,988.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,000,000.00	1,038,526.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,306,449.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,395,000.00	1,559,261.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	340,000.00	354,467.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,060,000.00	2,935,022.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,950,000.00	2,180,887.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,772,588.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,855,000.00	2,203,871.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,755,000.00	2,132,274.10

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,050,000.00	2,902,579.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,800,000.00	2,283,213.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,700,000.00	1,824,424.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,100,000.00	1,138,102.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,145,000.00	1,258,714.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,230,000.00	3,431,294.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,685,000.00	1,854,750.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,738,862.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	1,358,812.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	2,408,780.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	1,150,000.00	1,517,223.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	700,000.00	744,339.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	1,060,852.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,260,000.00	3,233,727.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,548,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	3,038,066.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	310,000.00	409,192.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,720,000.00	2,849,597.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	904,163.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,145,000.00	1,928,461.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	1,562,981.28	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,623,073.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,525,000.00	2,212,744.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	785,000.00	1,222,480.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	1,180,000.00	1,448,984.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	600,000.00	625,488.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	900,940.84	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	365,000.00	381,461.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	580,816.50	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	255,540.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	570,102.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	600,000.00	617,382.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	520,495.37	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	345,235.87	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	570,481.20	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	372,114.89	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	479,739.36	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	293,354.73	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	502,548.62	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	383,069.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	435,530.77	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	495,000.00	520,566.50	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	50,000.00	53,537.70	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	570,167.27	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	359,695.44	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	3,976,633.70	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-22/05/25	2,310,000.00	2,336,352.48	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,913,633.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	2,980,000.00	3,034,144.80	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,181,289.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,363,731.52	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,520,851.92	

FRANCE (GOVT OF) -0.0%-24/03/25	2,090,000.00	2,143,021.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,478,178.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,052,788.20	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-25/03/25	1,665,000.00	1,717,017.93	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,756,290.50	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,980,000.00	3,991,262.10	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,526,078.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,863,075.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,784,333.74	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	2,000,000.00	2,130,512.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	2,700,000.00	2,846,118.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	2,590,000.00	2,867,596.20	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,230,000.00	3,999,683.16	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,155,356.06	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	2,760,000.00	3,046,725.36	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,174,236.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	1,870,000.00	2,030,201.21	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,400,000.00	2,497,125.60	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,020,000.00	3,882,176.78	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	330,000.00	342,351.33	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,295,000.00	3,952,474.41	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,640,000.00	4,597,324.77	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	4,160,000.00	4,987,311.68	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,885,000.00	4,984,085.61	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,825,000.00	3,426,160.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,320,000.00	4,026,023.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,710,000.00	3,607,972.85	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,801,766.70	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,530,000.00	2,668,687.20	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,660,000.00	2,446,449.40	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,790,000.00	2,411,899.70	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,120,000.00	1,262,106.72	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,458,220.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,050,000.00	2,449,353.26	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	1,288,758.90	

IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	489,594.24	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	65,000.00	65,875.92	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	540,000.00	599,092.20	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	590,000.00	671,597.00	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	840,000.00	1,064,098.56	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	905,000.00	985,640.02	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	512,965.32	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	678,345.73	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	770,000.00	869,399.30	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	675,000.00	853,844.62	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	770,000.00	901,730.06	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	421,208.92	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	460,000.00	491,516.90	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	499,584.93	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	562,000.00	804,190.52	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	356,000.00	474,314.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	950,000.00	958,464.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,270,000.00	1,335,053.21	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	390,407.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	760,000.00	899,100.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,050,000.00	1,122,057.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	1,345,000.00	1,378,259.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,250,000.00	1,379,443.62	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,336,242.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,279,836.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	695,000.00	725,221.38	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,345,506.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	925,000.00	1,345,382.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	906,000.00	1,006,062.26	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	765,000.00	822,833.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	730,000.00	1,001,140.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,987,120.19	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	973,000.00	1,121,672.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,225,000.00	2,308,163.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,273,000.00	2,297,255.80	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	355,000.00	371,064.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	265,638.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	875,560.71	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	739,530.73	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-22/09/20	355,000.00	360,172.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,020,742.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	438,049.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	581,802.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	970,000.00	1,042,873.19	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	570,292.47	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	937,221.07	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	670,000.00	735,019.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	913,181.22	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	760,000.00	825,510.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	736,843.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	1,001,018.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	620,000.00	681,900.18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	592,960.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	620,000.00	647,205.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	780,867.33	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,125,000.00	1,940,681.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	110,000.00	111,389.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	634,000.00	1,124,170.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	603,000.00	841,323.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	305,000.00	367,639.37	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	722,097.62	
		ユーロ小計	414,710,000.00	510,659,905.28 (62,545,625,198)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	575,000.00	819,432.50	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,159,518.80	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,670,000.00	1,725,439.99	
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,570,000.00	1,575,887.50	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,410,000.00	1,503,622.30	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,580,000.00	1,639,559.68	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	970,253.63	

UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,592,980.09	
UK TREASURY-0.625%-25/06/07	1,828,000.00	1,884,867.98	
UK TREASURY-0.125%-26/01/30	1,110,000.00	1,116,793.20	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,150,000.00	1,250,306.68	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,370,000.00	1,480,134.30	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,180,608.52	
UK TREASURY-0.125%-28/01/31	650,000.00	650,481.11	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,250,000.00	1,400,813.00	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	900,000.00	1,323,503.28	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	1,471,000.00	1,560,860.44	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,000,000.00	1,011,409.10	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,558,816.65	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,975,677.00	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,461,709.01	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	80,000.00	80,511.89	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	2,115,409.05	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,689,569.00	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,345,000.00	2,294,994.48	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	2,027,563.68	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,135,000.00	1,889,424.28	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	445,000.00	488,303.03	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,490,788.67	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,541,239.55	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,782,521.00	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,375,000.00	2,496,532.50	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,520,000.00	1,777,412.00	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	620,000.00	770,143.91	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,045,000.00	1,985,865.75	
UK TREASURY-0.625%-50/10/22	285,000.00	271,787.97	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,252,000.00	2,298,352.74	
UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	793,217.87	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,370,000.00	2,832,201.00	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,415,055.39	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,100,000.00	2,318,138.90	
UK TREASURY-0.5%-61/10/22	370,000.00	339,802.37	

		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,160,000.00	2,461,275.00	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,735,000.00	1,751,586.60	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,662,228.75	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	973,236.88	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,242,000.00	2,078,084.96	
英ポンド小計			54,277,000.00	73,467,921.98	(9,999,718,860)
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	8,014,528.85	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,260,000.00	6,619,749.68	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,220,000.00	5,906,146.03	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,900,000.00	5,282,980.08	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	4,236,127.73	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,754,777.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	5,385,000.00	8,484,865.55	
スウェーデンクローナ小計			35,815,000.00	41,299,175.67	(491,460,190)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,670,000.00	5,922,889.93	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,731,146.84	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,720,000.00	2,881,388.48	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,650,000.00	2,798,665.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	3,056,634.06	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	3,021,946.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	3,027,222.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	3,134,419.25	
ノルウェークローネ小計			26,680,000.00	28,574,311.76	(322,032,493)
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	5,589,225.18	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-22/11/15	3,350,000.00	3,413,055.71	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	5,340,000.00	5,696,525.10	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,960,000.00	6,691,027.37	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,360,000.00	4,700,925.84	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,750,000.00	1,914,517.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,780,000.00	22,743,080.56	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	900,000.00	990,684.00	
			38,830,000.00	51,739,041.26	



デンマーククローネ小計				(850,589,838)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,810,000.00	2,903,306.05
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-22/07/25	2,200,000.00	2,200,151.13
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,720,000.00	1,906,284.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,215,080.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,970,000.00	2,203,839.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,290,000.00	2,481,810.40
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,430,000.00	2,630,596.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	800,000.00	814,889.76
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,890,000.00	3,285,034.10
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,300,000.00	3,662,868.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,340,000.00	2,609,006.40
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,567,088.80
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	655,000.00	917,032.75
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	3,340,000.00	3,824,099.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	750,000.00	756,375.00
ポーランドズロチ小計			31,855,000.00	34,977,462.09 (945,790,574)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,375,000.00	1,404,819.35
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,650,000.00	1,807,603.38
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,860,000.00	1,941,351.56
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,470,000.00	2,795,972.81
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,330,000.00	2,540,296.71
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	2,095,000.00	2,102,069.77
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,310,000.00	2,622,658.96
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,550,000.00	1,550,092.84
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,400,000.00	2,916,216.48
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,960,000.00	1,980,194.27
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,170,000.00	2,777,016.92
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,040,000.00	2,368,659.50
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,200,000.00	2,487,318.45
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	2,150,000.00	2,523,181.30
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,210,000.00	2,695,060.52
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	2,220,000.00	2,629,526.73
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	2,390,000.00	2,788,601.81

