

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月19日提出
【計算期間】	第5期(自 2020年7月18日至 2021年7月19日)
【ファンド名】	時間分散型バランスファンド(安定指向) 2 0 1 6 - 0 8
【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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

主として、日本を含む世界各国の株式、債券、不動産投信およびコモディティ(商品)連動証券などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と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 債券
	海外	不動産投信
追加型投信	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			ファミリーファンド	あり
一般	年6回	北米		(部分ヘッジ)
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 (その他資産(投資 信託証券(株式、 債券、不動産投 信、その他資産 (商品)))		エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

資産複合 資産配分変更型(その他資産(投資信託証券(株式、債券、不動産投信、その他資産(商品))))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券、不動産投信およびその他資産(商品)に投資を行いません。

「資産配分変更型」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、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

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。

ファンド・オブ・ファンズ

「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

為替ヘッジあり(部分ヘッジ)

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 世界の様々な資産に分散投資を行ない、世界経済の成長に沿った収益の獲得をめざします。

- 主として、世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)を投資対象とします*1。
- 複数の異なる資産への分散投資に加え、市場環境の変化に応じた資産配分の適宜見直しにより、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざします。
- 資産配分比率の決定および変更については、三井住友信託銀行株式会社の助言に基づき、日興アセットマネジメント株式会社が行ないます。

*1 世界の資産への投資は、各資産を主要投資対象とする投資信託証券を通じて行ないます。

2 世界の資産への投資を段階的に積み増すことで、投資タイミングを分散します。

- 世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)への投資比率は、設定当初、純資産総額の25%程度とし、その後、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げます*2。(設定日から約9ヵ月が経過した後は、世界の資産への投資比率を高位に保つことを原則とします。)

*2 その他の資産については、低リスク資産による安定的な運用を行ないます。

3 運用目的やリスク許容度に応じて、「安定指向」と「成長指向」の2つのファンドから選択できます。

- 「安定指向」は安定性を、「成長指向」は安定性と収益性のバランスを重視した運用を行ないます。

※「安定指向」とは元本保証等を意味するものではなく、「成長指向」と比較して安定的な運用をめざすファンドであることを意味しています。

繰上償還について

- 1万口当たり基準価額(税引前分配金控除後、以下「基準価額」)が、2026年6月30日以前の営業日に13,000円以上となった場合には、投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

※基準価額や償還価額が13,000円以上になることを保証するものではありません。

※安定運用への移行後も、繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や償還価額が13,000円を下回ることがあります。

※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行なえない場合があります。

資産分散について

- 当ファンドは、主として、世界（日本を含む）の資産（株式、債券、不動産、コモディティ（商品）など）を投資対象とします。値動きの異なる複数の資産に分散投資を行なうことで、価格変動リスクの軽減を図りながら、信託財産の成長をめざします。

投資対象資産と期待される収益・効果



*投資対象資産は今後、追加・変更される可能性があります。

**各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ないます。

(2016年6月末現在)

投資タイミングの分散について

- 資産価格は市況動向などにより変動するため、投資タイミングを分散する「エントリー分散」により、投資資産の短期的な価格変動の影響を小さくすることをめざします。
- 当ファンドでは、世界の資産への分散投資を、設定当初に純資産総額の25%程度から開始し、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げることで、投資タイミングの分散を図ります。

「エントリー分散」の仕組み



*「エントリー分散」の仕組みは、「安定指向」「成長指向」とも同様です。なお、世界の資産への分散投資における資産配分比率は、「安定指向」と「成長指向」で異なります。

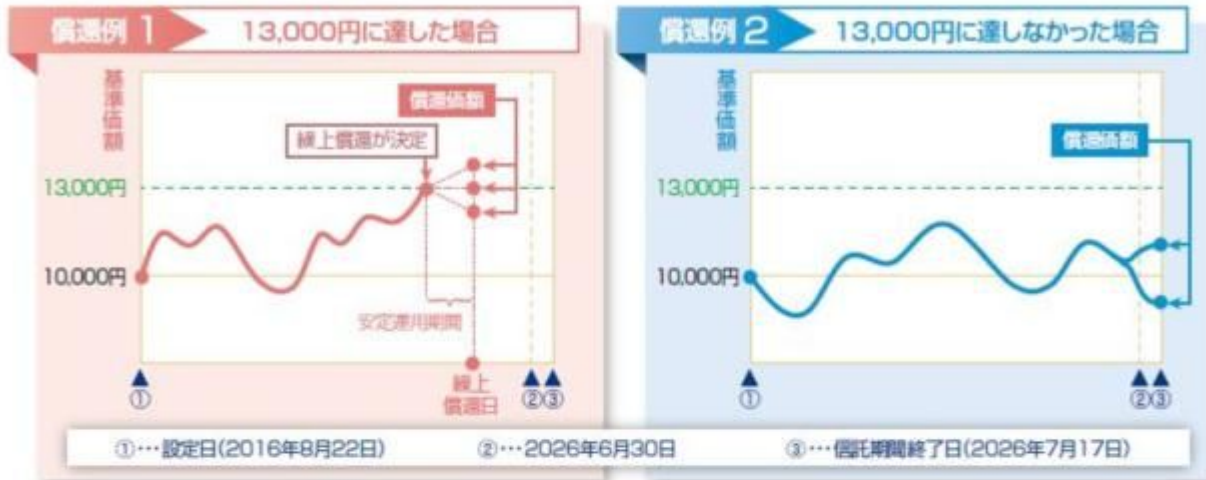
*低リスク資産は、内外のソブリン債を投資対象とし、外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで為替変動リスクの軽減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行なうことに伴い、為替ヘッジコストがかかります。

*上記は「エントリー分散」の仕組みについて説明するためのイメージ図です。

*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行なえない場合があります。

繰上償還について

- 1万口当たり基準価額（税引前分配金控除後、以下「基準価額」）が、2026年6月30日以前の営業日に13,000円以上となった場合には、投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

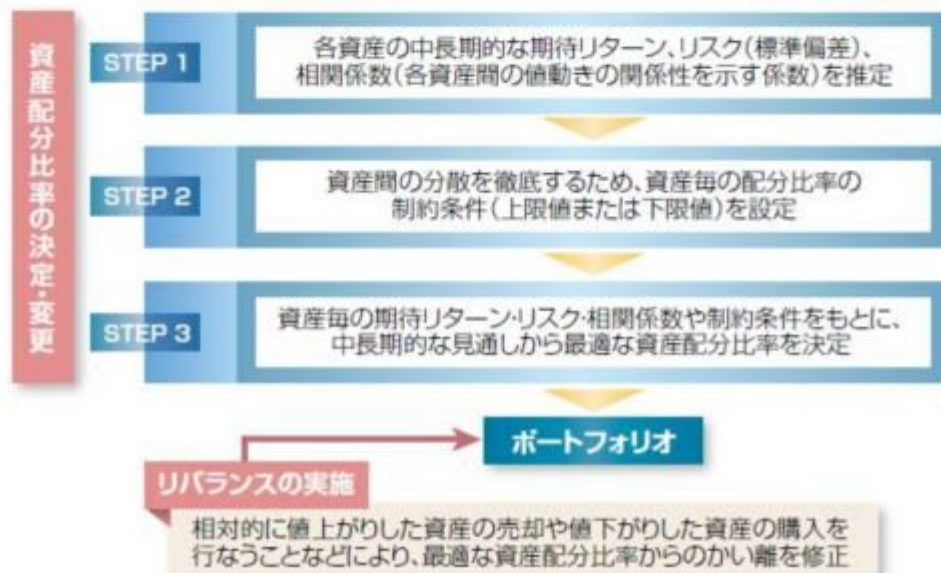


※上記は繰上償還について説明するためのイメージ図です。

- ※13,000円の基準価額水準は、あくまで安定運用に切り替えるための水準であり、基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。
- ※基準価額が13,000円以上となった場合には、安定運用に移行します。安定運用への移行後も繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や償還価額が13,000円を下回ることがあります。

資産配分の決定プロセス

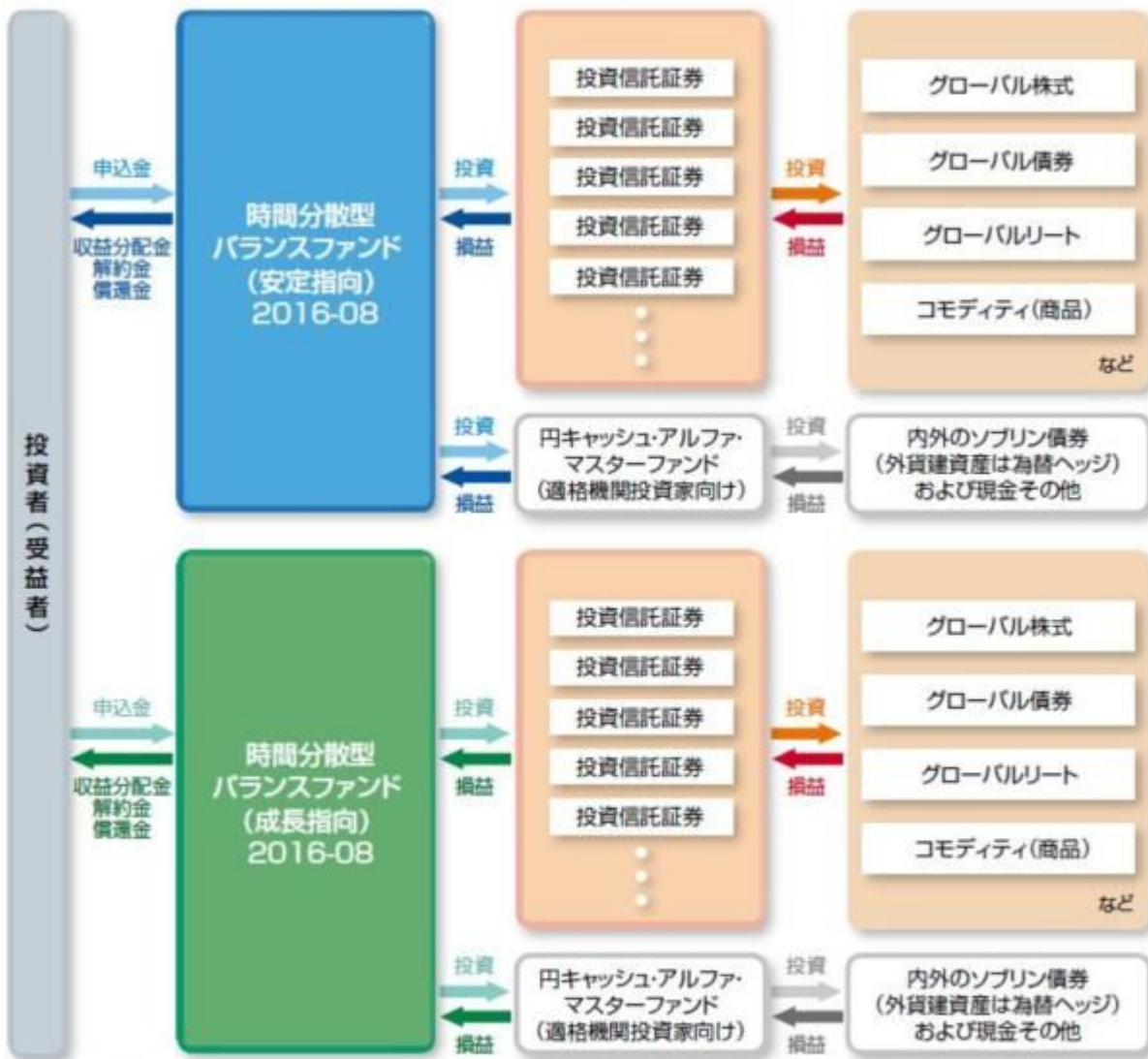
- 当ファンドにおいて、世界の資産への分散投資における資産配分比率の決定および変更は、年金運用などで豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行ないます。



- ※各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ない、各投資信託証券は、追加・変更される場合があります。
- ※上記は、2016年6月末現在のものであり、将来変更される場合があります。

ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

※投資先投資信託証券の詳細については、後述の追加的記載事項をご覧ください。

〈主な投資制限〉

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

〈分配方針〉

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、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。

※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。

追加的記載事項

当ファンドが投資対象とする投資信託証券は、資産クラスごとに以下のものを定めています。
※各投資信託証券は、追加、変更される場合があります。

資産クラス	投資信託証券	主な投資資産
株式	インデックス マザーファンドTOPIX	日本の株式
	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)	先進国(日本を除く)の株式
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	先進国企業が資本参加している 新興国企業の株式
債券	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	内外のソブリン債券 (外貨建資産は為替ヘッジ)
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	先進国(日本を除く)のソブリン債券
	インデックスファンド海外新興国債券 (適格機関投資家向け)	新興国のソブリン債券
不動産	インデックス マザーファンドJリート	日本の不動産投資信託
	インデックスファンド海外先進国リート (適格機関投資家向け)	先進国(日本を除く)の不動産投資信託
コモディティ (商品)	インデックス マザーファンド コモディティ	コモディティ関連のETF
	FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	金のETF

(有価証券報告書提出日現在)

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。

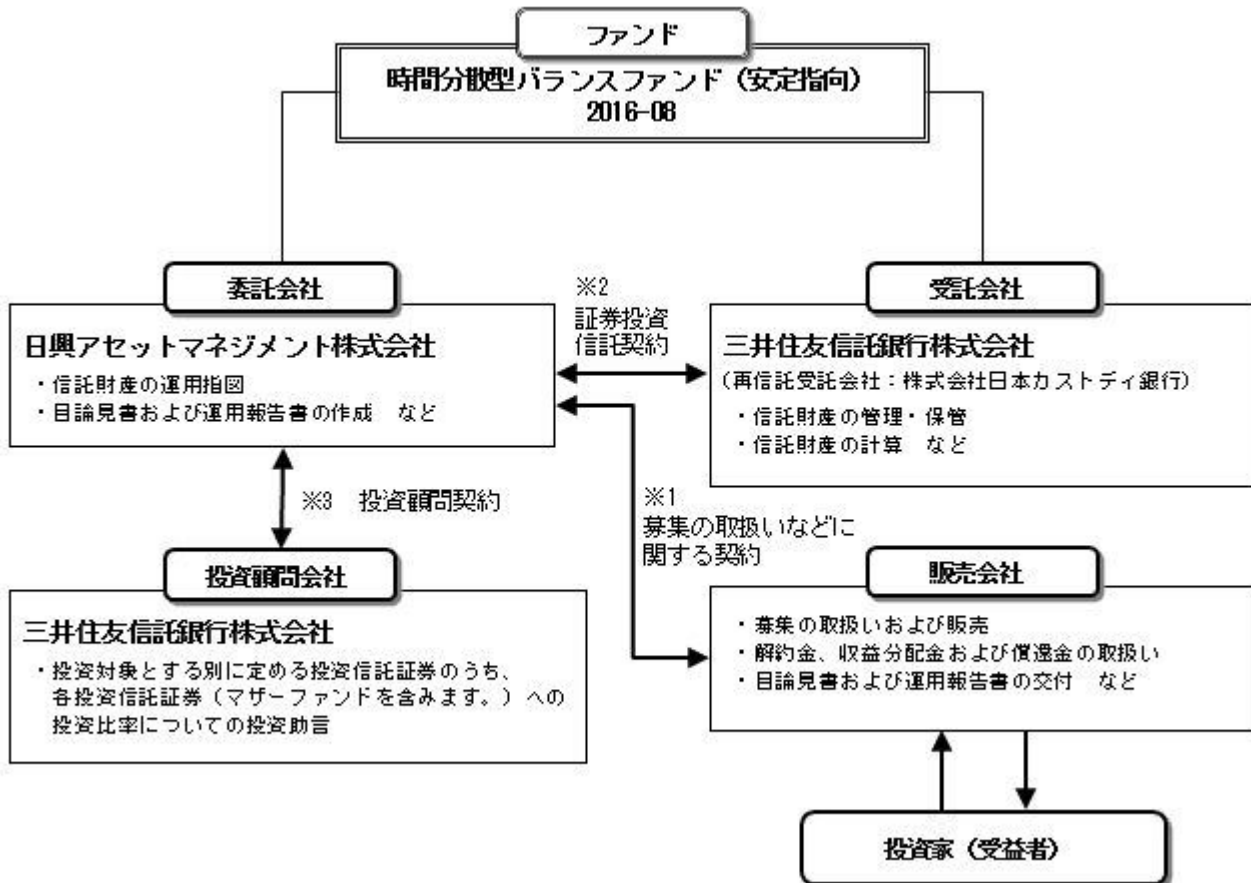
(2) 【ファンドの沿革】

2016年 8月22日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

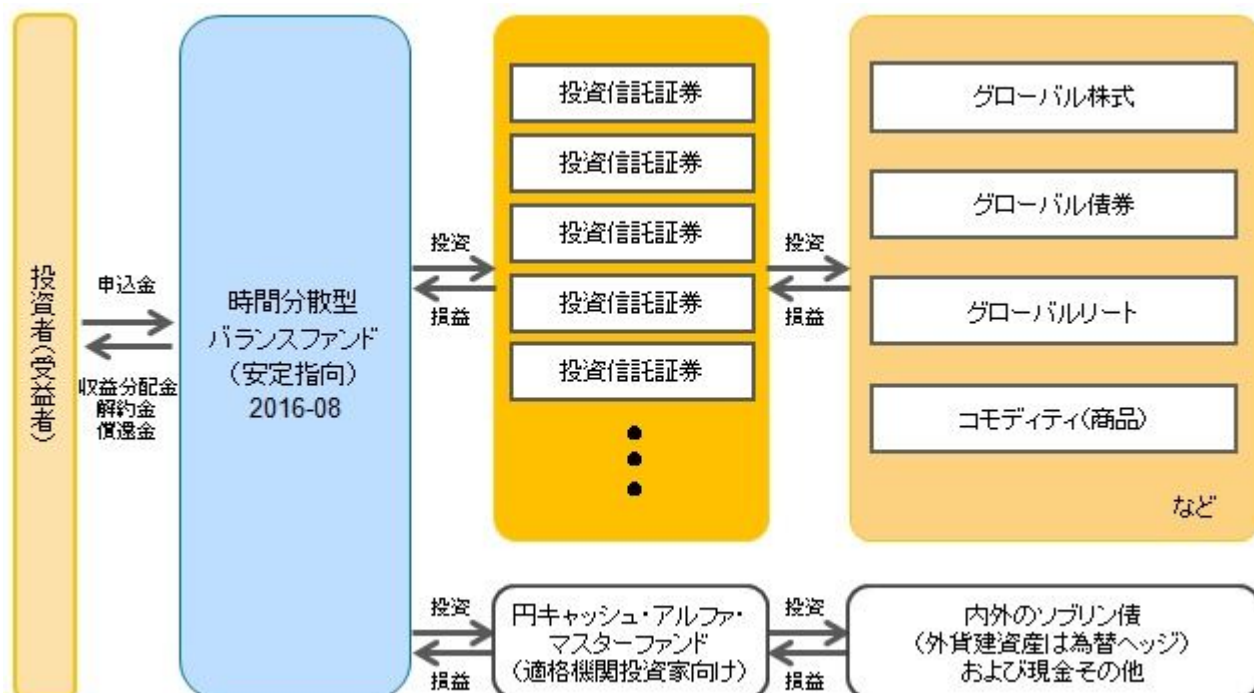
ファンドの仕組み



- 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。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