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	2,000,000.00	2,050,524.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,348,000.00	1,447,810.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,500,000.00	1,530,115.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,650,971.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,477,696.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	651,258.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	850,000.00	1,169,962.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	864,728.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	500,000.00	611,522.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	1,060,000.00	1,365,306.92	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,120,000.00	1,125,698.22	
豪ドル小計			47,565,000.00	53,876,237.98	(4,056,341,957)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	450,000.00	459,622.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	525,000.00	552,454.87	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	460,000.00	475,410.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	580,806.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	190,000.00	200,450.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	594,702.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	360,000.00	392,148.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	400,000.00	435,800.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	560,000.00	660,800.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	365,000.00	416,647.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	588,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	485,000.00	580,595.92	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	576,052.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	421,000.00	493,605.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	161,712.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	317,000.00	417,172.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	490,000.00	675,465.00	
SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	330,000.00	403,456.35			
シンガポールドドル小計			7,516,000.00	8,665,651.80	(664,828,806)
マレーシ アリン	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	867,023.97	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	830,000.00	853,071.17	

ギット	MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	787,290.08		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	658,129.53		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	840,200.04		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	475,000.00	499,225.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	891,835.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	343,419.04		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,062,565.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	846,534.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	750,000.00	816,000.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,199,330.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,520,000.00	1,656,800.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	100,000.00	99,474.11		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	814,782.99		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,185,800.00		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	671,759.70		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,040,000.00	1,213,680.05		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	700,863.53		
	MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	910,000.00	944,197.34		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	658,760.16		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	812,569.10		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	909,419.87		
	MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	400,000.00	411,158.88		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	874,238.17		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,330,000.00	1,380,207.56		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	1,011,440.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,070,000.00	1,187,702.35		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	490,025.47		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	1,011,512.50		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	700,000.00	754,599.96		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	1,042,153.29		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,159,155.39		
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	1,059,324.92		
マレーシアリングット小計		27,360,000.00	29,714,248.17	(744,341,916)	
イスラエ	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-22/01/31	1,300,000.00	1,387,565.66	

ルシケル	ISRAEL FIXED BOND-0.75%-22/07/31	1,080,000.00	1,092,351.20	
	ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,022,853.40	
	ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,140,000.00	1,250,618.30	
	ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	500,000.00	499,273.65	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,200,000.00	1,248,244.92	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,320,000.00	1,475,360.43	
	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	750,000.00	755,060.47	
	ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,400,000.00	1,498,122.78	
	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,200,000.00	1,610,401.68	
	ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,500,000.00	1,638,967.80	
	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,400,649.00	
	ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	985,000.00	998,960.01	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	590,000.00	590,392.82	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,400,000.00	2,389,601.48	
ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,390,000.00	1,931,540.23		
イスラエルシケル小計		18,005,000.00	20,789,963.83	(637,628,190)
合計			151,146,024,706	(151,146,024,706)

(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 221銘柄	100.0%	43.5%
加ドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 313銘柄	100.0%	41.4%
英ポンド	国債証券 47銘柄	100.0%	6.6%
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 15銘柄	100.0%	0.6%

豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	2.7%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	16銘柄	100.0%	0.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

**【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11月 7日から2021年 5月 6日まで）の中間財務諸表について、P w C 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。

## 【DCインデックスバランス(株式80)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2020年11月 6日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	467,515,667	588,051,641
親投資信託受益証券	8,660,070,140	10,784,965,422
未収入金	1,832,434	-
流動資産合計	9,129,418,241	11,373,017,063
資産合計	9,129,418,241	11,373,017,063
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,441,370	-
未払解約金	13,133,860	14,530,167
未払受託者報酬	926,571	1,131,211
未払委託者報酬	5,559,760	6,787,619
未払利息	323	120
その他未払費用	185,270	226,192
流動負債合計	23,247,154	22,675,309
負債合計	23,247,154	22,675,309
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,441,370,706	3,698,193,084
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,664,800,381	7,652,148,670
(分配準備積立金)	1,190,466,326	1,066,772,730
元本等合計	9,106,171,087	11,350,341,754
純資産合計	9,106,171,087	11,350,341,754
負債純資産合計	9,129,418,241	11,373,017,063