<ファンド・オブ・ファンズの仕組み>

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

投資先投資信託証券の詳細については、前述の追加的記載事項をご覧ください。

委託会社の概況（2021年7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、日本を含む世界各国の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券などに実質的に投資を行なう別に定める投資信託証券（以下、「別に定める投資信託証券」といいます。）ならびに円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）受益証券の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。
- ・各投資信託証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちます。
- ・一方で、原則として、以下の要件にしたがって、信託財産の純資産総額に対する各投資信託証券への投資比率を変更していきます。投資比率を変更するタイミングについては、ファンドの状況などを勘案し、合理的な範囲で決定できるものとしします。

当初設定時からの約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 25%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 75%

2016年11月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 50%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 50%

2017年2月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 75%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 25%

2017年5月下旬以降の信託期間中において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 100%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 0%

- ・なお、別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として、適宜見直しを行いません。この際、定性評価や定量評価等を勘案のうえ、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。
- ・2026年6月30日以前の毎営業日において、1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、各投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期有価証券や短期金融商品等の資産による安定運用に切り替えることを基本とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等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】

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投

資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として、別に定めるマザーファンドの受益証券および別に定めるマザーファンドを除く投資信託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) 追加型証券投資信託 円キャッシュ・アルファ・マスターファンド(適格機関投資家向け) 受益証券
- 2) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

投資対象とする投資信託証券の概要

<インデックス マザーファンド T O P I X >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X (東証株価指数) [*] の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。 2022年4月4日付で「わが国の金融商品取引所上場株式」に変更予定です。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をT O P I X (東証株価指数)の動きにできるだけ連動させるため、「バール日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行います。 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないます。 資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行ないません。 ・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

* T O P I X（東証株価指数）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

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。

T O P I X（東証株価指数）の構成銘柄は、現行の市場区分において、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄が対象となります。（有価証券届出書提出日現在）

<ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	内外の公社債に投資を行ない、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外のソブリン債券（国債、州政府債、政府保証債、政府機関債、国際機関債などをいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・原則として、日本および世界の高格付け国の中から、為替ヘッジコスト考慮後の利回りや信用力などを勘案して複数国を選定し、当該国通貨建てのソブリン債券に分散投資するとともに、外貨建て資産については為替ヘッジを行なうことにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、為替ヘッジコスト考慮後の利回りの水準や方向性、信用力、流動性などの分析を行ない、組入国やその配分比率、および組入銘柄を決定します。なお、金利動向などによっては、組入債券の一部売却や先物取引などの活用により、実質的な債券組入比率を調整することがあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2011年2月28日設定）
決算日	毎年2月10日（休業日の場合は翌営業日）

<インデックス マザーファンド リポート>

運用の基本方針

基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数（東証REIT指数（配当込み）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 運用にあたって、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は、有価証券指数等先物取引（別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数を対象とする先物取引とします。）を活用したり、対象指数に採用されていない不動産投資信託証券について投資を行なうことがあります。また、対象指数に採用されている不動産投資信託証券の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合もあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2015年3月17日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

< インデックス マザーファンド 海外先進国債券 >

運用の基本方針	
基本方針	日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年7月17日（休業日の場合は翌営業日）

<先進国資本エマージング株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	主として、世界の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	世界の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、世界の金融商品取引所に上場されており、先進国企業が資本参加している新興国企業の株式（預託証券を含みます。以下同じ。）に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 株式の銘柄選定にあたっては、各企業の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。なお、ファンドの状況等によっては、上場投資信託証券等に投資する場合があります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

投資顧問会社	日興アセットマネジメント アジア リミテッド（投資助言）
信託期間	無期限（2016年 6月30日設定）
決算日	毎年 6月21日（休業日の場合は翌営業日）

< インデックス マザーファンド コモディティ >

運用の基本方針	
基本方針	コモディティに関連する上場投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数（ブルームバーグ・コモディティ・インデックス・トータルリターン（円換算ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	コモディティに関連する上場投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本または海外の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、コモディティ商品指数への連動を目指す投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 また、ファンドの状況に応じて、コモディティに関連する上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年7月17日（休業日の場合は翌営業日）

< 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） >

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数（MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	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を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、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に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託会社の判断により決定するものとします。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> 有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）および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。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。

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

その他

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

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

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

<インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)>

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数(S & P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)(有価証券届出書提出日現在)以下同じ。)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	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%(税抜0.09%)

その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月15日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

<インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針

基本方針	別に定める新興国債券市場を代表する指数（JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバシファイド（円ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める新興国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める新興国債券市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月16日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（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。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイド（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。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2008年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイドは、J Pモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券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JPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.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。

<円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針

基本方針	インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
------	---------------------------------

主な投資対象	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、この信託の純資産総額に対して50%以上となることを原則とし、金利動向等に応じて機動的に変更できるものとします。 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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.088%（税抜0.08%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> 有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年8月10日（休業日の場合は翌営業日）

< F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） >

運用の基本方針	
基本方針	信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	ゴールド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、ゴールド・マザーファンド受益証券に投資を行ない、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、原則として対円での為替ヘッジを行ないます。 ・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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.143%（税抜0.13%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	2027年7月8日まで（2017年9月29日設定）
決算日	毎年7月8日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜ゴールド・マザーファンド＞

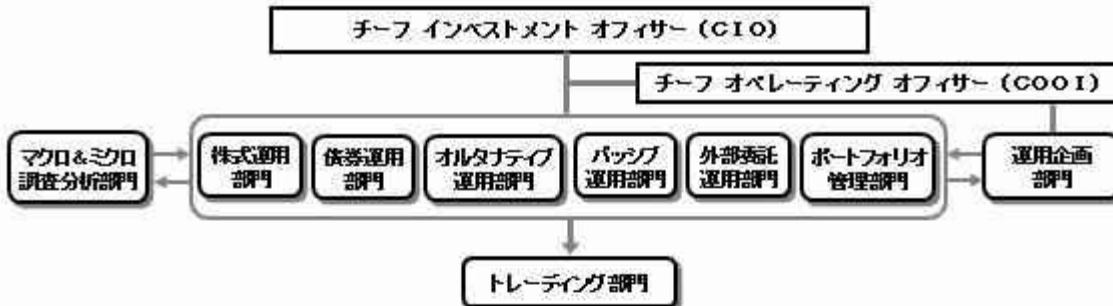
運用の基本方針	
基本方針	主に金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、金地金価格への連動をめざす投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。なお、ファンドの状況や投資環境に応じて、金地金価格への連動をめざすために、金先物価格への連動をめざす上場投資信託証券や上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2013年3月25日設定)
決算日	毎年3月8日(休業日の場合は翌営業日)

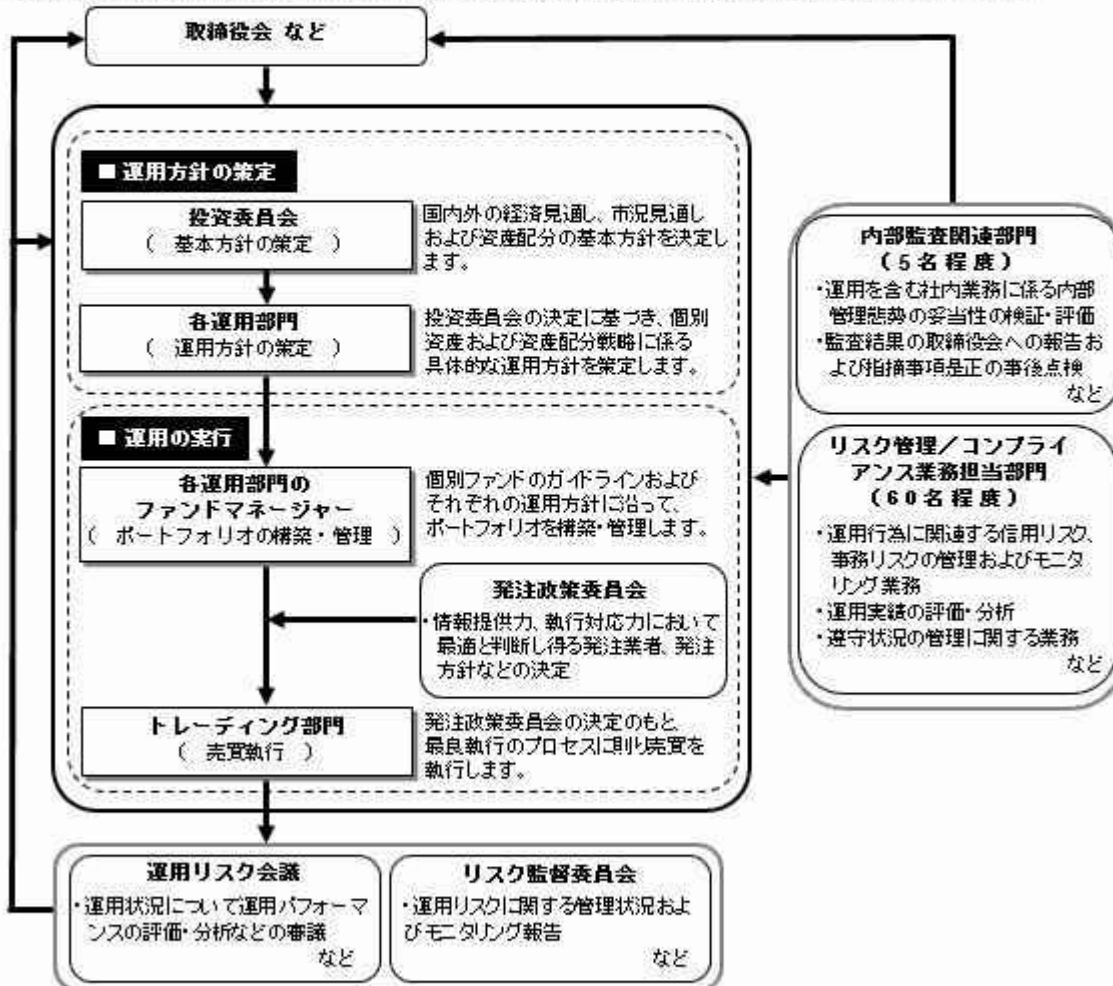
(3) 【運用体制】

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)における運用体制>

◆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

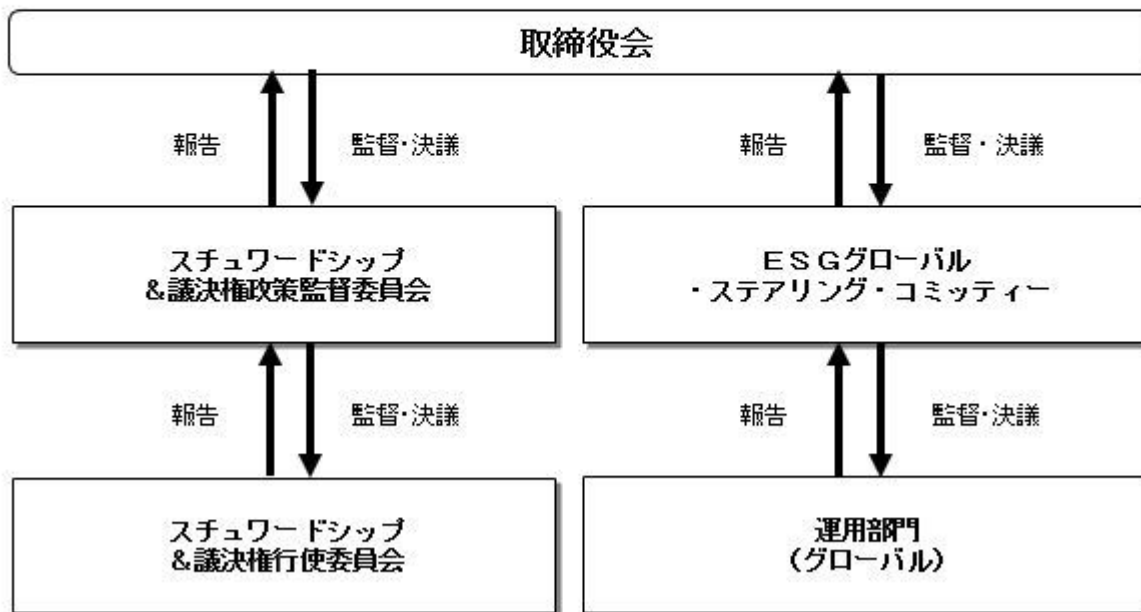
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門で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などのモニタリングを行っております。

◆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7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ないます。

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

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

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

- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 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範囲内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様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、主に債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券を実質的な投資対象としますので、債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券の価格の下落や、債券、株式および不動産投信の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産、商品（コモディティ）の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。
- ・一般にコモディティ連動証券の価格は、投資対象となる商品および当該商品が関係する市況や市況の変化などの要因により価格が変動するリスクがあります。上記事項に関する変動があった場合、ファンドに損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

信用リスク

- ・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。
- ・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も不動産投信の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・上場投資信託証券について、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上場投資信託証券の価格は下がり、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。
- ・格付を有する有価証券については、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

- ・一部の資産を除き、原則として、為替ヘッジを行わないため、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。
- ・一部の資産において、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

カントリー・リスク

- ・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延

する場合があります。

- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

有価証券の貸付などにおけるリスク

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

< 繰上償還に関する事項 >

- ・1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、信託約款の規定に基づき、繰上償還します（償還価額が13,000円以上であることを保証するものではありません。）。
- ・13,000円は、あくまでも安定運用に切り替えるための価額水準であり、ファンドの基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。また、資産価格の変動の影響および外国為替予約取引等の決済を速やかに行なえないなどの事由により、基準価額が13,000円以上となった日の翌営業日以降（安定運用への切り替え完了後も含みます。）の基準価額が13,000円を下回る場合があります。

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

< その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

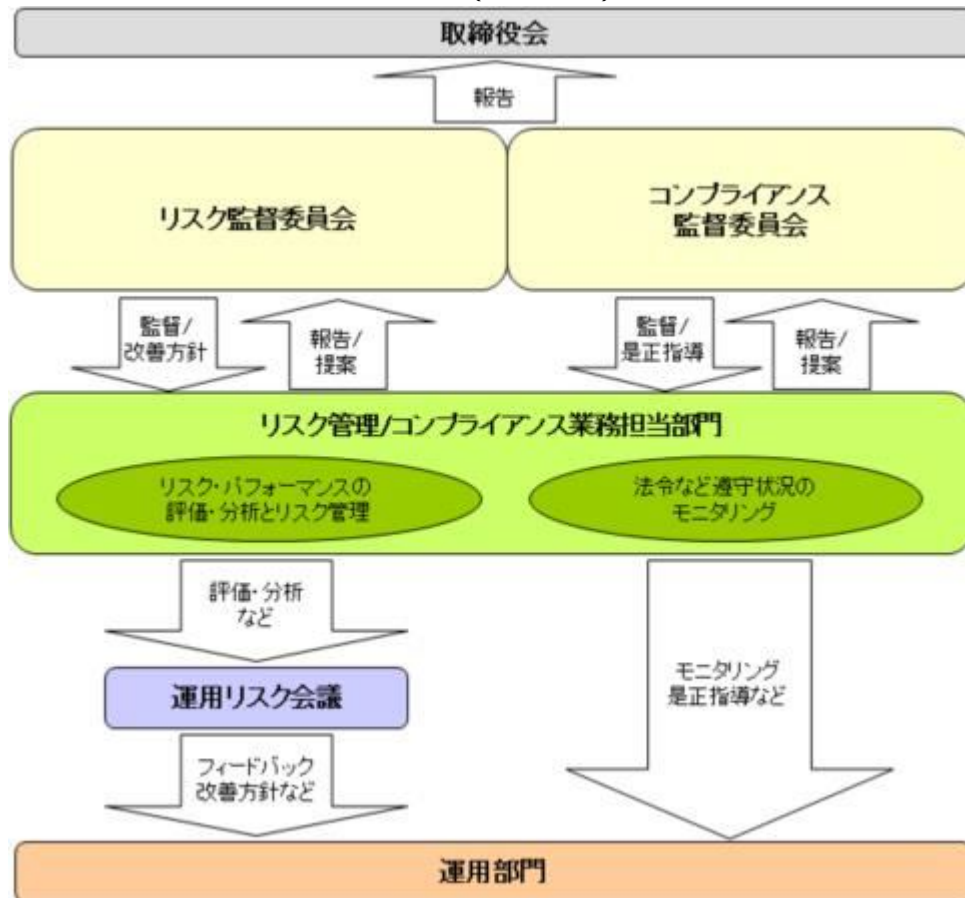
響を及ぼす可能性があります。

- ・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

<日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制>



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7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【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

(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

信託報酬率（年率）＜純資産総額に対し＞	
当ファンド	0.913%（税抜0.83%）
投資対象とする投資信託証券	0.099%（税抜0.09%）以内 ^{*1}
実質的負担	1.012%（税抜0.92%）以内 ^{*2}

・当ファンドの信託報酬は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.913%（税抜0.83%）の率を乗じて得た額とします。

・投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率（年率）0.099%（税抜0.09%）以内^{*1}がかかり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は1.012%（税抜0.92%）以内^{*2}となります。

*1 投資対象とする投資信託証券の想定される組入比率に基づき委託会社が算出した上限値です。

*1 投資対象とする投資信託証券の信託報酬の詳細については、「第1 ファンドの状況 - 2 投資方針 - (2) 投資対象」 - 「投資対象とする投資信託証券の概要」をご覧ください。

*2 当ファンドの信託報酬率（年率）に投資対象とする投資信託証券の信託報酬率（年率）を加えた、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）について、委託会社が算出した上限値です。当該上限値は、投資対象とする投資信託証券の想定される組入比率に基づき委託会社が算出したものですが、当該投資信託証券の変更などにより見直すことがあります。

*2 この他に、実質的に不動産投信や上場投資信託証券などに投資する場合には、運用などに係る費用がかかりますが、投資する銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬の配分（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
0.83%	0.40%	0.40%	0.03%

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。

投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

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】

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

ファンドの計理業務（設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等）およびこれに付随する業務（法定帳簿管理、法定報告等）に係る費用。

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

別に定める投資信託証券の1つである「インデックス マザーファンド」リートの運用の基本方針に規定する「別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数」その他これに類する標章の使用料。

信託財産に関する以下の費用・報酬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。

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おいて有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるもの）に限ります。）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.55（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は4：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

「円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）」

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」

・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費

用を含みます。)、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。

- ・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については、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「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）」

「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」

「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」

- ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「各信託約款に定めるベンチマーク指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。
 - ・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については、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックス マザーファンド T O P I X」

「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」

「インデックス マザーファンド リート」

「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」

「先進国資本エマージング株式マザーファンド」

「インデックス マザーファンド コモディティ」

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）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、)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)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。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