## （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11月 7日 至 2020年 5月 6日	当中間計算期間 自 2020年11月 7日 至 2021年 5月 6日
営業収益		
有価証券売買等損益	800,500,901	1,488,550,769
営業収益合計	800,500,901	1,488,550,769
営業費用		
支払利息	47,524	25,236
受託者報酬	1,033,423	1,131,211
委託者報酬	5,980,953	6,787,619
その他費用	163,387	226,192
営業費用合計	7,225,287	8,170,258
営業利益又は営業損失（ ）	807,726,188	1,480,380,511
経常利益又は経常損失（ ）	807,726,188	1,480,380,511
中間純利益又は中間純損失（ ）	807,726,188	1,480,380,511
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（ ）	55,770,247	94,945,144
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,736,373,108	5,664,800,381
剰余金増加額又は欠損金減少額	812,684,525	1,245,373,266
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	812,684,525	1,245,373,266
剰余金減少額又は欠損金増加額	580,700,738	643,460,344
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	580,700,738	643,460,344
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（ ）	4,216,400,954	7,652,148,670



## (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11月 6日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 6日現在
1. 期首元本額	2,984,466,013円	3,441,370,706円
期中追加設定元本額	1,136,417,948円	643,961,145円
期中一部解約元本額	679,513,255円	387,138,767円
2. 受益権の総数	3,441,370,706口	3,698,193,084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11月 7日 至 2020年 5月 6日	当中間計算期間 自 2020年11月 7日 至 2021年 5月 6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11月 6日現在	当中間計算期間末 2021年 5月 6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ぬ。	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ぬ。
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11月 6日現在		当中間計算期間末 2021年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	2,6461円	1口当たり純資産額	3,0692円
(1万口当たり純資産額)	(26,461円)	(1万口当たり純資産額)	(30,692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-KOKUSA I (ヘッジなし)マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」を主要投資対象としており、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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	99,769,328	225,533,370
株式	34,394,247,690	37,832,816,190
派生商品評価勘定	7,827,350	1,804,500
未収入金	52,158,410	-
未収配当金	297,955,110	352,005,600
前払金	-	13,210,000
流動資産合計	34,851,957,888	38,425,369,660
資産合計	34,851,957,888	38,425,369,660
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	8,505,450
前受金	5,230,000	-
未払金	-	11,573,338
未払解約金	52,611,923	3,018,896
未払利息	68	46
流動負債合計	57,841,991	23,097,730
負債合計	57,841,991	23,097,730

## 純資産の部

元本等		
元本	22,074,085,898	20,732,294,444
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,720,029,999	17,669,977,486
元本等合計	34,794,115,897	38,402,271,930
純資産合計	34,794,115,897	38,402,271,930
負債純資産合計	34,851,957,888	38,425,369,660

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

(貸借対照表に関する注記)

		2020年11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
1.	期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日
	期首元本額	21,517,048,675円	22,074,085,898円
	期首からの追加設定元本額	5,120,023,303円	720,883,566円
	期首からの一部解約元本額	4,562,986,080円	2,062,675,020円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	706,769,163円	679,401,968円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,801,534,543円	1,741,844,103円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,409,693,795円	3,427,454,730円
	DCインデックスバランス（株式80）	3,476,712,685円	3,639,150,215円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,354,690,627円	1,325,927,957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	3,236,646,653円	2,856,039,417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）	49,485,768円	43,407,151円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	40,124,492円	34,752,737円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	59,041,463円	49,844,449円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	53,396,078円	44,116,386円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,753,508,024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）	294,227,367円	255,470,095円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	804,213,731円	729,994,563円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,181,735,058円	1,099,515,140円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,117,792,381円	1,052,680,496円
計	22,074,085,898円	20,732,294,444円
2. 受益権の総数	22,074,085,898口	20,732,294,444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	370,645,000円	454,505,000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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	374,075,000	-	381,915,000	7,840,000
合計		374,075,000	-	381,915,000	7,840,000

(2021年 5月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	564,645,000	-	557,960,000	6,685,000
合計		564,645,000	-	557,960,000	6,685,000

(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11月 6日現在		2021年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.5762円	1口当たり純資産額	1.8523円
(1万口当たり純資産額)	(15,762円)	(1万口当たり純資産額)	(18,523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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	972,711,865	1,244,679,069
コール・ローン	1,762,909,076	2,434,961,572
株式	221,987,720,686	224,479,291,451
投資証券	5,247,863,381	5,098,193,100
派生商品評価勘定	121,431,199	107,025,111
未収入金	591,236	3,452,885
未収配当金	145,728,858	190,241,963
差入委託証拠金	518,140,681	413,794,538
流動資産合計	230,757,096,982	233,971,639,689
資産合計	230,757,096,982	233,971,639,689
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,276,948	2,382,954
未払解約金	8,098,832	1,614,524,220
未払利息	1,219	497
流動負債合計	38,376,999	1,616,907,671
負債合計	38,376,999	1,616,907,671
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	80,972,691,731	64,067,557,870
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	149,746,028,252	168,287,174,148
元本等合計	230,718,719,983	232,354,732,018
純資産合計	230,718,719,983	232,354,732,018
負債純資産合計	230,757,096,982	233,971,639,689

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
1.	期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日
	期首元本額	73,251,955,905円	80,972,691,731円
	期首からの追加設定元本額	31,186,546,669円	2,106,796,566円
	期首からの一部解約元本額	23,465,810,843円	19,011,930,427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）	21,583,842,358円	22,821,948,698円
	DCインデックスバランス（株式20）	130,747,619円	116,563,522円
	DCインデックスバランス（株式40）	335,931,303円	305,962,821円
	DCインデックスバランス（株式60）	637,019,208円	605,773,433円
	DCインデックスバランス（株式80）	647,750,426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	1,781,110,445円	1,569,455,092円
	日興五大陸株式ファンド	4,645,954,046円	4,264,559,265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	6,368,226,354円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	36,336,826,466円	20,017,488,772円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,550,352円	4,009,179円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,666,871円	3,197,684円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	5,390,061円	4,208,450円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	4,882,516円	3,911,845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	2,736,617,672円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	27,306,646円	22,085,951円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	74,179,157円	64,844,223円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	108,997,787円	99,058,923円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	102,138,945円	91,336,053円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,281,364,537円	4,151,195,112円
	計	80,972,691,731円	64,067,557,870円
2.	受益権の総数	80,972,691,731口	64,067,557,870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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,360,505,367	-	3,476,085,248	115,579,881
	合計	3,360,505,367	-	3,476,085,248	115,579,881

（2021年 5月 6日現在）

（単位：円）



区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,489,673,731	-	2,583,992,518	94,318,787
合計		2,489,673,731	-	2,583,992,518	94,318,787

## (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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,969,028,120	-	1,944,575,000	24,453,120
	米ドル	1,586,771,460	-	1,564,805,000	21,966,460
	ユーロ	382,256,660	-	379,770,000	2,486,660
	売建	37,790,840	-	37,763,350	27,490
	加ドル	17,062,400	-	17,051,650	10,750
	シンガポールドル	20,728,440	-	20,711,700	16,740
合計		2,006,818,960	-	1,982,338,350	24,425,630

(2021年 5月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	953,832,540	-	964,155,910	10,323,370
	米ドル	681,366,600	-	688,548,680	7,182,080
	ユーロ	272,465,940	-	275,607,230	3,141,290
	合計	953,832,540	-	964,155,910	10,323,370

## (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。

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。

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11月 6日現在		2021年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.8493円	1口当たり純資産額	3.6267円
(1万口当たり純資産額)	(28,493円)	(1万口当たり純資産額)	(36,267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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,551,647	48,468,720
国債証券	33,376,926,138	35,002,711,590
地方債証券	3,356,957,000	4,679,004,482
特殊債券	4,509,028,000	4,898,232,873
社債券	2,433,657,584	1,823,966,000
未収利息	94,079,545	91,203,604
前払費用	1,010,091	2,293,977
流動資産合計	43,857,210,005	46,545,881,246
資産合計	43,857,210,005	46,545,881,246
<b>負債の部</b>		

流動負債		
未払解約金	65,496,104	9,903,045
未払利息	59	9
流動負債合計	65,496,163	9,903,054
負債合計		
	65,496,163	9,903,054
純資産の部		
元本等		
元本	30,950,687,612	32,968,735,482
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,841,026,230	13,567,242,710
元本等合計	43,791,713,842	46,535,978,192
純資産合計	43,791,713,842	46,535,978,192
負債純資産合計	43,857,210,005	46,545,881,246