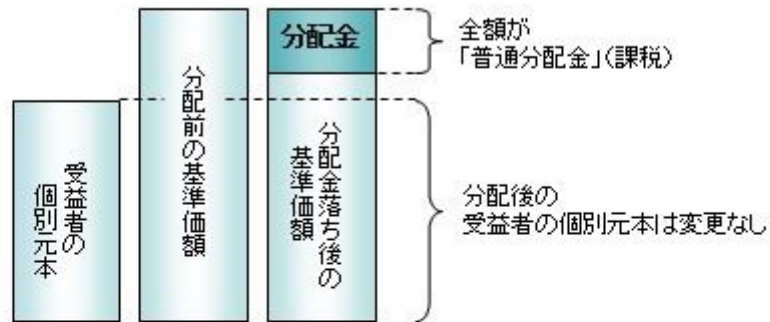
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

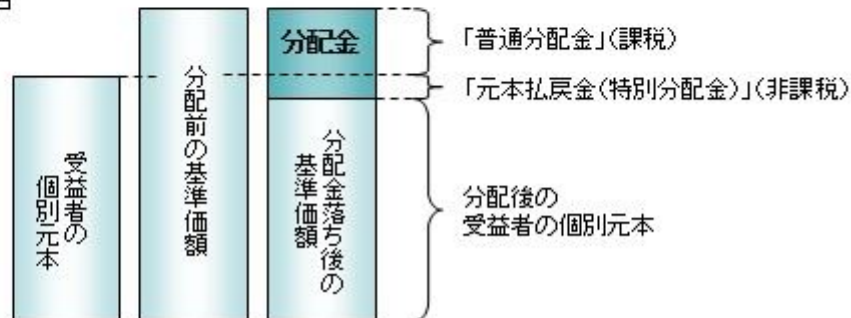
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2021年10月19日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【時間分散型バランスファンド（安定指向）2016 - 08】

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	92,329,846	25.84
親投資信託受益証券	日本	254,441,764	71.21
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		10,556,022	2.95
合計(純資産総額)		357,327,632	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	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	76,101,768	1.3764	104,746,474	1.3868	105,537,931	29.54
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	24,324,040	2.4921	60,617,940	2.4843	60,428,212	16.91
日本	投資信託受益証券	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)	23,812,570	2.1021	50,056,403	2.143	51,030,337	14.28
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	40,961,348	1.2154	49,784,423	1.2220	50,054,767	14.01
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド J リート	18,588,027	1.4966	27,818,842	1.5044	27,963,827	7.83
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)	14,685,129	1.4152	20,782,394	1.42	20,852,883	5.84
日本	投資信託受益証券	F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	11,645,780	1.277	14,871,661	1.2899	15,021,891	4.20
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)	4,597,623	1.1775	5,413,701	1.1799	5,424,735	1.52
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド コモディティ	5,043,703	1.0287	5,188,458	1.0507	5,299,418	1.48
日本	親投資信託受益証券	先進国資本エマージング株式マザーファンド	4,009,959	1.3209	5,296,754	1.2862	5,157,609	1.44

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	25.84
親投資信託受益証券	71.21
合計	97.05

【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1計算期間末 (2017年 7月18日)	1,033	1,033	1.0099	1.0099
第2計算期間末 (2018年 7月17日)	529	529	1.0490	1.0490
第3計算期間末 (2019年 7月17日)	396	396	1.0661	1.0661
第4計算期間末 (2020年 7月17日)	349	349	1.0787	1.0787
第5計算期間末 (2021年 7月19日)	355	355	1.2296	1.2296
2020年 7月末日	346		1.0733	
8月末日	356		1.1048	

9月末日	350		1.0977
10月末日	332		1.0789
11月末日	345		1.1282
12月末日	346		1.1479
2021年 1月末日	342		1.1550
2月末日	339		1.1606
3月末日	349		1.1914
4月末日	352		1.2032
5月末日	354		1.2188
6月末日	355		1.2276
7月末日	357		1.2369

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 8月22日～2017年 7月18日	0.0000
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0.0000
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	0.0000
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	0.0000
第5期	2020年 7月18日～2021年 7月19日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 8月22日～2017年 7月18日	0.99
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	3.87
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	1.63
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	1.18
第5期	2020年 7月18日～2021年 7月19日	13.99

(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1期	2016年 8月22日～2017年 7月18日	1,302,197,533	278,705,244
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0	518,521,796
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	0	132,909,981
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	0	48,132,219

第5期	2020年 7月18日 ~ 2021年 7月19日	0	34,543,904
-----	---------------------------	---	------------

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

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)

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	115,374,607	99.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,114,658	0.96
合計(純資産総額)		116,489,265	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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	29,950,316	3.8717	115,958,639	3.8522	115,374,607	99.04

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	163,531,292,363	66.67
	カナダ	8,510,974,282	3.47
	ドイツ	7,031,013,454	2.87
	イタリア	1,389,735,809	0.57
	フランス	7,863,979,530	3.21
	オランダ	4,520,790,586	1.84
	スペイン	1,813,412,364	0.74
	ベルギー	633,991,504	0.26
	オーストリア	158,421,756	0.06
	ルクセンブルク	239,633,502	0.10
	フィンランド	985,368,002	0.40
	アイルランド	4,636,677,846	1.89
	ポルトガル	114,665,919	0.05
	イギリス	10,157,913,057	4.14
	スイス	8,209,175,667	3.35
	スウェーデン	2,773,461,473	1.13
	ノルウェー	448,166,126	0.18
	デンマーク	1,986,129,105	0.81
	ケイマン	393,791,913	0.16
	オーストラリア	4,774,099,997	1.95
	パミューダ	349,630,020	0.14
	ニュージーランド	235,710,418	0.10
	パプアニューギニア	24,409,352	0.01
	香港	1,834,138,753	0.75
	シンガポール	685,331,391	0.28
	イスラエル	520,562,394	0.21
	ジャージー	800,315,302	0.33
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	59,627,727	0.02	
小計		234,682,419,612	95.67
投資証券	アメリカ	4,693,398,358	1.91
	カナダ	15,138,345	0.01
	フランス	122,755,076	0.05
	イギリス	148,250,738	0.06
	オーストラリア	329,010,200	0.13
	香港	92,465,625	0.04
	シンガポール	99,348,536	0.04

	小計	5,500,366,878	2.24
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,119,248,549	2.09
合計(純資産総額)		245,302,035,039	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,226,669,842	1.72
	買建	ドイツ	809,219,145	0.33

(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		3,441,942,050	1.40
	売建		54,743,050	0.02

(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	665,808	12,613.27	8,398,019,253	15,946.12	10,617,056,662	4.33
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	284,334	23,719.96	6,744,391,313	31,368.88	8,919,240,548	3.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	16,975	350,949.60	5,957,369,596	394,155.24	6,690,785,213	2.73
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	95,420	31,222.08	2,979,211,004	39,232.45	3,743,561,028	1.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,920	179,294.55	2,137,191,131	297,325.56	3,544,120,788	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,692	180,397.47	2,109,207,318	298,996.38	3,495,865,756	1.43
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	30,500	46,726.63	1,425,162,391	74,163.05	2,261,973,071	0.92
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	98,130	14,919.89	1,464,089,755	21,527.92	2,112,535,162	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	120,920	11,416.32	1,380,462,495	16,751.96	2,025,648,212	0.83
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	15,909.99	1,655,450,567	18,851.98	1,961,568,224	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	67,372	21,752.48	1,465,508,130	27,144.76	1,828,796,825	0.75

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	37,585	36,238.92	1,362,040,001	45,118.63	1,695,784,054	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	54,305	23,326.18	1,266,728,280	30,630.92	1,663,412,241	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバコ	114,113	12,878.87	1,469,647,055	13,740.64	1,567,986,223	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	42,640	31,010.06	1,322,269,201	35,850.31	1,528,657,248	0.62
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェ ア・サービ ス	35,145	36,102.13	1,268,809,629	42,570.80	1,496,151,008	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	97,969	15,586.99	1,527,042,450	15,271.66	1,496,149,768	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・ 娯楽	72,132	14,152.79	1,020,869,259	19,527.54	1,408,560,623	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	16,782	41,429.62	695,271,987	83,621.69	1,403,339,319	0.57
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェ ア・サービ ス	44,207	22,308.18	986,177,721	31,004.28	1,370,606,352	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	308,619	2,736.06	844,401,195	4,235.07	1,307,024,056	0.53
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	19,024	53,554.42	1,018,819,405	68,069.93	1,294,962,405	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	27,813	35,957.19	1,000,077,372	42,007.46	1,168,353,485	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・ 娯楽	180,954	4,948.72	895,491,213	6,362.46	1,151,313,293	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	167,551	3,761.10	630,176,214	6,452.24	1,081,080,219	0.44
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	220,450	3,959.87	872,953,633	4,685.07	1,032,825,247	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	161,932	5,534.79	896,260,984	6,246.40	1,011,492,773	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェ ア・サービ ス	37,826	26,563.68	1,004,797,778	26,719.93	1,010,708,435	0.41
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	4,250.40	708,967,020	6,029.61	1,005,739,665	0.41
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	163,387	6,346.04	1,036,860,502	6,129.25	1,001,439,802	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	3.03
		素材	4.30
		資本財	6.36
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	2.03
		消費者サービス	1.82

	メディア・娯楽	7.38
	小売	5.58
	食品・生活必需品小売り	1.35
	食品・飲料・タバコ	3.79
	家庭用品・パーソナル用品	1.68
	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	7.49
	銀行	5.77
	各種金融	4.61
	保険	2.88
	不動産	0.40
	ソフトウェア・サービス	12.16
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.85
	電気通信サービス	1.63
	公益事業	2.84
	半導体・半導体製造装置	4.53
投資証券		2.24
合計		97.91

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 EMINI2109	買建	175	米ドル	37,378,750	4,092,599,337	38,603,250	4,226,669,842	1.72
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2109	買建	175	ユーロ	6,170,450	802,837,249	6,219,500	809,219,145	0.33

(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	25,500,000.00	2,808,324,420	2,791,185,340	1.14
	ユーロ	買建	5,000,000.00	657,025,220	650,756,710	0.27
	米ドル	売建	500,000.00	54,745,000	54,743,050	0.02

(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。

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	44,969,659	99.03
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		439,637	0.97
合計(純資産総額)		45,409,296	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	17,262,825	2.5962	44,817,747	2.6050	44,969,659	99.03

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

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。

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2021年7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	57,239,902,980	74.32
	カナダ	1,500,020,054	1.95
	ドイツ	227,514,370	0.30

	イタリア	13,019,075	0.02
	フランス	1,722,242,691	2.24
	オランダ	144,991,193	0.19
	スペイン	339,187,852	0.44
	ベルギー	1,072,754,644	1.39
	アイルランド	95,537,988	0.12
	イギリス	4,249,805,050	5.52
	オーストラリア	5,054,133,096	6.56
	ニュージーランド	180,933,521	0.23
	香港	1,157,561,696	1.50
	シンガポール	2,834,242,287	3.68
	韓国	135,881,274	0.18
	イスラエル	52,388,465	0.07
	ガーンジー	192,004,907	0.25
	小計	76,212,121,143	98.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		810,857,648	1.05
合計（純資産総額）		77,022,978,791	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	332,373	13,813.25	4,591,154,134	14,002.67	4,654,111,463	6.04
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	40,261	90,218.66	3,632,293,676	86,100.74	3,466,502,143	4.50
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	68,464	32,259.03	2,208,582,826	34,140.07	2,337,366,225	3.03
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	126,586	17,773.51	2,249,877,752	16,477.15	2,085,776,523	2.71
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	147,649	14,592.82	2,154,616,343	13,786.98	2,035,633,928	2.64
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	187,604	8,891.68	1,668,115,279	9,605.55	1,802,041,047	2.34
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	62,759	23,453.85	1,471,940,354	25,173.94	1,579,891,351	2.05
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	154,718	8,858.83	1,370,621,373	9,248.62	1,430,928,036	1.86
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	756,563	1,667.33	1,261,442,608	1,819.34	1,376,452,894	1.79
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	61,664	21,171.94	1,305,547,087	21,870.62	1,348,630,374	1.75
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	167,907	7,729.99	1,297,920,102	7,688.38	1,290,934,130	1.68
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	60,156	17,511.83	1,053,441,682	19,022.79	1,144,335,112	1.49
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	254,856	4,139.81	1,055,057,176	4,449.67	1,134,026,015	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	168,482	6,455.53	1,087,640,673	6,529.98	1,100,184,697	1.43
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	51,426	18,787.38	966,160,272	21,132.66	1,086,768,425	1.41
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	50,230	19,445.42	976,743,648	21,419.52	1,075,902,927	1.40
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,224	34,533.14	1,009,196,658	36,197.39	1,057,832,642	1.37
香港	投資証券	LINK REIT	938,200	1,082.81	1,015,898,440	1,056.75	991,442,850	1.29

アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	242,250	3,864.99	936,295,523	4,066.45	985,099,596	1.28
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	539,023	1,674.24	902,459,042	1,825.48	983,976,784	1.28
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	168,483	5,419.75	913,136,582	5,574.13	939,147,139	1.22
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	63,949	13,580.04	868,430,278	12,964.71	829,080,297	1.08
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	240,978	3,593.46	865,945,238	3,393.09	817,661,271	1.06
アメリカ	投資証券	UDR INC	133,455	5,487.63	732,352,836	6,086.54	812,280,410	1.05
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	43,891	14,801.95	649,672,524	16,286.63	714,836,807	0.93
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	80,001	8,511.75	680,948,720	8,809.56	704,774,042	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,233	8,378.17	638,693,400	9,119.42	695,200,905	0.90
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	129,933	5,029.97	653,559,170	4,756.24	617,993,260	0.80
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	264,322	2,405.49	635,825,329	2,280.67	602,833,027	0.78
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	62,261	10,424.41	649,034,390	9,488.92	590,789,791	0.77

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.95
合計	98.95

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)

以下の運用状況は2021年7月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,620,473	99.07
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		99,445	0.93
合計(純資産総額)		10,719,918	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	7,774,302	1.3617	10,586,267	1.3661	10,620,473	99.07

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.07
合計	99.07

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。

海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2021年7月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	623,527,346	9.08
	ブラジル	561,843,939	8.18
	チリ	137,479,381	2.00
	コロンビア	299,329,387	4.36
	ペルー	147,308,053	2.15
	ウルグアイ	14,823,753	0.22
	ドミニカ共和国	16,113,667	0.23
	トルコ	128,988,026	1.88
	チェコ	276,048,869	4.02
	ハンガリー	264,115,202	3.85
	ポーランド	574,949,325	8.38
	ロシア	498,074,503	7.26
	ルーマニア	204,174,085	2.97
	マレーシア	504,377,859	7.35
	タイ	573,852,030	8.36
	フィリピン	21,918,802	0.32
インドネシア	650,711,140	9.48	

	中国	685,220,377	9.98
	南アフリカ	524,607,509	7.64
	小計	6,707,463,253	97.71
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		157,164,529	2.29
合計（純資産総額）		6,864,627,782	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 (%)
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,900,000	1,758.76	121,354,454	1,776.65	122,589,438		2024/1/1	1.79
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,250,000	856.56	96,363,638	854.46	96,127,402	10.500	2026/12/21	1.40
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,400,000	1,843.41	81,110,067	1,855.85	81,657,597		2023/7/1	1.19
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	3,650,000	2,249.86	82,120,055	2,216.62	80,906,810	10.000	2023/1/1	1.18
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	3,490,000	2,262.57	78,963,986	2,249.40	78,504,264	10.000	2025/1/1	1.14
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,090,000	3,077.91	64,328,333	3,131.98	65,458,422	2.750	2029/10/25	0.95
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,250,000	617.47	63,290,754	629.43	64,517,260	8.750	2048/2/28	0.94
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,930,000	702.69	62,750,707	712.36	63,613,912	8.000	2030/1/31	0.93
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	2,690,000	2,250.99	60,551,683	2,258.31	60,748,634	10.000	2027/1/1	0.88
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,930,000	3,013.73	58,165,166	3,044.50	58,759,036	2.500	2026/7/25	0.86
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,230,000	582.61	59,601,563	573.75	58,695,647	7.500	2027/6/3	0.86
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,560,000	615.08	58,802,340	606.47	57,979,239	8.500	2029/5/31	0.84
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000	542.19	58,556,524	535.70	57,856,083	5.750	2026/3/5	0.84
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000	561.01	56,101,742	556.19	55,619,591	6.500	2022/6/9	0.81
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,010,000	626.00	56,403,121	613.70	55,295,240	10.000	2024/12/5	0.81
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,300,000	1,637.84	54,048,954	1,654.32	54,592,587	1.990	2025/4/9	0.80
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,100,000	1,716.00	53,196,191	1,740.04	53,941,517	3.290	2029/5/23	0.79
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,100,000	1,722.15	53,386,776	1,727.68	53,558,100	3.290	2023/10/18	0.78
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,720,000,000	3.05	52,584,383	3.01	51,858,746	7.500	2026/8/26	0.76
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,550,000	2,030.62	51,780,843	2,030.62	51,780,843		2022/7/1	0.75
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,830,000	586.59	51,796,066	576.68	50,921,492	8.000	2023/12/7	0.74

中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000	1,674.75	50,242,797	1,697.07	50,912,277	2.850	2027/6/4	0.74
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000	1,630.25	48,907,731	1,655.27	49,658,122	2.680	2030/5/21	0.72
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,800,000	567.76	49,963,627	560.84	49,354,379	6.750	2023/3/9	0.72
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,510,000	630.17	47,326,087	639.26	48,008,465	8.500	2037/1/31	0.70
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,580,000	2,958.03	46,736,930	2,942.12	46,485,523	2.500	2023/1/25	0.68
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	5,700,000,000	0.78	45,014,420	0.80	45,745,920	6.500	2025/6/15	0.67
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,800,000	588.91	45,935,239	578.92	45,156,220	8.000	2024/9/5	0.66
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	5,400,000,000	0.82	44,672,040	0.83	45,020,880	8.375	2024/3/15	0.66
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,440,000	3,068.77	44,190,423	3,123.10	44,972,653	2.750	2028/4/25	0.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.71
合計	97.71

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。

F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,035,849,185	99.44
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		17,148,608	0.56
合計(純資産総額)		3,052,997,793	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		3,033,654,809	99.37

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,392,881,836	1.2630	3,022,342,821	1.2687	3,035,849,185	99.44

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.44
合計	99.44

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	27,714,000.00	3,035,689,445	3,033,654,809	99.37

(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。

ゴールド・マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	150,864,170,653	99.98
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		36,918,028	0.02
合計(純資産総額)		150,901,088,681	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		16,423,065	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	iシェアーズ ゴールド・トラスト	27,875,000	3,543.09	98,763,812,150	3,813.53	106,302,335,512	70.45
アメリカ	投資信託受益 証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	17,800,000	1,857.38	33,061,409,887	1,992.71	35,470,380,400	23.51
アメリカ	投資信託受益 証券	SPDR GOLD TRUST-ETF	485,100	17,742.65	8,606,962,148	18,741.40	9,091,454,741	6.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.98
合 計	99.98

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	150,000.00	16,422,120	16,423,065	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。