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2020年11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
1.	期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日
	期首元本額	29,082,509,839円	30,950,687,612円
	期首からの追加設定元本額	6,157,737,938円	2,618,393,765円
	期首からの一部解約元本額	4,289,560,165円	600,345,895円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	3,316,182,665円	3,821,755,903円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,937,621,572円	3,411,339,413円
	DCインデックスバランス（株式60）	2,060,335,630円	2,498,945,676円
	DCインデックスバランス（株式80）	315,604,302円	399,953,867円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,134,845,421円	2,157,137,655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	3,488,595,537円	3,546,775,779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）	24,342,419円	25,365,584円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	96,411,222円	96,956,216円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	252,398,632円	250,070,761円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,090,395,680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）	1,382,028,729円	1,453,211,117円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,312,918,382円	1,433,574,424円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	714,291,650円	794,176,296円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	101,570,081円	115,715,134円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,809,834,414円	6,835,643,259円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	315,718,552円	324,572,209円
計	30,950,687,612円	32,968,735,482円
2. 受益権の総数	30,950,687,612口	32,968,735,482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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （1口当たり情報）

2020年11月 6日現在		2021年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.4149円	1口当たり純資産額	1.4115円
(1万口当たり純資産額)	(14,149円)	(1万口当たり純資産額)	(14,115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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	101,245,794	401,598,793
コール・ローン	82,145,228	101,542,429
国債証券	151,146,024,706	154,314,695,932
派生商品評価勘定	-	23,849
未収入金	-	1,527,753,913
未収利息	975,927,211	1,007,682,528
前払費用	25,312,852	13,023,005
流動資産合計	152,330,655,791	157,366,320,449
資産合計	152,330,655,791	157,366,320,449
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,791	97,326
未払金	31,167,517	1,489,650,231
未払解約金	83,200,031	61,309,791
未払利息	56	20
流動負債合計	114,392,395	1,551,057,368
負債合計	114,392,395	1,551,057,368
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	62,261,620,781	61,873,107,017
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	89,954,642,615	93,942,156,064
元本等合計	152,216,263,396	155,815,263,081
純資産合計	152,216,263,396	155,815,263,081
負債純資産合計	152,330,655,791	157,366,320,449

## 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
--------------------	--

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2020年11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
1.	期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日
	期首元本額	66,109,940,367円	62,261,620,781円
	期首からの追加設定元本額	7,395,350,288円	1,329,400,418円
	期首からの一部解約元本額	11,243,669,874円	1,717,914,182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)	13,675,807,907円	14,206,138,687円
	DCインデックスバランス(株式20)	295,093,711円	331,373,613円
	DCインデックスバランス(株式40)	376,111,949円	427,720,929円
	DCインデックスバランス(株式60)	474,657,419円	563,566,062円
	DCインデックスバランス(株式80)	363,175,635円	450,457,653円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	22,033,058,132円	21,635,374,721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	2,007,884,611円	2,031,419,468円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	15,811,534,905円	15,079,560,484円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	1,006,798,808円	918,571,595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	2,711,331円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	2,810,203円	2,856,330円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,167,512円	6,069,716円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	11,212,682円	10,854,883円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	792,797,616円	905,513,180円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	782,118,041円	775,099,826円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	61,424,959円	63,110,845円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	84,106,678円	89,966,199円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	82,193,886円	89,841,030円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	58,416,254円	65,111,613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	3,903,607,480円	3,788,478,881円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,434,306円	270,945,901円
計	62,261,620,781円	61,873,107,017円
2. 受益権の総数	62,261,620,781口	61,873,107,017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11月 6日現在	2021年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	15,530,169	-	15,554,960	24,791
	ユーロ	15,530,169	-	15,554,960	24,791
合計		15,530,169	-	15,554,960	24,791