インデックス マザーファンド TOPIX

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	42,595,914,890	99.70
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)		128,862,217	0.30
合計 (純資産総額)		42,724,777,107	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	133,350,000	0.31

(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	165,500	8,425.23	1,394,375,760	9,805.00	1,622,727,500	3.80
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	102,400	11,840.49	1,212,466,382	11,375.00	1,164,800,000	2.73
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,000	57,611.76	921,788,283	60,740.00	971,840,000	2.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	127,300	9,776.76	1,244,581,890	6,837.00	870,350,100	2.04
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,102,400	529.95	584,226,414	578.50	637,738,400	1.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	111,900	5,135.54	574,667,596	5,629.00	629,885,100	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	9,400	66,291.17	623,137,000	56,400.00	530,160,000	1.24
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	187,700	2,806.46	526,773,046	2,802.50	526,029,250	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	29,600	18,298.60	541,638,835	17,750.00	525,400,000	1.23
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	135,900	3,690.98	501,604,811	3,682.00	500,383,800	1.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	78,600	4,906.76	385,671,722	6,258.00	491,878,800	1.15
日本	株式	HOYA	精密機器	31,900	13,084.55	417,397,371	15,405.00	491,419,500	1.15
日本	株式	日本電産	電気機器	39,300	14,779.18	580,821,800	12,240.00	481,032,000	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,800	23,019.66	478,809,048	22,665.00	471,432,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	128,600	3,026.21	389,171,032	3,493.00	449,199,800	1.05
日本	株式	村田製作所	電気機器	48,000	9,737.86	467,417,325	9,040.00	433,920,000	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,600	43,108.75	413,844,000	44,920.00	431,232,000	1.01
日本	株式	KDDI	情報・通信業	128,700	3,318.28	427,062,700	3,332.00	428,828,400	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,500	3,606.72	402,150,065	3,695.00	411,992,500	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	112,500	3,121.83	351,206,272	3,232.00	363,600,000	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	14,300	28,035.58	400,908,932	24,380.00	348,634,000	0.82
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	218,900	1,531.44	335,232,305	1,565.50	342,687,950	0.80
日本	株式	三井物産	卸売業	128,300	2,015.05	258,532,154	2,499.50	320,685,850	0.75
日本	株式	S M C	機械	4,800	66,443.18	318,927,289	64,800.00	311,040,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	62,900	4,151.39	261,122,588	4,868.00	306,197,200	0.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	97,900	2,856.43	279,644,970	3,062.00	299,769,800	0.70
日本	株式	第一三共	医薬品	128,400	3,242.30	416,311,740	2,159.50	277,279,800	0.65

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	53,100	5,527.89	293,531,422	5,210.00	276,651,000	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	14,700	16,062.17	236,114,000	18,565.00	272,905,500	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	36,000	6,978.29	251,218,512	7,482.00	269,352,000	0.63

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.35
		食料品	3.37
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.10
		医薬品	5.04
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.80
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.63
		機械	5.50
		電気機器	18.40
		輸送用機器	8.07
		精密機器	2.79
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.20
		陸運業	3.27
		海運業	0.36
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.48
		卸売業	4.87
		小売業	4.56
		銀行業	4.91
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	1.89
その他金融業	1.12		
不動産業	1.98		
サービス業	5.67		
合計		99.70	

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09月	買建		7日本円	136,298,850	133,350,000	0.31

(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。

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ベルギー	29,783,396,772	40.71
	スウェーデン	384,320,179	0.53
	小計	30,167,716,951	41.24
地方債証券	カナダ	5,590,968,875	7.64
	オーストラリア	2,704,294,027	3.70
	小計	8,295,262,902	11.34
特殊債券	カナダ	8,922,705,886	12.20
	ドイツ	1,845,001,410	2.52
	オランダ	2,104,832,084	2.88
	オーストリア	799,256,217	1.09
	ノルウェー	2,438,387,724	3.33
	国際機関	15,806,470,783	21.61
小計	31,916,654,104	43.63	
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,773,381,063	3.79
合計（純資産総額）		73,153,015,020	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		70,052,719,624	95.76

(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 (%)
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	90,500,000	14,632.00	13,241,960,083	14,560.47	13,177,234,391	1.000	2031/6/22	18.01
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	56,900,000	14,395.37	8,190,965,757	14,322.11	8,149,285,409	0.900	2029/6/22	11.14
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	69,500,000	9,129.21	6,344,801,784	8,948.16	6,218,974,102	1.750	2030/6/15	8.50
国際機関	特殊債券	EUROFIMA	58,560,000	9,308.06	5,450,801,250	9,218.42	5,398,312,458	3.350	2029/5/21	7.38
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	305,000,000	1,688.50	5,149,942,080	1,666.78	5,083,679,488	3.750	2032/6/1	6.95
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF ALBERTA	35,000,000	12,514.55	4,380,095,333	12,387.31	4,335,560,002	3.300	2028/3/15	5.93
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	18,600,000	17,566.39	3,267,349,123	17,976.36	3,343,603,799	3.000	2034/6/22	4.57
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	19,900,000	14,728.10	2,930,893,509	15,018.85	2,988,752,646	1.250	2033/4/22	4.09
ノルウェー	特殊債券	KOMMUNALBANKEN AS	27,990,000	8,742.27	2,446,963,712	8,711.63	2,438,387,724	2.400	2029/11/21	3.33
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	15,800,000	13,460.99	2,126,836,507	13,446.33	2,124,520,527	0.100	2030/6/22	2.90
国際機関	特殊債券	NORDIC INVESTMENT BANK	132,500,000	1,575.49	2,087,532,794	1,562.60	2,070,454,922	2.940	2031/10/17	2.83
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	17,000,000	11,932.22	2,028,477,434	11,821.76	2,009,700,337	2.250	2029/6/18	2.75
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	23,400,000	8,481.30	1,984,624,459	8,399.89	1,965,575,020	1.100	2031/3/15	2.69
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	13,800,000	8,083.84	1,115,570,464	8,122.77	1,120,943,414	1.500	2031/9/10	1.53
オランダ	特殊債券	BNG BANK NV	12,000,000	9,347.41	1,121,689,920	9,254.73	1,110,568,791	3.300	2029/4/26	1.52
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	10,000,000	10,468.79	1,046,879,065	10,440.52	1,044,052,088	0.750	2030/9/23	1.43
ドイツ	特殊債券	KFW	9,600,000	10,466.14	1,004,750,314	10,471.98	1,005,310,740	0.750	2030/9/30	1.37
オランダ	特殊債券	NEDER WATERSCHAPSBANK	10,750,000	9,319.78	1,001,876,923	9,248.96	994,263,293	3.300	2029/5/2	1.36
ドイツ	特殊債券	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	10,000,000	8,436.62	843,662,190	8,396.90	839,690,670	1.900	2030/1/30	1.15
オーストラリア	地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	10,000,000	8,392.30	839,230,415	8,354.67	835,467,190	1.750	2031/10/22	1.14
オーストラリア	特殊債券	OEBK OEST. KONTROLLBANK	60,000,000	1,336.83	802,099,199	1,332.09	799,256,217	1.370	2028/11/13	1.09
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	8,000,000	9,457.73	756,618,624	9,226.95	738,156,764	2.100	2029/9/15	1.01
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	6,000,000	10,926.04	655,562,522	10,898.89	653,933,606	1.350	2030/5/28	0.89
カナダ	地方債証券	PROVINCE OF QUEBEC	5,000,000	12,178.86	608,943,306	12,029.50	601,475,267	2.750	2027/4/12	0.82
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	7,000,000	8,189.50	573,265,056	8,178.21	572,474,949	1.500	2030/11/20	0.78
スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	30,000,000	1,257.67	377,303,040	1,281.06	384,320,179	0.125	2031/5/12	0.53
国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	1,300,000	15,501.01	201,513,252	15,405.49	200,271,490	4.375	2044/1/24	0.27
オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP	1,000,000	9,306.17	93,061,774	9,206.79	92,067,948	3.000	2030/2/20	0.13
オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY CORP	1,000,000	8,002.87	80,028,759	8,334.05	83,340,526	1.750	2031/8/21	0.11

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	41.24
地方債証券	11.34
特殊債券	43.63
合 計	96.21

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	89,487,000.00	9,901,040,375	9,791,271,380	13.38
	加ドル	売建	101,001,000.00	9,034,600,517	8,865,312,274	12.12
	ユーロ	売建	227,900,000.00	30,132,594,646	29,669,228,490	40.56
	スウェーデンクローナ	売建	647,720,000.00	8,301,436,367	8,290,816,000	11.33
	豪ドル	売建	166,200,000.00	13,673,547,370	13,436,091,480	18.37

(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。

インデックス マザーファンド リート

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	29,537,590,800	98.27
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		520,867,409	1.73
合計(純資産総額)		30,058,458,209	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	507,046,000	1.69

(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	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,826	726,743.72	2,053,777,752	708,000	2,000,808,000	6.66
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,494	693,779.13	1,730,285,150	687,000	1,713,378,000	5.70
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	8,076	189,633.49	1,531,480,065	196,500	1,586,934,000	5.28
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,951	354,997.6	1,402,595,517	366,000	1,446,066,000	4.81
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	12,582	117,002.3	1,472,122,938	114,500	1,440,639,000	4.79
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	8,064	181,149.7	1,460,791,180	174,100	1,403,942,400	4.67
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	3,558	330,838.26	1,177,122,529	326,000	1,159,908,000	3.86
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	4,969	210,894.65	1,047,935,515	209,000	1,038,521,000	3.46
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,493	368,692.11	919,149,431	373,500	931,135,500	3.10
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	5,614	158,566.66	890,193,232	161,100	904,415,400	3.01
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	3,541	207,741.86	735,613,926	211,900	750,337,900	2.50
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	7,335	92,264.23	676,758,127	96,600	708,561,000	2.36
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,639	444,097.3	727,875,478	428,000	701,492,000	2.33
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	771	783,885.2	604,375,489	807,000	622,197,000	2.07
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,250	504,959.86	631,199,825	497,500	621,875,000	2.07
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,053	182,883.94	558,344,668	201,000	613,653,000	2.04
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	861	640,199.46	551,211,735	671,000	577,731,000	1.92
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	927	594,229.77	550,851,000	614,000	569,178,000	1.89
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,630	328,393.88	535,282,024	332,500	541,975,000	1.80
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	7,640	68,953.3	526,803,212	66,700	509,588,000	1.70
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	10,976	45,656.15	501,121,927	43,050	472,516,800	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	2,932	164,522.87	482,381,054	161,100	472,345,200	1.57
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	874	518,221.5	452,925,591	508,000	443,992,000	1.48
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	2,698	157,679.99	425,420,624	159,500	430,331,000	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,192	183,399.64	402,012,015	193,800	424,809,600	1.41
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	527	790,382.77	416,531,719	790,000	416,330,000	1.39
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	1,703	234,999.95	400,204,914	237,300	404,121,900	1.34
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,123	355,308.69	399,011,658	350,500	393,611,500	1.31
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	3,262	119,951.95	391,283,260	120,400	392,744,800	1.31

日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	15,850	22,584.31	357,961,313	22,750	360,587,500	1.20
----	------	----------------------------	--------	-----------	-------------	--------	-------------	------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.27
合計	98.27

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REIT指数先物 2021年09月	買建	236	日本円	504,179,610	507,046,000	1.69

(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。

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

以下の運用状況は2021年7月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	46,683,623	44.51
	カナダ	1,950,546	1.86
	メキシコ	790,934	0.75
	ドイツ	7,782,630	7.42
	イタリア	9,831,543	9.37
	フランス	10,428,931	9.94
	オランダ	1,987,173	1.89
	スペイン	6,101,601	5.82
	ベルギー	2,367,681	2.26
	オーストリア	1,629,492	1.55
	フィンランド	609,374	0.58
	アイルランド	909,715	0.87
	イギリス	6,889,260	6.57
	スウェーデン	272,259	0.26
ノルウェー	315,361	0.30	
デンマーク	509,606	0.49	

	ポーランド	608,675	0.58
	オーストラリア	2,185,944	2.08
	シンガポール	451,553	0.43
	マレーシア	543,385	0.52
	イスラエル	373,371	0.36
	小計	103,222,657	98.41
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,665,229	1.59
合計（純資産総額）		104,887,886	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	85,000	11,865.76	10,085,899	11,898.05	10,113,345	2.375	2027/5/15	9.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	84,000	11,598.02	9,742,343	11,612.35	9,754,378	2.375	2024/8/15	9.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	76,000	11,226.35	8,532,033	11,228.28	8,533,496	1.625	2023/4/30	8.14
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,000	15,368.36	7,530,501	15,395.31	7,543,704	4.375	2038/2/15	7.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,000	11,181.23	4,696,119	11,178.02	4,694,772	1.875	2022/9/30	4.48
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	22,000	18,103.89	3,982,857	18,199.63	4,003,919	5.250	2029/11/1	3.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,000	13,184.34	3,427,930	13,221.77	3,437,661	2.875	2049/5/15	3.28
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	22,000	13,568.56	2,985,085	13,599.74	2,991,944	0.500	2025/5/25	2.85
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	19,000	14,185.71	2,695,285	14,210.18	2,699,935	2.000	2025/12/1	2.57
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	13,000	18,958.80	2,464,645	19,042.03	2,475,465	5.500	2029/4/25	2.36
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	11,000	21,208.47	2,332,932	21,358.30	2,349,413	4.750	2035/4/25	2.24
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000	22,272.41	2,227,240	22,544.05	2,254,405	4.900	2040/7/30	2.15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,000	17,935.37	2,152,245	18,003.90	2,160,469	5.150	2028/10/31	2.06
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000	21,264.05	2,126,406	21,489.33	2,148,933	4.750	2044/9/1	2.05
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	9,000	23,084.76	2,077,629	23,274.12	2,094,671	4.500	2041/4/25	2.00
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000	18,706.90	1,683,621	18,768.31	1,689,148	6.500	2027/7/4	1.61
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000	14,020.58	1,542,264	14,044.13	1,544,855	1.600	2025/4/30	1.47
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000	25,186.00	1,511,160	25,530.60	1,531,836	4.750	2040/7/4	1.46
オーストラリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000	21,140.28	1,479,820	21,318.54	1,492,298	4.150	2037/3/15	1.42
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	8,000	18,323.82	1,465,906	18,374.92	1,469,994	5.500	2028/3/28	1.40
イギリス	国債証券	UK TREASURY	6,000	21,005.36	1,260,321	21,091.80	1,265,508	4.750	2030/12/7	1.21
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000	9,539.96	1,240,195	9,566.69	1,243,670	1.375	2050/8/15	1.19
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000	20,582.38	1,234,943	20,709.41	1,242,565	5.500	2031/1/4	1.18
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000	13,596.12	1,223,651	13,632.80	1,226,952	0.500	2025/2/15	1.17

イギリス	国債証券	UK TREASURY	5,000	23,890.34	1,194,517	24,228.54	1,211,427	4.250	2040/12/7	1.15
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,000	10,863.05	1,194,936	10,990.15	1,208,917	4.500	2033/4/21	1.15
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000	21,598.56	1,079,928	21,837.86	1,091,893	4.000	2037/1/4	1.04
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	11,000	9,294.17	1,022,359	9,302.85	1,023,314	2.250	2025/6/1	0.98
イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM GILT	6,000	16,365.21	981,913	16,396.71	983,803	2.000	2025/9/7	0.94
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000	14,006.47	980,453	13,982.22	978,756	5.500	2022/11/1	0.93

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.41
合 計	98.41

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。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	メキシコ	438,668,392	3.83
	ブラジル	1,560,936,593	13.61
	チリ	413,718,085	3.61
	ギリシャ	150,661,394	1.31
	トルコ	212,284,947	1.85
	チェコ	284,841,095	2.48
	ポーランド	355,387,724	3.10
	ロシア	149,083,855	1.30
	ケイマン	935,662,083	8.16
	香港	91,278,472	0.80
	マレーシア	302,023,171	2.63
	タイ	201,136,162	1.75
	インドネシア	593,951,020	5.18
	韓国	326,218,580	2.85

	台湾	330,652,054	2.88
	中国	1,660,448,171	14.48
	インド	2,425,801,006	21.16
	エジプト	78,890,282	0.69
	南アフリカ	728,229,524	6.35
	サウジアラビア	97,263,936	0.85
	小計	11,337,136,546	98.89
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		127,748,099	1.11
合計（純資産総額）		11,464,884,645	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	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 (%)
ブラジル	株式	TELEFONICA BRASIL-ADR	電気通信 サービス	345,600	982.12	339,422,504	891.24	308,015,516	2.69
ブラジル	株式	TIM SA-ADR	電気通信 サービス	236,946	1,356.58	321,436,466	1,240.52	293,936,655	2.56
インド	株式	NESTLE INDIA LIMITED	食品・飲料・タバコ	10,968	26,152.56	286,841,300	26,513.82	290,803,687	2.54
チェコ	株式	KOMERCNI BANKA AS	銀行	69,900	3,927.07	274,502,682	4,074.97	284,841,095	2.48
ブラジル	株式	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	食品・生活必需品 小売り	664,000	474.23	314,894,341	414.55	275,264,294	2.40
ブラジル	株式	AMBEV SA-ADR	食品・飲料・タバコ	754,100	402.92	303,844,385	364.60	274,946,142	2.40
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	79,315	3,674.69	291,458,196	3,455.43	274,067,431	2.39
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	食品・生活必需品 小売り	748,900	351.33	263,116,075	360.42	269,925,070	2.35
インド	株式	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	自動車・自動車部品	24,628	10,299.83	253,664,411	10,350.38	254,909,159	2.22
中国	株式	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	食品・飲料・タバコ	215,634	1,481.64	319,492,471	1,175.01	253,372,945	2.21
インドネシア	株式	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	自動車・自動車部品	7,025,000	37.96	266,722,025	35.34	248,263,500	2.17
南アフリカ	株式	KUMBA IRON ORE LTD	素材	41,607	4,518.69	188,009,213	5,852.76	243,516,130	2.12
南アフリカ	株式	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	素材	16,700	11,864.37	198,135,031	14,483.33	241,871,701	2.11
インド	株式	AMBUJA CEMENTS LIMITED	素材	397,192	505.12	200,631,211	604.94	240,281,300	2.10
インドネシア	株式	UNILEVER INDONESIA TBK PT	家庭用品・パーソナル用品	7,120,000	37.52	267,157,978	32.90	234,304,960	2.04

中国	株式	CHONGQING BREWERY CO-A	食品・飲料・タバコ	76,000	3,138.45	238,522,398	2,908.39	221,038,137	1.93
中国	株式	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	食品・飲料・タバコ	113,290	2,168.59	245,679,766	1,924.47	218,023,759	1.90
インド	株式	SIEMENS LTD	資本財	73,700	2,995.59	220,775,277	2,891.40	213,096,327	1.86
ブラジル	株式	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	公益事業	256,750	886.84	227,698,524	824.58	211,712,084	1.85
中国	株式	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	耐久消費財・アパレル	232,524	1,115.21	259,313,756	893.96	207,868,554	1.81
中国	株式	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	食品・飲料・タバコ	474,531	529.64	251,331,343	432.66	205,314,394	1.79
インド	株式	ACC LTD	素材	56,400	3,001.29	169,272,869	3,498.72	197,327,808	1.72
ポーランド	株式	SANTANDER BANK POLSKA SA	銀行	25,875	7,261.37	187,887,961	7,372.38	190,760,415	1.66
インド	株式	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	保険	198,000	858.40	169,963,200	941.79	186,476,004	1.63
南アフリカ	株式	VODACOM GROUP LTD	電気通信サービス	181,662	1,000.30	181,716,501	974.12	176,960,969	1.54
ケイマン	株式	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	家庭用品・パーソナル用品	580,000	336.25	195,025,993	299.41	173,659,250	1.51
タイ	株式	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	電気通信サービス	290,500	577.07	167,639,000	594.40	172,674,652	1.51
メキシコ	株式	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	家庭用品・パーソナル用品	938,500	196.46	184,377,793	179.80	168,743,322	1.47
ポーランド	株式	ORANGE POLSKA SA	電気通信サービス	763,000	186.44	142,257,107	215.76	164,627,309	1.44
インド	株式	INDUS TOWERS LTD	電気通信サービス	499,000	364.30	181,786,698	328.48	163,914,514	1.43

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	1.30
		素材	11.87
		資本財	1.86
		商業・専門サービス	2.06
		自動車・自動車部品	6.15
		耐久消費財・アパレル	1.81
		メディア・娯楽	0.22
		小売	4.12
		食品・生活必需品小売り	4.76
		食品・飲料・タバコ	14.74
		家庭用品・パーソナル用品	8.76
		ヘルスケア機器・サービス	2.04
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.80
		銀行	13.98
		各種金融	1.11
保険	2.44		

	電気通信サービス	13.98
	公益事業	4.27
	半導体・半導体製造装置	2.62
合 計		98.89

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。

インデックス マザーファンド コモディティ

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ドイツ	11,285,090	99.57
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		48,453	0.43
合計(純資産総額)		11,333,543	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
ドイツ	投資信託受益 証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	4,180	2,641.23	11,040,353	2,699.78	11,285,090	99.57

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.57
合 計	99.57

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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

英国証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して7営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

・委託会社は、投資対象とする投資信託証券からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の

停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

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

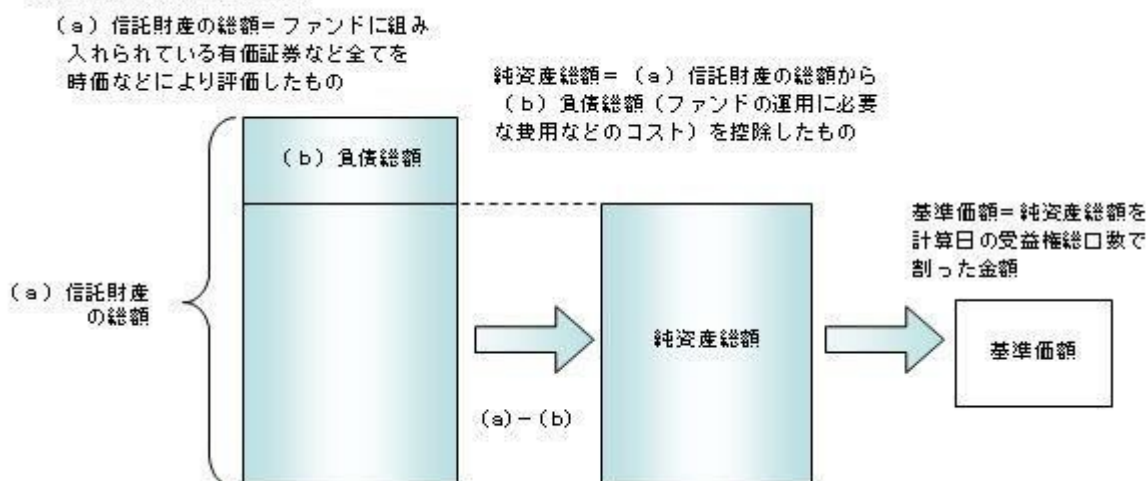
3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当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>
投資信託証券（国内籍）
原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。
- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2026年7月17日までとします（2016年8月22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7月18日から翌年7月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」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) 2026年6月30日以前の毎営業日において、この信託の1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合
 - ロ) 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、書面決議が困難な場合
 - ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ニ) 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たときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
 - ホ) 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
- 4) 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。

信託約款の変更など

- 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、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容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または併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 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「書面決議」の規定を適用します。

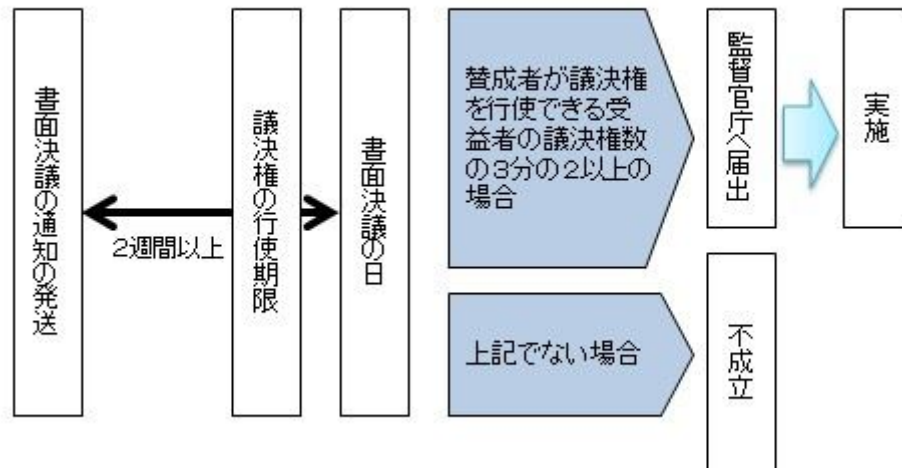
書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行

ないます。

- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、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/

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。
- ・投資顧問会社との投資顧問契約は、当ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

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5期計算期間(2020年7月18日から2021年7月19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】

【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年 7月17日現在	第5期 2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,001,244	11,784,349
投資信託受益証券	88,012,823	91,445,002
親投資信託受益証券	251,488,092	254,547,377
流動資産合計	351,502,159	357,776,728
資産合計	351,502,159	357,776,728
負債の部		
流動負債		
未払解約金	150,000	-
未払受託者報酬	56,672	57,680
未払委託者報酬	1,512,733	1,539,826
未払利息	11	8
その他未払費用	355,946	343,415
流動負債合計	2,075,362	1,940,929
負債合計	2,075,362	1,940,929
純資産の部		
元本等		
元本	323,928,293	289,384,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	25,498,504	66,451,410
(分配準備積立金)	25,821,700	66,740,138
元本等合計	349,426,797	355,835,799
純資産合計	349,426,797	355,835,799
負債純資産合計	351,502,159	357,776,728

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自 2019年 7月18日	至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日	至 2021年 7月19日
営業収益				
受取利息		10		3
有価証券売買等損益		8,893,681		49,265,470
営業収益合計		8,893,691		49,265,473
営業費用				
支払利息		3,720		1,657
受託者報酬		119,706		115,820
委託者報酬		3,195,181		3,091,861
その他費用		364,450		351,109
営業費用合計		3,683,057		3,560,447
営業利益又は営業損失()		5,210,634		45,705,026
経常利益又は経常損失()		5,210,634		45,705,026
当期純利益又は当期純損失()		5,210,634		45,705,026
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()		1,114,297		2,032,934
期首剰余金又は期首欠損金()		24,582,283		25,498,504
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
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		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,180,116		2,719,186
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,180,116		2,719,186
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		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		25,498,504		66,451,410

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年7月18日から翌年7月17日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年7月18日から2021年7月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第4期 2020年7月17日現在	第5期 2021年7月19日現在
1.	期首元本額	372,060,512円	323,928,293円
	期中追加設定元本額	- 円	- 円
	期中一部解約元本額	48,132,219円	34,543,904円
2.	受益権の総数	323,928,293口	289,384,389口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年7月18日 至 2020年7月17日		第5期 自 2020年7月18日 至 2021年7月19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	2,950,223円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 4,791,391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	1,146,114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 38,880,701円
C	信託約款に定める収益調整金	56,420円	C 信託約款に定める収益調整金 50,406円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	21,725,363円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 23,068,046円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	25,878,120円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 66,790,544円
F	分配対象収益(1万口当たり)	798円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,308円
G	分配金額	0円	G 分配金額 0円
H	分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり) 0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4期 自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	第5期 自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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4期 2020年 7月17日現在	第5期 2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (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4期（2020年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	3,435,866
親投資信託受益証券	6,238,072
合計	9,673,938

第5期（2021年 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	20,210,888
親投資信託受益証券	21,749,503
合計	41,960,391

（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4期 2020年 7月17日現在		第5期 2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.0787円	1口当たり純資産額	1.2296円
(1万口当たり純資産額)	(10,787円)	(1万口当たり純資産額)	(12,296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
投資信託受益証券	F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	11,645,780	14,871,661	
	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）	23,934,418	50,312,540	
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	14,730,851	20,847,100	
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	4,597,623	5,413,701	
投資信託受益証券 合計		54,908,672	91,445,002	
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	24,324,040	60,617,940	
	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド	76,702,036	105,572,682	
	インデックス マザーファンド Jリート	18,691,609	27,973,862	
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	4,009,959	5,296,754	
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	41,044,359	49,885,313	
	インデックス マザーファンド コモディティ	5,055,727	5,200,826	
親投資信託受益証券 合計		169,827,730	254,547,377	
合計		224,736,402	345,992,379	

(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、「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）」「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」「F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」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「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同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。

また、当ファンドは、「インデックス マザーファンド T O P I X」「ソブリン（円ヘッジ）マザーファ

ンド」「インデックス マザーファンド 」リート」「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」「先進国資本エマージング株式マザーファンド」「インデックス マザーファンド コモディティ」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)

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)

貸借対照表

(単位:円)		
	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,866,602	1,250,814
親投資信託受益証券	178,777,075	113,399,444
流動資産合計	180,643,677	114,650,258
資産合計	180,643,677	114,650,258
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,322	2,190
未払委託者報酬	6,658	4,395
未払利息	1	-
その他未払費用	128,912	121,972
流動負債合計	138,893	128,557
負債合計	138,893	128,557
純資産の部		
元本等		
元本	118,306,879	54,480,642
剰余金		
剰余金又は欠損金()	62,197,905	60,041,059
(分配準備積立金)	37,689,291	48,639,932
元本等合計	180,504,784	114,521,701
純資産合計	180,504,784	114,521,701
負債純資産合計	180,643,677	114,650,258

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)

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	139,725,303円	118,306,879円
	期首からの追加設定元本額	40,672,632円	853,158円
	期首からの一部解約元本額	62,091,056円	64,679,395円
2.	受益権の総数	118,306,879口	54,480,642口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,159,977
合計	8,159,977

(2021年 7月19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	660,398
合計	660,398

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.5257円	1口当たり純資産額	2.1021円
(1万口当たり純資産額)	(15,257円)	(1万口当たり純資産額)	(21,021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
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	30,018,118	113,399,444	
合計		30,018,118	113,399,444	

(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。

「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）」は、「海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（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。

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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,212,929,118	1,280,759,899
コール・ローン	953,597,712	3,017,323,964
株式	233,084,010,500	229,180,032,954
投資証券	5,734,916,802	5,507,243,160
派生商品評価勘定	108,643,792	52,479,352
未収入金	9,160,188	1,484,823

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
未収配当金	192,240,989	145,692,290
差入委託証拠金	979,494,461	593,309,159
流動資産合計	242,274,993,562	239,778,325,601
資産合計	242,274,993,562	239,778,325,601
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,806,375	18,819,890
未払解約金	287,587,607	17,954,359
未払利息	790	2,270
流動負債合計	289,394,772	36,776,519
負債合計	289,394,772	36,776,519
純資産の部		
元本等		
元本	88,927,779,693	63,462,796,864
剰余金		
剰余金又は欠損金()	153,057,819,097	176,278,752,218
元本等合計	241,985,598,790	239,741,549,082
純資産合計	241,985,598,790	239,741,549,082
負債純資産合計	242,274,993,562	239,778,325,601

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	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	54,317,132,526円	88,927,779,693円
	期首からの追加設定元本額	49,853,572,960円	4,959,704,340円
	期首からの一部解約元本額	15,242,925,793円	30,424,687,169円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	20,700,524,661円	23,953,446,187円
	DCインデックスバランス（株式20）	128,876,857円	113,679,085円
	DCインデックスバランス（株式40）	325,996,096円	296,611,572円
	DCインデックスバランス（株式60）	620,009,189円	585,577,778円
	DCインデックスバランス（株式80）	629,217,786円	627,986,873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	1,849,038,998円	1,521,002,234円
	日興五大陸株式ファンド	4,735,308,855円	4,122,332,976円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	65,700,296円	30,018,118円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	145,287,200円	105,528,201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）	6,643,057,674円	6,469,886,348円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	44,786,951,988円	18,703,327,505円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,900,938円	3,821,303円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,047,021円	2,963,353円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	5,715,794円	4,067,868円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	5,372,839円	3,517,920円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,658,503,134円	2,533,639,551円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	28,021,258円	20,797,394円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	75,855,066円	59,173,963円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	110,849,277円	89,225,692円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	105,811,497円	86,137,582円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,298,733,269円	4,130,055,361円
	計	88,927,779,693円	63,462,796,864円
2.	受益権の総数	88,927,779,693口	63,462,796,864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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,192,225,483
投資証券	1,045,874,845
合計	7,146,350,638

(2021年 7月19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	44,828,940,557
投資証券	1,195,891,246
合計	46,024,831,803

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,138,426,152	-	3,235,659,844	97,233,692
合計		3,138,426,152	-	3,235,659,844	97,233,692

(2021年 7月19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	5,178,564,664	-	5,231,044,016	52,479,352
合計		5,178,564,664	-	5,231,044,016	52,479,352

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	1,159,038,800	-	1,169,172,000	10,133,200	
	米ドル	813,760,840	-	814,901,000	1,140,160	
	ユーロ	345,277,960	-	354,271,000	8,993,040	
	売建	201,549,125	-	202,078,600	529,475	
	米ドル	171,144,000	-	171,632,000	488,000	
	シンガポールドル	30,405,125	-	30,446,600	41,475	
合計		1,360,587,925	-	1,371,250,600	9,603,725	

(2021年 7月19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	3,353,771,580	-	3,334,951,690	18,819,890	
	米ドル	2,655,612,050	-	2,647,334,760	8,277,290	
	ユーロ	698,159,530	-	687,616,930	10,542,600	

合計	3,353,771,580	-	3,334,951,690	18,819,890
----	---------------	---	---------------	------------

(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)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	2.7211円	1口当たり純資産額	3.7777円
(1万口当たり純資産額)	(27,211円)	(1万口当たり純資産額)	(37,777円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES CO	25,945	20.60	534,467.00	
	CHENIERE ENERGY INC	8,760	83.56	731,985.60	
	CHEVRON CORP	75,971	98.62	7,492,260.02	
	CONOCOPHILLIPS	53,256	55.50	2,955,708.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	23,000	25.78	592,940.00	
	EOG RESOURCES INC	24,062	73.91	1,778,422.42	
	EXXON MOBIL CORP	166,921	57.32	9,567,911.72	
	HALLIBURTON CO	34,687	20.06	695,821.22	
	HESS CORP	10,910	76.37	833,196.70	
	KINDER MORGAN INC	80,380	17.64	1,417,903.20	

MARATHON PETROLEUM CORP	27,132	53.26	1,445,050.32
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	37,921	25.94	983,670.74
ONEOK INC	17,040	53.31	908,402.40
PHILLIPS 66	16,285	74.48	1,212,906.80
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,570	140.94	1,207,855.80
SCHLUMBERGER LTD	51,631	27.87	1,438,955.97
VALERO ENERGY CORP	16,882	64.88	1,095,304.16
WILLIAMS COS INC	50,374	25.28	1,273,454.72
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,725	285.54	2,491,336.50
ALBEMARLE CORP	4,890	180.66	883,427.40
AMCOR PLC	67,580	11.44	773,115.20
AVERY DENNISON CORP	3,200	203.29	650,528.00
BALL CORP	13,280	85.75	1,138,760.00
CELANESE CORP	5,120	152.35	780,032.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,070	47.16	427,741.20
CORTEVA INC	28,232	41.81	1,180,379.92
CROWN HOLDINGS INC	5,235	103.80	543,393.00
DOW INC	30,625	60.01	1,837,806.25
DUPONT DE NEMOURS INC	22,262	76.21	1,696,587.02
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	109.20	556,374.00
ECOLAB INC	9,820	215.28	2,114,049.60
FMC CORP	5,140	105.14	540,419.60
FREEMONT-MCMORAN INC	56,488	33.20	1,875,401.60
INTERNATIONAL PAPER CO	15,950	59.13	943,123.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,315	143.42	1,335,957.30
LINDE PLC	20,830	290.07	6,042,158.10
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	96.14	966,207.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,425	351.49	852,363.25
MOSAIC CO/THE	14,870	29.59	440,003.30
NEWMONT CORP	30,352	61.73	1,873,628.96
NUCOR CORP	12,939	92.04	1,190,905.56
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	134.92	483,013.60
PPG INDUSTRIES INC	8,774	170.20	1,493,334.80
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	88.94	497,174.60
SEALED AIR CORP	7,116	55.99	398,424.84
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,921	282.41	2,801,789.61
STEEL DYNAMICS INC	7,510	59.88	449,698.80
VULCAN MATERIALS CO	5,383	175.35	943,909.05
WESTROCK CO	10,519	49.01	515,536.19
3M CO	22,886	199.37	4,562,781.82
ALLEGION PLC	3,850	138.50	533,225.00
AMETEK INC	8,943	136.23	1,218,304.89

BOEING CO/THE	21,282	217.74	4,633,942.68
CARRIER GLOBAL CORP	34,588	49.08	1,697,579.04
CATERPILLAR INC	21,556	207.95	4,482,570.20
CUMMINS INC	6,235	238.62	1,487,795.70
DEERE & CO	11,810	342.49	4,044,806.90
DOVER CORP	6,280	154.95	973,086.00
EATON CORP PLC	15,806	152.74	2,414,208.44
EMERSON ELECTRIC CO	24,390	97.26	2,372,171.40
FASTENAL CO	20,886	53.59	1,119,280.74
FORTIVE CORP	13,254	69.91	926,587.14
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,570	95.41	531,433.70
GENERAC HOLDINGS INC	2,180	430.34	938,141.20
GENERAL DYNAMICS CORP	10,092	189.28	1,910,213.76
GENERAL ELECTRIC CO	347,503	12.55	4,361,162.65
HEICO CORP	2,000	134.50	269,000.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	122.74	304,395.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,856	230.33	6,416,072.48
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	31.66	462,330.98
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,800	200.74	361,332.00
IDEX CORP	2,830	226.67	641,476.10
ILLINOIS TOOL WORKS	12,525	228.39	2,860,584.75
INGERSOLL-RAND INC	12,038	48.16	579,750.08
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,370	63.40	594,058.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,824	69.73	1,940,167.52
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,205	223.76	1,835,950.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	317.91	445,074.00
LOCKHEED MARTIN CORP	9,976	377.14	3,762,348.64
MASCO CORP	11,689	59.14	691,287.46
NORDSON CORP	2,010	221.87	445,958.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,244	362.81	2,265,385.64
OTIS WORLDWIDE CORP	17,404	84.92	1,477,947.68
OWENS CORNING	4,030	92.06	371,001.80
PACCAR INC	14,054	87.61	1,231,270.94
PARKER HANNIFIN CORP	4,780	300.00	1,434,000.00
PENTAIR PLC	5,098	69.09	352,220.82
PLUG POWER INC	19,000	26.01	494,190.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	60,436	83.53	5,048,219.08
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	293.92	1,264,737.76
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,030	485.98	1,958,499.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	54.18	350,544.60
SMITH (A.O.) CORP	4,770	69.91	333,470.70
SNAP-ON INC	1,820	219.80	400,036.00