(2021年 5月 6日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益	
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	187,163,777	-	187,163,279	498	
	加ドル	53,073,800	-	53,079,044	5,244	
	メキシコペソ	19,306,940	-	19,295,484	11,456	
	ユーロ	20,067,480	-	20,075,711	8,231	
	英ポンド	7,750,980	-	7,754,743	3,763	
	スウェーデンクローナ	6,476,687	-	6,476,184	503	
	ノルウェークローネ	1,210,547	-	1,210,714	167	
	デンマーククローネ	7,055,200	-	7,056,520	1,320	
	豪ドル	42,128,814	-	42,133,792	4,978	
	マレーシアリングット	17,703,768	-	17,693,450	10,318	
	イスラエルシケル	12,389,561	-	12,387,637	1,924	
	売建	211,939,358	-	212,012,337	72,979	
	米ドル	137,922,768	-	137,962,552	39,784	
	ポーランドズロチ	60,845,180	-	60,875,751	30,571	
	シンガポールドル	13,171,410	-	13,174,034	2,624	
	合計		399,103,135	-	399,175,616	73,477

(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。



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。

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11月 6日現在		2021年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	2,4448円	1口当たり純資産額	2,5183円
(1万口当たり純資産額)	(24,448円)	(1万口当たり純資産額)	(25,183円)

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 5月31日現在です。

### 【DCインデックスバランス(株式80)】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	11,576,779,133円
負債総額	13,391,091円
純資産総額( - )	11,563,388,042円
発行済口数	3,750,849,403口
1口当たり純資産額( / )	3.0829円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	38,846,092,711円
負債総額	13,588,991円
純資産総額( - )	38,832,503,720円
発行済口数	20,997,721,209口
1口当たり純資産額( / )	1.8494円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	235,031,982,445円
負債総額	1,275,811,140円
純資産総額( - )	233,756,171,305円
発行済口数	63,085,497,725口
1口当たり純資産額( / )	3.7054円

日本債券インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	46,971,451,620円
負債総額	173,326,518円
純資産総額（ - ）	46,798,125,102円
発行済口数	33,152,519,251口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4116円

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 純資産額計算書

資産総額	159,466,242,955円
負債総額	1,500,818,523円
純資産総額（ - ）	157,965,424,432円
発行済口数	62,019,295,742口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5470円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

該当事項はありません。

### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （4）受益証券の再発行

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2021年5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5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5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5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	851	261,058
株式投資信託	784	226,178
単位型	279	11,091
追加型	505	215,087
公社債投資信託	67	34,879
単位型	54	2,000
追加型	13	32,879

### 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				
ソフトウェア		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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073
当期変動額							
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	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="526 795 1037 873"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法</p> <p>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p> <p>ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 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・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

クを管理しております。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

週次ペ - 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。

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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,427	-	20
	豪ドル		48	-	9
	シンガポール ドル		944	-	58
	香港ドル		529	-	2
	人民元		2,017	-	76
	ユーロ		70	-	1
合計			7,038	-	167

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 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	投資有価証券			
	米ドル				
	香港ドル		4,620	-	273
	人民元		862	-	57
	ユーロ		1,684	-	117
			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tockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

##### (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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



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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,171,500	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。

#### 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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円  
 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tockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

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

	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。

#### 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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,738百万円
- 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	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)	(単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 822	賞与引当金 929
投資有価証券評価損 102	投資有価証券評価損 97
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 1,430
退職給付引当金 427	退職給付引当金 446
固定資産減価償却費 96	固定資産減価償却費 90
その他 744	その他 978
繰延税金資産小計 3,624	繰延税金資産小計 3,972
評価性引当金 1,430	評価性引当金 1,430
繰延税金資産合計 2,194	繰延税金資産合計 2,541
繰延税金負債	繰延税金負債
繰延ヘッジ利益 172	繰延ヘッジ利益 51
繰延税金負債合計 172	その他有価証券評価差額金 645
繰延税金資産の純額 2,022	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	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%	法定実効税率 30.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%	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 9.6%	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%	その他 1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.6%	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ト	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

- 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。
- 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 貨建) (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 貨建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,783 (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

- 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。
- 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。
- 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) 通常の見積り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

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 (2021年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	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 (2021年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,400,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
富国生命保険相互会社	128,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

### (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

### (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

### (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

### (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

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

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

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

### 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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年12月16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 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 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DCインデックスバランス（株式80）の2019年11月7日から2020年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式80）の2020年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 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、継続企業的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、継続企業的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。継続企業的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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の中間監査報告書

2021年6月16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 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 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DCインデックスバランス（株式80）の2020年11月7日から2021年5月6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、DCインデックスバランス（株式80）の2021年5月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月7日から2021年5月6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. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。