STANLEY BLACK & DECKER INC	5,886	203.05	1,195,152.30
SUNRUN INC	4,900	46.35	227,115.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,600	434.86	695,776.00
TEXTRON INC	9,246	66.28	612,824.88
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,766	192.26	1,877,611.16
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	633.58	1,381,204.40
UNITED RENTALS INC	3,050	306.08	933,544.00
WABTEC CORP	8,020	81.61	654,512.20
WW GRAINGER INC	1,607	453.19	728,276.33
XYLEM INC	6,308	119.36	752,922.88
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,570	89.45	498,236.50
CINTAS CORP	3,557	386.22	1,373,784.54
CLARIVATE PLC	12,400	25.01	310,124.00
COPART INC	7,730	140.14	1,083,282.20
COSTAR GROUP INC	16,850	87.35	1,471,847.50
EQUIFAX INC	5,214	254.63	1,327,640.82
IHS MARKIT LTD	15,333	114.06	1,748,881.98
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,640	132.04	744,705.60
LEIDOS HOLDINGS INC	4,840	106.28	514,395.20
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	115.24	936,901.20
ROBERT HALF INTL INC	4,405	85.98	378,741.90
ROLLINS INC	9,015	35.97	324,269.55
TRANSUNION	6,640	115.76	768,646.40
VERISK ANALYTICS INC	6,380	186.99	1,192,996.20
WASTE CONNECTIONS INC	10,626	123.08	1,307,848.08
WASTE MANAGEMENT INC	16,744	145.80	2,441,275.20
AMERCO	375	569.58	213,592.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,850	93.30	545,805.00
CSX CORP	90,819	31.51	2,861,706.69
DELTA AIR LINES INC	5,105	40.06	204,506.30
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	126.80	827,623.60
FEDEX CORP	9,928	292.49	2,903,840.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	164.95	541,036.00
KANSAS CITY SOUTHERN	3,860	266.33	1,028,033.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,270	48.81	257,228.70
LYFT INC-A	9,660	53.40	515,844.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,910	260.55	2,582,050.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,815	253.94	968,781.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	49.91	273,007.70
UBER TECHNOLOGIES INC	47,080	46.19	2,174,625.20
UNION PACIFIC CORP	26,746	218.42	5,841,861.32
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,387	210.57	5,977,450.59

XPO LOGISTICS INC	3,480	140.00	487,200.00
APTIV PLC	11,260	149.75	1,686,185.00
AUTOLIV INC	2,540	90.44	229,717.60
BORGWARNER INC	9,890	45.97	454,643.30
FORD MOTOR COMPANY	162,795	13.61	2,215,639.95
GENERAL MOTORS CORP	50,475	55.46	2,799,343.50
LEAR CORP	2,710	163.65	443,491.50
TESLA INC	30,500	644.22	19,648,710.00
DR HORTON INC	12,956	86.30	1,118,102.80
GARMIN LTD	5,865	149.39	876,172.35
HASBRO INC	5,298	94.04	498,223.92
LENNAR CORP-CL A	10,480	95.96	1,005,660.80
LULULEMON ATHLETICA INC	5,140	371.69	1,910,486.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,458	186.16	457,581.28
NEWELL BRANDS INC	16,126	27.04	436,047.04
NIKE INC -CL B	49,848	159.85	7,968,202.80
NVR INC	125	4,800.00	600,000.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	8,740	110.54	966,119.60
PULTE GROUP INC	11,640	51.00	593,640.00
VF CORP	13,620	77.42	1,054,460.40
WHIRLPOOL CORP	2,864	219.86	629,679.04
AIRBNB INC-CLASS A	2,000	134.31	268,620.00
ARAMARK	7,800	34.09	265,902.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,623	2,144.72	3,480,880.56
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,990	89.90	718,301.00
CARNIVAL CORP	28,587	20.92	598,040.04
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,105	1,560.49	1,724,341.45
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	141.74	714,794.82
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	482.68	738,500.40
DRAFTKINGS INC - CL A	6,110	43.79	267,556.90
EXPEDIA GROUP INC	5,912	157.61	931,790.32
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,920	119.75	1,307,670.00
LAS VEGAS SANDS CORP	14,900	47.82	712,518.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	11,353	135.05	1,533,222.65
MCDONALD'S CORP	29,391	234.75	6,899,537.25
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,080	14.93	120,634.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	17,560	37.93	666,050.80
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	72.39	633,267.72
STARBUCKS CORP	46,594	118.73	5,532,105.62
VAIL RESORTS INC	1,520	308.52	468,950.40
WYNN RESORTS LTD	3,510	104.70	367,497.00
YUM! BRANDS INC	12,264	115.85	1,420,784.40

ACTIVISION BLIZZARD INC	30,290	91.80	2,780,622.00
ALPHABET INC-CL A	11,885	2,539.40	30,180,769.00
ALPHABET INC-CL C	11,647	2,636.91	30,712,090.77
ALTICE USA INC- A	10,600	33.63	356,478.00
CABLE ONE INC	160	1,887.49	301,998.40
CHARTER COMMUNICATION-A	5,506	709.99	3,909,204.94
COMCAST CORP-CLASS A	180,314	57.55	10,377,070.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,790	28.18	163,162.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	26.52	329,113.20
DISH NETWORK CORP-A	9,279	39.45	366,056.55
ELECTRONIC ARTS INC	12,164	143.10	1,740,668.40
FACEBOOK INC-CLASS A	95,040	341.16	32,423,846.40
FOX CORP - CLASS A	14,464	35.28	510,289.92
FOX CORP- CLASS B	5,466	33.37	182,400.42
IAC/INTERACTIVECORP	2,740	135.11	370,201.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,566	31.44	395,075.04
LIBERTY BROADBAND-A	760	167.02	126,935.20
LIBERTY BROADBAND-C	6,620	172.30	1,140,626.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	45.60	151,620.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,616	45.09	298,315.44
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,970	47.25	329,332.50
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,060	78.53	475,891.80
MATCH GROUP INC	10,592	161.17	1,707,112.64
NETFLIX INC	17,430	530.31	9,243,303.30
NEWS CORP - CLASS A	18,680	24.22	452,429.60
OMNICOM GROUP	8,337	77.45	645,700.65
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	68.73	1,439,893.50
ROKU INC	4,350	399.99	1,739,956.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.39	301,863.60
SNAP INC - A	37,770	59.31	2,240,138.70
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,020	170.52	856,010.40
THE WALT DISNEY CO.	71,452	179.31	12,812,058.12
TWITTER INC	29,470	66.41	1,957,102.70
VIACOMCBS INC - CLASS B	22,823	40.29	919,538.67
ZILLOW GROUP INC - A	2,710	105.61	286,203.10
ZILLOW GROUP INC - C	5,760	104.15	599,904.00
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,488	205.85	512,154.80
AMAZON.COM INC	16,925	3,573.63	60,483,687.75
AUTOZONE INC	927	1,605.30	1,488,113.10
BEST BUY CO INC	9,554	110.59	1,056,576.86
BURLINGTON STORES INC	2,430	320.48	778,766.40
CARMAX INC	6,249	130.95	818,306.55

CARVANA CO	2,340	313.27	733,051.80
CHEWY INC - CLASS A	3,410	76.98	262,501.80
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,780	222.17	2,172,822.60
DOLLAR TREE INC	9,976	98.19	979,543.44
EBAY INC	27,917	68.18	1,903,381.06
ETSY INC	4,980	184.42	918,411.60
GENUINE PARTS CO	5,611	127.61	716,019.71
HOME DEPOT INC	42,540	321.54	13,678,311.60
L BRANDS INC	9,030	72.75	656,932.50
LKQ CORP	10,810	49.47	534,770.70
LOWE'S COS INC	29,072	196.14	5,702,182.08
MERCADOLIBRE INC	1,765	1,512.51	2,669,580.15
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,835	601.30	1,704,685.50
POOL CORP	1,810	458.89	830,590.90
ROSS STORES INC	14,412	119.49	1,722,089.88
TARGET CORP	19,860	251.15	4,987,839.00
TJX COMPANIES INC	47,166	67.41	3,179,460.06
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,840	189.00	914,760.00
ULTA BEAUTY INC	2,180	332.12	724,021.60
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	280.01	795,228.40
COSTCO WHOLESALE CORP	17,404	410.37	7,142,079.48
KROGER CO	31,870	39.36	1,254,403.20
SYSCO CORP	19,886	71.58	1,423,439.88
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28,602	46.02	1,316,264.04
WALMART INC	62,112	141.56	8,792,574.72
ALTRIA GROUP INC	73,128	47.31	3,459,685.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,383	58.21	1,244,704.43
BOSTON BEER COMPANY INC-A	340	925.09	314,530.60
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	71.96	840,492.80
BUNGE LTD	5,457	73.59	401,580.63
CAMPBELL SOUP CO	5,385	45.53	245,179.05
COCA-COLA CO/THE	161,172	56.40	9,090,100.80
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	60.69	501,299.40
CONAGRA BRANDS INC	19,470	34.86	678,724.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,110	224.01	1,592,711.10
GENERAL MILLS INC	22,559	60.05	1,354,667.95
HERSHEY CO/THE	5,715	179.99	1,028,642.85
HORMEL FOODS CORP	11,500	48.27	555,105.00
JM SMUCKER CO/THE	4,760	133.10	633,556.00
KELLOGG CO	10,528	64.26	676,529.28
KEURIG DR PEPPER INC	23,950	35.88	859,326.00
KRAFT HEINZ CO/THE	28,661	39.30	1,126,377.30

LAMB WESTON HOLDING INC	5,990	77.65	465,123.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,410	87.90	915,039.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,330	50.49	420,581.70
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	56,655	64.26	3,640,650.30
MONSTER BEVERAGE CORP	16,150	93.07	1,503,080.50
PEPSICO INC	54,541	155.82	8,498,578.62
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	61,408	98.90	6,073,251.20
TYSON FOODS INC-CL A	12,276	71.40	876,506.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,680	87.33	845,354.40
CLOROX COMPANY	4,456	186.32	830,241.92
COLGATE-PALMOLIVE CO	31,260	84.39	2,638,031.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,890	324.49	2,884,716.10
KIMBERLY-CLARK CORP	13,773	138.52	1,907,835.96
PROCTER & GAMBLE CO	97,969	140.51	13,765,624.19
ABBOTT LABORATORIES	69,876	117.51	8,211,128.76
ABIOMED INC	1,910	317.98	607,341.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,110	616.12	1,916,133.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	112.88	651,769.12
ANTHEM INC	9,786	393.59	3,851,671.74
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,619	81.42	1,597,378.98
BECTON DICKINSON AND CO	11,477	248.07	2,847,099.39
BOSTON SCIENTIFIC CORP	56,968	42.10	2,398,352.80
CARDINAL HEALTH INC	11,355	56.82	645,191.10
CENTENE CORP	22,967	72.66	1,668,782.22
CERNER CORP	11,120	77.46	861,355.20
CIGNA CORP	14,220	233.83	3,325,062.60
COOPER COS INC/THE	2,190	403.89	884,519.10
CVS HEALTH CORP	51,888	81.72	4,240,287.36
DANAHER CORP	25,209	284.79	7,179,271.11
DAVITA INC	3,068	119.37	366,227.16
DENTSPLY SIRONA INC	9,332	61.16	570,745.12
DEXCOM INC	3,710	448.69	1,664,639.90
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,880	106.92	2,660,169.60
HCA HEALTHCARE INC	10,675	219.20	2,339,960.00
HENRY SCHEIN INC	5,040	75.12	378,604.80
HOLOGIC INC	10,298	69.54	716,122.92
HUMANA INC	5,375	470.90	2,531,087.50
IDEXX LABORATORIES INC	3,530	667.76	2,357,192.80
INSULET CORP	2,710	268.33	727,174.30
INTUITIVE SURGICAL INC	4,660	950.11	4,427,512.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,225	276.45	1,168,001.25
MASIMO CORP	2,020	261.45	528,129.00

MCKESSON CORP	6,604	189.22	1,249,608.88
MEDTRONIC PLC	53,308	125.80	6,706,146.40
MOLINA HEALTHCARE INC	2,550	257.13	655,681.50
NOVOCURE LTD	3,430	182.57	626,215.10
OAK STREET HEALTH INC	3,420	56.32	192,614.40
QUEST DIAGNOSTICS	5,246	134.52	705,691.92
RESMED INC	6,150	253.19	1,557,118.50
STERIS PLC	3,400	207.70	706,180.00
STRYKER CORP	13,303	257.59	3,426,719.77
TELADOC HEALTH INC	4,960	146.78	728,028.80
TELEFLEX INC	1,760	390.32	686,963.20
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,490	419.70	15,734,553.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	151.33	457,016.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,550	315.40	1,750,470.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,920	373.66	1,091,087.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,472	153.40	1,299,604.80
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,770	171.18	474,168.60
ABBVIE INC	69,686	117.50	8,188,105.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,410	148.93	1,699,291.30
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,200	180.03	1,476,246.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,740	177.54	841,539.60
AMGEN INC	23,111	247.96	5,730,603.56
AVANTOR INC	22,000	36.35	799,700.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	960	674.78	647,788.80
BIO-TECHNE CORP	1,480	458.68	678,846.40
BIOGEN INC	5,743	324.62	1,864,292.66
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,570	78.84	596,818.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	89,725	67.30	6,038,492.50
CATALENT INC	6,520	109.17	711,788.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	384.49	734,375.90
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	34.26	566,180.76
ELI LILLY & CO	32,274	232.46	7,502,414.04
EXACT SCIENCES CORP	6,990	114.00	796,860.00
GILEAD SCIENCES INC	49,304	68.63	3,383,733.52
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,820	93.46	730,857.20
ILLUMINA INC	5,760	465.46	2,681,049.60
INCYTE CORP	6,670	78.33	522,461.10
IQVIA HOLDINGS INC	7,193	247.70	1,781,706.10
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	175.41	391,164.30
JOHNSON & JOHNSON	104,051	168.10	17,490,973.10
MERCK & CO. INC.	99,833	78.02	7,788,970.66
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	930	1,448.99	1,347,560.70

MODERNA INC	12,370	286.43	3,543,139.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,230	94.99	401,807.70
NOVAVAX INC	2,600	186.65	485,290.00
PERKINELMER INC	4,790	154.10	738,139.00
PFIZER INC	219,420	40.35	8,853,597.00
PPD INC	5,510	46.00	253,460.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,035	583.24	2,353,373.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,460	40.55	261,953.00
SEAGEN INC	5,140	146.39	752,444.60
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	48,910	8.61	421,115.10
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,709	519.79	8,165,381.11
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,440	202.28	2,111,803.20
VIATRIS INC	48,469	13.76	666,933.44
WATERS CORP	2,336	370.69	865,931.84
ZOETIS INC	18,690	199.68	3,732,019.20
BANK OF AMERICA CORP	307,469	37.92	11,659,224.48
CITIGROUP INC	82,077	66.90	5,490,951.30
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,580	43.00	669,940.00
FIFTH THIRD BANCORP	27,119	36.40	987,131.60
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,410	195.53	1,253,347.30
HUNTINGTON BANCSHARES INC	51,960	13.85	719,646.00
JPMORGAN CHASE & CO	120,290	151.91	18,273,253.90
KEYCORP	41,558	19.35	804,147.30
M & T BANK CORP	5,643	136.82	772,075.26
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,770	183.43	3,076,121.10
REGIONS FINANCIAL CORP	41,044	19.01	780,246.44
SVB FINANCIAL GROUP	1,885	561.76	1,058,917.60
TRUIST FINANCIAL CORP	53,300	54.39	2,898,987.00
US BANCORP	54,271	57.17	3,102,673.07
WELLS FARGO & CO	163,900	44.28	7,257,492.00
ALLY FINANCIAL INC	14,000	50.09	701,260.00
AMERICAN EXPRESS CO	27,134	170.01	4,613,051.34
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,960	246.78	1,224,028.80
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,220	56.74	409,662.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,912	49.38	1,625,194.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	54,170	277.90	15,053,843.00
BLACKROCK INC	6,050	875.02	5,293,871.00
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	27,290	102.20	2,789,038.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,965	157.52	2,829,846.80
CARLYLE GROUP INC/THE	4,270	44.89	191,680.30
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	116.63	459,522.20
CME GROUP INC	14,200	209.33	2,972,486.00

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,290	120.43	1,359,654.70
EQUITABLE HOLDINGS INC	17,100	28.83	492,993.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	341.18	545,888.00
FRANKLIN RESOURCES INC	12,475	29.41	366,889.75
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	133.40	240,120.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,598	364.80	4,960,550.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,100	118.06	2,609,126.00
INVESCO LTD	15,567	25.02	389,486.34
KKR & CO INC -A	19,150	58.24	1,115,296.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	459.09	651,907.80
MOODY'S CORP	6,837	377.96	2,584,112.52
MORGAN STANLEY	55,713	91.25	5,083,811.25
MSCI INC	3,170	564.83	1,790,511.10
NASDAQ INC	4,835	178.55	863,289.25
NORTHERN TRUST CORP	7,980	113.15	902,937.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,360	128.65	689,564.00
S&P GLOBAL INC	9,467	414.42	3,923,314.14
SCHWAB (CHARLES) CORP	57,243	68.89	3,943,470.27
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	61.56	283,483.80
STATE STREET CORP	13,027	84.34	1,098,697.18
SYNCHRONY FINANCIAL	21,570	46.73	1,007,966.10
T ROWE PRICE GROUP INC	9,375	203.41	1,906,968.75
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	85.51	372,823.60
VOYA FINANCIAL INC	5,580	62.00	345,960.00
AFLAC INC	25,764	53.12	1,368,583.68
ALLEGHANY CORP	500	670.71	335,355.00
ALLSTATE CORP	11,633	130.45	1,517,524.85
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	126.61	367,169.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,925	46.90	1,544,182.50
AON PLC	9,072	231.73	2,102,254.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,825	38.08	640,696.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,150	139.92	1,140,348.00
ASSURANT INC	2,300	155.76	358,248.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,810	62.44	237,896.40
BROWN & BROWN INC	10,380	53.74	557,821.20
CHUBB LTD	17,875	166.75	2,980,656.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,230	118.53	738,441.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	186.01	221,351.90
EVEREST RE GROUP LTD	1,384	246.78	341,543.52
FNF GROUP	11,561	43.95	508,105.95
GLOBE LIFE INC	3,246	94.05	305,286.30
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,812	63.32	811,255.84

LINCOLN NATIONAL CORP	8,243	59.69	492,024.67
LOEWS CORP	10,835	54.02	585,306.70
MARKEL CORP	525	1,216.01	638,405.25
MARSH & MCLENNAN COS	19,933	141.33	2,817,130.89
METLIFE INC	31,055	57.58	1,788,146.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,890	60.99	664,181.10
PROGRESSIVE CORP	22,300	96.18	2,144,814.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,742	98.73	1,455,477.66
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,740	111.10	304,414.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,437	152.21	370,935.77
TRAVELERS COS INC/THE	10,524	156.39	1,645,848.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,228	222.36	1,162,498.08
WR BERKLEY CORP	5,394	76.73	413,881.62
CBRE GROUP INC - A	12,560	82.96	1,041,977.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.68	230,256.00
ACCENTURE PLC-CL A	24,998	311.91	7,797,126.18
ADOBE INC	18,934	606.10	11,475,897.40
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,350	117.03	743,140.50
ANSYS INC	3,480	349.79	1,217,269.20
AUTODESK INC	8,570	293.33	2,513,838.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,981	205.60	3,491,293.60
AVALARA INC	3,040	148.32	450,892.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,340	58.90	373,426.00
BLACK KNIGHT INC	6,530	79.10	516,523.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,630	169.87	786,498.10
CADENCE DESIGN SYS INC	10,510	137.67	1,446,911.70
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,990	95.31	570,906.90
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,320	122.19	527,860.80
CITRIX SYSTEMS INC	5,028	116.24	584,454.72
CLOUDFLARE INC-CLASS A	8,190	102.66	840,785.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,008	68.24	1,365,345.92
COUPA SOFTWARE INC	2,450	217.54	532,973.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,170	249.96	1,792,213.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,400	133.61	187,054.00
DATADOG INC-CLASS A	7,240	104.64	757,593.60
DOCUSIGN INC	7,340	282.05	2,070,247.00
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	30.15	322,906.50
DYNATRACE INC	6,630	58.57	388,319.10
EPAM SYSTEMS INC	2,350	527.71	1,240,118.50
FAIR ISAAC CORP	1,055	523.93	552,746.15
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,418	148.54	3,627,049.72
FISERV INC	23,614	111.20	2,625,876.80

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,040	255.18	775,747.20
FORTINET INC	5,470	258.44	1,413,666.80
GARTNER INC	3,790	253.36	960,234.40
GLOBAL PAYMENTS INC	11,719	194.73	2,282,040.87
GODADDY INC-CLASS A	7,040	85.01	598,470.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	109.87	315,326.90
HUBSPOT INC	1,540	559.59	861,768.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	35,342	138.90	4,909,003.80
INTUIT INC	10,416	501.51	5,223,728.16
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	171.67	487,542.80
MASTERCARD INC	35,145	387.12	13,605,332.40
MICROSOFT CORP	283,004	280.75	79,453,373.00
MONGODB INC	2,200	332.70	731,940.00
NORTONLIFELOCK INC	19,775	26.01	514,347.75
OKTA INC	4,990	235.67	1,175,993.30
ORACLE CORP	77,673	87.49	6,795,610.77
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	19,600	21.37	418,852.00
PALO ALTO NETWORKS INC	4,060	388.30	1,576,498.00
PAYCHEX INC	13,232	111.85	1,479,999.20
PAYCOM SOFTWARE INC	1,805	372.85	672,994.25
PAYPAL HOLDINGS INC	43,957	294.63	12,951,050.91
PTC INC	4,690	140.20	657,538.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,220	273.79	881,603.80
SALESFORCE.COM INC	35,915	238.43	8,563,213.45
SERVICENOW INC	7,735	556.36	4,303,444.60
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	17,030	44.70	761,241.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	780	250.82	195,639.60
SPLUNK INC	6,820	134.39	916,539.80
SQUARE INC - A	15,090	237.52	3,584,176.80
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,910	73.71	583,046.10
SYNOPSYS INC	6,377	276.56	1,763,623.12
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,150	70.62	1,211,133.00
TWILIO INC - A	5,710	374.98	2,141,135.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,540	473.43	729,082.20
UNITY SOFTWARE INC	1,950	96.71	188,584.50
VERISIGN INC	3,900	229.74	895,986.00
VISA INC-CLASS A SHARES	66,622	248.12	16,530,250.64
VMWARE INC	2,965	150.07	444,957.55
WESTERN UNION CO	14,561	23.50	342,183.50
WIX.COM LTD	2,280	276.30	629,964.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,460	227.53	1,697,373.80
ZENDESK INC	5,210	136.36	710,435.60

ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,770	361.97	2,812,506.90
ZSCALER INC	2,820	221.16	623,671.20
AMPHENOL CORP-CL A	24,860	68.03	1,691,225.80
APPLE INC	663,068	146.39	97,066,524.52
ARISTA NETWORKS INC	2,180	363.45	792,321.00
ARROW ELECTRONICS INC	2,750	109.85	302,087.50
CDW CORP/DE	5,590	174.44	975,119.60
CISCO SYSTEMS INC	166,800	53.70	8,957,160.00
COGNEX CORP	7,570	82.61	625,357.70
CORNING INC	28,088	39.82	1,118,464.16
DELL TECHNOLOGIES -C	8,802	92.29	812,336.58
F5 NETWORKS INC	2,385	185.63	442,727.55
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,655	13.86	702,078.30
HP INC	54,625	27.52	1,503,280.00
IPG PHOTONICS CORP	1,840	205.88	378,819.20
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	27.61	349,625.43
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,760	155.01	1,202,877.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,675	219.99	1,468,433.25
NETAPP INC	7,606	77.37	588,476.22
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,694	84.46	818,755.24
TE CONNECTIVITY LTD	12,555	134.31	1,686,262.05
TRIMBLE INC	11,140	79.22	882,510.80
WESTERN DIGITAL CORP	12,428	64.20	797,877.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,280	518.33	1,181,792.40
AT&T INC	281,327	28.34	7,972,807.18
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,285	25.08	132,547.80
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	17,221	25.21	434,141.41
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	12.74	438,077.64
T-MOBILE US INC	24,739	149.41	3,696,253.99
VERIZON COMMUNICATIONS INC	163,387	56.46	9,224,830.02
AES CORP	27,718	24.36	675,210.48
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	58.55	483,623.00
AMEREN CORPORATION	10,942	85.06	930,726.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,468	87.49	1,790,745.32
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	168.31	1,128,518.55
ATMOS ENERGY CORP	4,880	101.24	494,051.20
CENTERPOINT ENERGY INC	24,962	25.59	638,777.58
CMS ENERGY CORP	12,240	62.01	759,002.40
CONSOLIDATED EDISON INC	11,936	74.93	894,364.48
DOMINION ENERGY INC	31,511	77.16	2,431,388.76
DTE ENERGY COMPANY	8,018	117.05	938,506.90
DUKE ENERGY CORP	29,126	104.76	3,051,239.76

EDISON INTERNATIONAL	14,869	57.99	862,253.31
ENERGY CORP	7,127	104.72	746,339.44
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	48.26	443,509.40
EVERGY INC	8,720	64.56	562,963.20
EVERSOURCE ENERGY	14,360	87.36	1,254,489.60
EXELON CORP	39,166	45.99	1,801,244.34
FIRSTENERGY CORP	22,345	37.79	844,417.55
NEXTERA ENERGY INC	77,780	77.92	6,060,617.60
NISOURCE INC	15,050	25.75	387,537.50
NRG ENERGY INC	10,000	40.54	405,400.00
P G & E CORP	60,460	9.79	591,903.40
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	86.39	382,621.31
PPL CORP	29,828	28.59	852,782.52
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,608	61.74	1,334,077.92
SEMPRA ENERGY	11,567	134.20	1,552,291.40
SOUTHERN CO	41,855	63.11	2,641,469.05
UGI CORP	7,720	46.09	355,814.80
VISTRA CORP	20,980	18.81	394,633.80
WEC ENERGY GROUP INC	12,040	95.44	1,149,097.60
XCEL ENERGY INC	20,004	69.13	1,382,876.52
ADVANCED MICRO DEVICES	47,680	85.89	4,095,235.20
ANALOG DEVICES INC	15,100	160.44	2,422,644.00
APPLIED MATERIALS INC	36,243	128.18	4,645,627.74
BROADCOM INC	15,955	468.07	7,468,056.85
ENPHASE ENERGY INC	4,930	163.45	805,808.50
INTEL CORP	161,782	54.97	8,893,156.54
KLA CORP	6,039	293.22	1,770,755.58
LAM RESEARCH CORP	5,662	588.48	3,331,973.76
MARVELL TECHNOLOGY INC	30,984	53.97	1,672,206.48
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,440	97.10	1,110,824.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,684	133.76	1,295,331.84
MICRON TECHNOLOGY INC	44,127	75.01	3,309,966.27
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,930	379.46	732,357.80
NVIDIA CORP	24,365	726.44	17,699,710.60
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,967	190.11	2,084,936.37
ON SEMICONDUCTOR CORP	14,160	35.15	497,724.00
QORVO INC	4,930	187.68	925,262.40
QUALCOMM INC	44,592	139.71	6,229,948.32
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,180	188.11	1,350,629.80
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	1,890	236.56	447,098.40
TERADYNE INC	6,540	119.89	784,080.60
TEXAS INSTRUMENTS INC	36,422	186.12	6,778,862.64

	XILINX INC	9,455	128.63	1,216,196.65	
米ドル小計		12,574,992		1,509,373,792.85	(165,849,992,358)
加ドル	CAMECO CORP	14,272	21.22	302,851.84	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	48,154	40.85	1,967,090.90	
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	10.22	563,970.26	
	ENBRIDGE INC	80,167	49.34	3,955,439.78	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	34.45	331,477.90	
	INTER PIPELINE LTD	14,620	20.94	306,142.80	
	KEYERA CORP	8,460	32.45	274,527.00	
	PARKLAND CORP	7,370	39.25	289,272.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,572	38.79	953,147.88	
	SUNCOR ENERGY INC	62,819	26.47	1,662,818.93	
	TC ENERGY CORP	38,733	61.63	2,387,114.79	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	9,775	77.19	754,532.25	
	B2GOLD CORP	42,000	5.00	210,000.00	
	BARRICK GOLD CORP	71,794	26.28	1,886,746.32	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	67.45	387,837.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,200	24.64	473,088.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,145	189.93	1,546,979.85	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	21,000	8.48	178,080.00	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	7.82	359,915.50	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	10,600	51.47	545,582.00	
	LUNDIN MINING CORP	21,150	11.07	234,130.50	
	NUTRIEN LTD	21,068	74.91	1,578,203.88	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	8,780	34.21	300,363.80	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	27.09	486,942.75	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,100	85.85	351,985.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18,535	55.74	1,033,140.90	
	YAMANA GOLD INC	32,800	5.31	174,168.00	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	8,330	19.10	159,103.00	
	CAE INC	10,265	35.75	366,973.75	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,710	103.08	382,426.80	
	WSP GLOBAL INC	4,030	143.00	576,290.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	8,510	40.01	340,485.10	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	75.60	305,424.00	
	THOMSON REUTERS CORP	6,076	129.04	784,047.04	
	AIR CANADA	7,190	24.25	174,357.50	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,908	131.65	3,674,088.20	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,325	91.27	2,311,412.75	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	11,858	107.26	1,271,889.08	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,420	41.66	267,457.20	

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,318	79.56	980,020.08
QUEBECOR INC -CL B	6,110	33.38	203,951.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	36.31	634,154.15
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	188.02	370,399.40
DOLLARAMA INC	11,780	57.24	674,287.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	33,950	48.93	1,661,173.50
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	40.17	333,009.30
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	80.21	441,876.89
METRO INC	11,140	62.28	693,799.20
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	124.52	418,138.16
SAPUTO INC	9,620	36.34	349,590.80
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	34.82	441,656.88
CANOPY GROWTH CORP	9,140	24.72	225,940.80
BANK OF MONTREAL	25,871	125.11	3,236,720.81
BANK OF NOVA SCOTIA	47,949	78.52	3,764,955.48
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	17,915	142.83	2,558,799.45
NATIONAL BANK OF CANADA	12,060	94.71	1,142,202.60
ROYAL BANK OF CANADA	56,449	127.54	7,199,505.46
TORONTO-DOMINION BANK	71,940	84.02	6,044,398.80
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	51,319	62.56	3,210,516.64
IGM FINANCIAL INC	3,335	43.78	146,006.30
ONEX CORPORATION	2,765	90.32	249,734.80
TMX GROUP LTD	1,810	131.80	238,558.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,110	540.45	599,899.50
GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	36.93	328,824.72
IA FINANCIAL CORP INC	3,895	65.93	256,797.35
INTACT FINANCIAL CORP	5,965	169.67	1,012,081.55
MANULIFE FINANCIAL CORP	79,501	23.98	1,906,433.98
POWER CORP OF CANADA	23,289	38.87	905,243.43
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,214	63.96	1,484,767.44
FIRSTSERVICE CORP	1,770	227.71	403,046.70
BLACKBERRY LTD	22,208	12.69	281,819.52
CGI INC	8,930	114.65	1,023,824.50
CONSTELLATION SOFTWARE INC	780	1,907.44	1,487,803.20
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	3,440	98.89	340,181.60
OPEN TEXT CORP	10,940	63.23	691,736.20
SHOPIFY INC - CLASS-A	4,355	1,819.63	7,924,488.65
BCE INC	5,900	62.36	367,924.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,575	67.22	1,046,951.50
TELUS CORP	12,662	27.92	353,523.04
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	19.19	519,665.20
ALTAGAS LTD	9,000	26.31	236,790.00

	ATCO LTD -CLASS I	2,300	44.07	101,361.00
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	49.04	267,022.80
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.20	160,512.00
	EMERA INC	12,030	58.07	698,582.10
	FORTIS INC	19,615	56.26	1,103,539.90
	HYDRO ONE LTD	11,790	30.80	363,132.00
	NORTHLAND POWER INC	8,600	43.07	370,402.00
加ドル小計		1,613,936		93,565,255.63 (8,136,434,629)
ユーロ	ENI SPA	107,926	9.83	1,061,128.43
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	8.46	180,155.70
	NESTE OYJ	15,770	53.30	840,541.00
	OMV AG	6,480	45.92	297,561.60
	REPSOL SA	57,649	9.16	528,295.43
	TENARIS SA	19,915	8.52	169,795.29
	TOTALENERGIES SE	99,977	36.28	3,627,665.44
	VOPAK	2,510	38.58	96,835.80
	AIR LIQUIDE SA	18,750	148.96	2,793,000.00
	AKZO NOBEL	6,827	106.70	728,440.90
	ARCELORMITTAL	28,822	25.48	734,528.67
	ARKEMA	3,045	105.60	321,552.00
	BASF SE	36,345	67.01	2,435,478.45
	COVESTRO AG	7,410	56.42	418,072.20
	CRH PLC	29,850	41.67	1,243,849.50
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,540	29.21	249,453.40
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	40.18	116,522.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	72.52	414,451.80
	KONINKLIJKE DSM NV	6,552	164.15	1,075,510.80
	LANXESS AG	3,115	59.12	184,158.80
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,740	45.29	350,544.60
	SOLVAY SA	3,231	108.50	350,563.50
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,305	15.78	304,729.42
	SYMRISE AG	5,370	122.00	655,140.00
	UMICORE	8,880	52.72	468,153.60
	UPM-KYMMENE OYJ	19,568	32.67	639,286.56
	VOESTALPINE AG	4,249	34.76	147,695.24
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	21.51	225,553.86
	AIRBUS GROUP SE	23,468	110.64	2,596,499.52
	ALSTOM	11,635	35.62	414,438.70
	BOUYGUES SA	9,460	31.97	302,436.20
	BRENTAG SE	6,735	82.78	557,523.30
	CNH INDUSTRIAL NV	46,280	13.47	623,391.60

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	20,756	57.42	1,191,809.52
DASSAULT AVIATION SA	90	959.50	86,355.00
EIFFAGE	3,250	85.38	277,485.00
FERROVIAL SA	18,485	24.78	458,058.30
GEA GROUP AG	6,680	34.58	230,994.40
KINGSPAN GROUP PLC	6,260	84.86	531,223.60
KION GROUP AG	2,284	88.00	200,992.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	96.52	286,664.40
KONE OYJ-B	14,244	69.44	989,103.36
LEGRAND SA	11,278	91.78	1,035,094.84
MTU AERO ENGINES AG	2,020	205.20	414,504.00
PRYSMIAN SPA	9,565	30.42	290,967.30
RATIONAL AG	230	815.40	187,542.00
SAFRAN SA	12,810	113.54	1,454,447.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,188	134.20	2,843,429.60
SIEMENS AG-REG	30,356	129.40	3,928,066.40
SIEMENS ENERGY AG	15,843	22.70	359,636.10
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	22.02	258,955.20
THALES SA	3,745	87.58	327,987.10
VINCI SA	20,040	89.19	1,787,367.60
WARTSILA OYJ ABP	21,180	12.77	270,574.50
BUREAU VERITAS SA	14,440	26.66	384,970.40
RANDSTAD NV	4,965	64.24	318,951.60
TELEPERFORMANCE	2,120	353.30	748,996.00
WOLTERS KLUWER	10,377	90.82	942,439.14
ADP	1,090	107.45	117,120.50
AENA SA	2,870	133.85	384,149.50
ATLANTIA SPA	18,740	14.92	279,694.50
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	9.72	116,152.32
DEUTSCHE POST AG-REG	37,733	58.09	2,191,909.97
GETLINK	14,730	13.49	198,707.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,235	85.50	1,131,592.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	74.30	127,796.00
CONTINENTAL AG	4,385	115.30	505,590.50
DAIMLER AG	33,872	71.72	2,429,299.84
FAURECIA	4,256	38.94	165,728.64
FERRARI NV	5,214	175.85	916,881.90
MICHELIN (CGDE)-B	6,669	134.65	897,980.85
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	90.78	514,722.60
RENAULT SA	6,837	30.96	211,707.70
STELLANTIS NV	86,706	15.68	1,360,070.31
VALEO SA	8,060	23.72	191,183.20

VOLKSWAGEN AG	1,441	280.00	403,480.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,183	207.65	1,491,549.95
ADIDAS AG	7,521	311.90	2,345,799.90
ESSILORLUXOTTICA	10,675	152.24	1,625,162.00
HERMES INTERNATIONAL	1,207	1,250.00	1,508,750.00
KERING	2,957	731.80	2,163,932.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,959	654.30	7,170,473.70
MONCLER SPA	8,860	56.74	502,716.40
PUMA SE	4,530	101.40	459,342.00
SEB SA	847	149.60	126,711.20
ACCOR SA	7,646	30.01	229,456.46
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,946	141.60	983,553.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	48.40	188,760.00
SODEXO	4,090	72.36	295,952.40
BOLLORE	33,530	4.51	151,488.54
PUBLICIS GROUPE	8,645	52.80	456,456.00
SCOUT24 AG	3,880	72.70	282,076.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	56.70	199,017.00
VIVENDI	32,720	28.00	916,160.00
DELIVERY HERO SE	5,680	121.85	692,108.00
HELLOFRESH SE	6,070	81.96	497,497.20
INDITEX	45,445	28.09	1,276,550.05
JUST EAT TAKEAWAY	6,520	68.30	445,316.00
PROSUS	19,170	81.12	1,555,070.40
ZALANDO SE	8,260	96.70	798,742.00
CARREFOUR SA	27,693	16.24	449,734.32
COLRUYT SA	2,305	47.58	109,671.90
JERONIMO MARTINS	9,035	16.86	152,330.10
KESKO OYJ-B SHS	12,330	33.55	413,671.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,718	25.60	1,196,214.39
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	30,801	58.32	1,796,314.32
DANONE	24,474	59.17	1,448,126.58
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,980	11.18	256,916.40
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	85.50	344,137.50
HEINEKEN NV	11,053	101.95	1,126,853.35
JDE PEET'S NV	2,400	30.47	73,128.00
KERRY GROUP PLC-A	7,010	121.95	854,869.50
PERNOD-RICARD SA	8,606	184.20	1,585,225.20
REMY COINTREAU	810	180.50	146,205.00
BEIERSDORF AG	3,805	102.10	388,490.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	77.90	349,771.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	86.72	556,135.36

L'OREAL	9,926	374.60	3,718,279.60
AMPLIFON SPA	5,620	40.57	228,003.40
BIOMERIEUX	1,310	94.00	123,140.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	172.50	327,750.00
DIASORIN SPA	930	163.05	151,636.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,343	69.80	652,141.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,955	44.73	803,216.92
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,020	39.05	1,406,761.10
ORPEA	1,790	103.95	186,070.50
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,080	487.70	526,716.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	53.74	603,500.20
ARGENX SE	1,840	259.00	476,560.00
BAYER AG-REG	39,234	50.67	1,987,986.78
EUROFINS SCIENTIFIC	5,950	102.02	607,019.00
GRIFOLS SA	9,910	20.70	205,137.00
IPSEN	1,350	88.56	119,556.00
MERCK KGAA	5,130	170.75	875,947.50
ORION OYJ-CLASS B	5,150	36.56	188,284.00
QIAGEN N.V.	9,614	40.00	384,560.00
RECORDATI SPA	3,920	50.54	198,116.80
SANOFI	44,956	87.87	3,950,283.72
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,160	460.30	533,948.00
UCB SA	4,928	89.04	438,789.12
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,360	9.69	129,485.12
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,873	5.09	1,327,843.57
BANCO SANTANDER SA	700,449	3.03	2,127,964.06
BNP PARIBAS	44,502	49.88	2,219,759.76
CAIXABANK S.A	163,050	2.44	398,168.10
COMMERZBANK AG	48,544	5.48	266,069.66
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	11.45	466,495.90
ERSTE GROUP BANK AG	12,928	30.66	396,372.48
FINECOBANK SPA	26,120	14.35	374,952.60
ING GROEP NV-CVA	156,335	10.45	1,634,638.76
INTESA SANPAOLO	677,293	2.23	1,511,717.97
KBC GROEP NV	10,209	64.02	653,580.18
MEDIOBANCA SPA	20,050	9.73	195,086.50
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,370	18.51	99,398.70
SOCIETE GENERALE	34,339	24.14	829,115.15
UNICREDIT SPA	83,846	9.40	788,152.40
AMUNDI SA	2,140	75.85	162,319.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	72,445	10.19	738,649.22
DEUTSCHE BOERSE AG	7,800	143.60	1,120,080.00

EURAZEO SE	1,877	74.45	139,742.65
EXOR NV	3,424	66.14	226,463.36
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	95.80	389,139.60
SOFINA	480	381.60	183,168.00
WENDEL	1,000	108.80	108,800.00
AEGON NV	77,949	3.50	272,977.39
AGEAS	6,794	45.04	306,001.76
ALLIANZ SE-REG	16,348	208.95	3,415,914.60
ASSICURAZIONI GENERALI	38,748	16.73	648,447.78
AXA SA	74,212	21.62	1,604,463.44
CNP ASSURANCES	6,040	14.45	87,278.00
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	144.95	329,761.25
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,566	228.10	1,269,604.60
NN GROUP NV	9,940	40.94	406,943.60
POSTE ITALIANE SPA	19,560	10.87	212,715.00
SAMPO OYJ-A SHS	18,189	40.02	727,923.78
SCOR SE	7,452	25.00	186,300.00
AROUNDTOWN SA	33,520	6.50	217,880.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	13,630	51.72	704,943.60
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	131.35	324,434.50
VONOVIA SE	22,148	58.52	1,296,100.96
ADYEN NV	750	2,197.50	1,648,125.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	55.06	940,975.40
ATOS SE	3,890	41.83	162,718.70
BECHTLE AG	1,230	162.55	199,936.50
CAP GEMINI SA	5,849	166.85	975,905.65
DASSAULT SYSTEMES SE	27,350	43.60	1,192,460.00
EDENRED	9,626	48.70	468,786.20
NEMETSCHKE SE	1,790	70.60	126,374.00
NEXI SPA	20,200	18.31	369,862.00
SAP SE	41,452	125.46	5,200,567.92
TEAMVIEWER AG	7,050	29.42	207,411.00
WORLDLINE SA	8,390	81.24	681,603.60
NOKIA OYJ	215,766	4.92	1,063,618.49
CELLNEX TELECOM SA	16,760	53.80	901,688.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	129,336	18.34	2,372,539.58
ELISA OYJ	5,465	54.54	298,061.10
ILIAD SA	566	118.85	67,269.10
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.91	150,365.04
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	2.71	357,573.50
ORANGE S.A.	85,484	9.59	820,048.01
PROXIMUS	5,600	16.82	94,220.00

TELECOM ITALIA SPA	317,713	0.38	123,304.41
TELECOM ITALIA-RSP	198,057	0.42	84,352.47
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.45	79,746.32
TELEFONICA SA	179,339	3.71	666,334.05
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	34.35	137,400.00
E.ON SE	86,389	10.41	899,655.04
EDF	26,405	10.91	288,210.57
EDP RENOVAVEIS SA	10,400	19.81	206,024.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	121,971	4.58	559,724.91
ELIA GROUP SA/NV	960	93.20	89,472.00
ENAGAS SA	8,240	18.30	150,833.20
ENDESA SA	10,710	20.68	221,482.80
ENEL SPA	322,037	8.01	2,579,516.37
ENGIE	76,034	11.62	883,667.14
FORTUM OYJ	16,415	22.87	375,411.05
IBERDROLA SA	240,612	10.29	2,477,100.54
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,072	22.18	201,216.96
RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	16.00	307,520.00
RWE AG	26,575	30.20	802,565.00
SNAM SPA	79,380	4.97	394,677.36
SUEZ	13,289	19.60	260,464.40
TERNA SPA	49,057	6.60	323,874.31
UNIPER SE	7,030	31.54	221,726.20
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,664	26.08	538,917.12
VERBUND AG	2,780	80.80	224,624.00
ASM INTERNATIONAL NV	1,840	282.60	519,984.00
ASML HOLDING NV	16,782	589.30	9,889,632.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	53,695	31.75	1,704,816.25
STMICROELECTRONICS NV	23,633	32.17	760,273.61
ユーロ小計	7,375,117		186,178,664.93 (24,145,511,054)
英債券			
BP PLC	797,388	2.92	2,330,366.43
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	162,338	13.99	2,271,757.97
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	144,199	13.68	1,973,219.11
ANGLO AMERICAN PLC	50,684	28.89	1,464,260.76
ANTOFAGASTA PLC	12,060	13.65	164,679.30
BHP GROUP PLC	83,911	22.18	1,861,145.98
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	78.32	432,404.72
EVRAZ PLC	21,700	5.93	128,767.80
GLENCORE PLC	396,813	3.09	1,226,152.17
JOHNSON MATTHEY PLC	6,589	31.21	205,642.69
MONDI PLC	20,970	19.66	412,375.05

RIO TINTO PLC	44,955	59.31	2,666,281.05
ASHTED GROUP PLC	16,390	55.84	915,217.60
BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	5.39	653,238.97
BUNZL PLC	13,836	25.96	359,182.56
DCC PLC	3,820	60.30	230,346.00
FERGUSON PLC	9,322	102.35	954,106.70
MELROSE INDUSTRIES PLC	160,580	1.49	239,344.49
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	347,631	0.93	323,505.40
SMITHS GROUP PLC	15,443	15.55	240,138.65
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	141.70	368,420.00
EXPERIAN PLC	38,178	30.86	1,178,173.08
INTERTEK GROUP PLC	7,145	55.58	397,119.10
RELX PLC	76,115	20.56	1,564,924.40
RENTOKIL INITIAL PLC	78,900	5.18	409,175.40
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	6.87	279,909.28
BERKELEY GROUP HOLDINGS	4,890	46.48	227,287.20
BURBERRY GROUP PLC	14,144	19.66	278,071.04
PERSIMMON PLC	13,570	29.52	400,586.40
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.55	192,897.90
COMPASS GROUP PLC	69,398	14.52	1,007,658.96
ENTAIN PLC	21,400	18.21	389,694.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,893	47.03	371,207.79
WHITBREAD PLC	8,260	29.24	241,522.40
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.60	241,059.84
INFORMA PLC	56,580	4.90	277,242.00
PEARSON PLC	26,259	8.12	213,223.08
WPP PLC	50,104	9.48	475,086.12
JD SPORTS FASHION PLC	22,850	8.86	202,588.10
KINGFISHER PLC	88,337	3.67	324,196.79
NEXT PLC	5,467	75.14	410,790.38
OCADO GROUP PLC	20,060	18.05	362,083.00
SAINSBURY (J) PLC	59,501	2.84	169,280.34
TESCO PLC	327,918	2.34	770,279.38
WM MORRISON SUPERMARKETS	78,455	2.62	206,101.28
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,945	20.49	306,223.05
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	90,867	28.47	2,586,983.49
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	26.32	202,400.80
DIAGEO PLC	92,732	35.00	3,246,083.66
IMPERIAL BRANDS PLC	37,492	16.01	600,246.92
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,365	64.85	1,839,470.25
UNILEVER PLC	103,702	43.58	4,519,333.16
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-

	SMITH & NEPHEW PLC	35,006	15.05	526,840.30	
	ASTRAZENECA PLC	52,103	83.40	4,345,390.20	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	198,831	14.24	2,832,546.42	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	26.30	202,247.00	
	BARCLAYS PLC	668,451	1.65	1,105,751.64	
	HSBC HOLDINGS PLC	802,691	4.03	3,236,851.45	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,657,136	0.45	1,214,842.57	
	NATWEST GROUP PLC	181,130	1.99	361,897.74	
	STANDARD CHARTERED PLC	109,730	4.34	476,996.31	
	3I GROUP PLC	36,819	11.59	426,916.30	
	ABRDN PLC	88,515	2.78	246,337.24	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	16.20	210,924.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,277	76.00	933,052.00	
	M&G PLC	99,522	2.22	221,436.45	
	SCHRODERS PLC	4,131	35.60	147,063.60	
	ST JAMES'S PLACE PLC	19,260	15.42	296,989.20	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,505	32.87	213,819.35	
	AVIVA PLC	170,765	3.91	668,374.21	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	51,053	2.88	147,441.06	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	255,901	2.61	669,181.11	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	6.79	168,559.14	
	PRUDENTIAL PLC	102,232	13.61	1,391,888.68	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	38.82	175,272.30	
	SAGE GROUP PLC/THE	42,810	6.98	298,899.42	
	HALMA PLC	16,450	27.71	455,829.50	
	BT GROUP PLC	355,852	1.86	664,553.61	
	VODAFONE GROUP PLC	1,097,428	1.16	1,279,601.04	
	NATIONAL GRID PLC	143,968	9.43	1,357,618.24	
	SEVERN TRENT PLC	11,503	27.14	312,191.42	
	SSE PLC	42,587	15.16	645,618.92	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,415	10.44	338,574.67	
英債券小計		11,443,468		68,884,957.08	(10,410,583,563)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	18.77	142,126.75	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	965.00	260,550.00	
	GIVAUDAN-REG	373	4,409.00	1,644,557.00	
	HOLCIM LTD	21,639	52.66	1,139,509.74	
	SIKA AG-REG	5,740	312.80	1,795,472.00	
	ABB LTD-REG	73,175	32.47	2,375,992.25	
	GEBERIT AG-REG	1,560	722.00	1,126,320.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	630	276.00	173,880.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	286.30	423,724.00	

	ADECCO GROUP AG-REG	5,477	61.30	335,740.10	
	SGS SA-REG	258	2,927.00	755,166.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	314.20	625,258.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,859	111.15	2,318,477.85	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,000	306.00	306,000.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	58.70	108,595.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	105	2,252.00	236,460.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	9,590.00	421,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	100,000.00	400,000.00	
	NESTLE SA-REG	113,833	115.74	13,175,031.42	
	ALCON INC	18,824	63.34	1,192,312.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,381	342.90	816,444.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	450	1,612.50	725,625.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,783	658.40	1,832,327.20	
	NOVARTIS AG-REG	87,623	84.47	7,401,514.81	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,230	392.00	482,160.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,733	359.10	9,958,920.30	
	VIFOR PHARMA AG	1,940	123.15	238,911.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	890	80.90	72,001.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,638	9.00	942,369.82	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,170	57.64	470,918.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	1,461.00	1,285,680.00	
	UBS GROUP AG-REG	139,272	13.75	1,914,990.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,630	143.30	233,579.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,180	451.00	532,180.00	
	SWISS RE AG	12,249	83.50	1,022,791.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,011	364.30	2,189,807.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	95.30	243,110.30	
	TEMENOS AG	2,640	147.05	388,212.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	109.40	728,604.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,094	544.80	596,011.20	
	スイスフラン小計	688,686		61,033,290.40 (7,295,919,534)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,540	281.00	2,399,740.00	
	BOLIDEN AB	10,890	336.30	3,662,307.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,310	151.25	3,374,387.50	
	ALFA LAVAL AB	10,550	316.10	3,334,855.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,110	269.20	11,336,012.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,725	559.00	14,380,275.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,490	473.10	7,801,419.00	
	EPIROC AB-A	27,585	203.00	5,599,755.00	
	EPIROC AB-B	15,450	172.15	2,659,717.50	

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	310.00	2,108,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	43,080	93.94	4,046,935.20	
	SANDVIK AB	48,250	216.80	10,460,600.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,410	239.40	2,731,554.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	215.30	3,031,208.70	
	VOLVO AB-A SHS	7,120	215.40	1,533,648.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	57,670	209.05	12,055,913.50	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	140.60	2,056,837.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,095	239.70	1,940,371.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	113.20	1,698,000.00	
	EVOLUTION AB	5,850	1,408.40	8,239,140.00	
	EMBRACER GROUP AB	9,310	224.20	2,087,302.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,138	190.00	5,726,220.00	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	416.00	1,759,680.00	
	SWEDISH MATCH AB	63,200	77.16	4,876,512.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,065	292.20	6,155,193.00	
	NORDEA BANK ABP	131,522	97.74	12,854,960.28	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	117.45	7,334,752.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	66,610	99.10	6,601,051.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,490	169.12	6,678,548.80	
	EQT AB	10,680	359.30	3,837,324.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,250	337.20	1,433,100.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	321.00	1,919,580.00	
	INVESTOR AB-B SHS	75,060	211.30	15,860,178.00	
	KINNEVIK AB - B	10,215	351.80	3,593,637.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,370	582.60	1,380,762.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,570	594.20	2,715,494.00	
	SINCH AB	16,600	169.45	2,812,870.00	
	ERICSSON LM-B SHS	119,755	103.84	12,435,359.20	
	HEXAGON AB-B SHS	78,890	132.85	10,480,536.50	
	TELE2 AB-B SHS	18,705	130.20	2,435,391.00	
	TELIA CO AB	94,230	39.81	3,751,767.45	
	スウェーデンクローナ小計	1,280,953		221,180,895.03	(2,800,150,131)
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	37,444	173.42	6,493,538.48	
	NORSK HYDRO A S	62,840	55.40	3,481,336.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,660	470.80	3,606,328.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	185.45	2,114,130.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,830	411.80	1,577,194.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,420	468.10	1,132,802.00	
	MOWI ASA	15,340	224.80	3,448,432.00	
	ORKLA ASA	22,670	81.92	1,857,126.40	

	DNB BANK ASA	39,765	180.85	7,191,500.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,810	204.10	1,389,921.00	
	TELENOR ASA	21,965	150.50	3,305,732.50	
ノルウェークローネ小計		232,144		35,598,040.63 (440,347,762)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	546.00	2,096,640.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	475.90	3,766,748.50	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	250	3,224.00	806,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	40,500	227.00	9,193,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	16,860.00	1,938,900.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	223	17,340.00	3,866,820.00	
	DSV PANALPINA A S	8,570	1,527.50	13,090,675.00	
	PANDORA A/S	4,080	840.00	3,427,200.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	1,165.00	4,601,750.00	
	AMBU A/S-B	6,780	236.50	1,603,470.00	
	COLOPLAST-B	4,275	1,094.50	4,678,987.50	
	DEMANT A/S	4,410	352.30	1,553,643.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	566.20	2,814,014.00	
	GENMAB A/S	2,560	2,727.00	6,981,120.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	68,315	555.80	37,969,477.00	
	DANSKE BANK A/S	31,805	110.95	3,528,764.75	
TRYG A/S	15,435	154.95	2,391,653.25		
ORSTED A/S	7,760	919.80	7,137,648.00		
デンマーククローネ小計		215,753		111,447,011.00 (1,943,635,871)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	28.83	252,983.25	
	OIL SEARCH LTD	77,602	3.87	300,319.74	
	SANTOS LTD	65,495	7.02	459,774.90	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,333	22.76	872,459.08	
	BHP GROUP LTD	116,836	51.87	6,060,283.32	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	22.85	418,383.50	
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	4.69	323,610.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,085	25.78	1,703,671.30	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	17,805	45.75	814,578.75	
	NEWCREST MINING LTD	30,209	26.90	812,622.10	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	10.73	452,698.70	
	ORICA LIMITED	12,135	13.22	160,424.70	
	RIO TINTO LTD	15,718	130.60	2,052,770.80	
	SOUTH32 LTD	205,747	2.97	611,068.59	
	REECE LTD	10,200	23.32	237,864.00	
	BRAMBLES LTD	62,498	11.30	706,227.40	
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.94	289,865.80		

	QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.72	207,680.00
	SYDNEY AIRPORT	47,076	7.91	372,371.16
	TRANSURBAN GROUP	114,369	14.49	1,657,206.81
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,290	42.36	1,071,284.40
	CROWN RESORTS LTD	11,395	10.94	124,661.30
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	117.59	250,466.70
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,974	4.87	345,643.38
	REA GROUP LTD	1,820	162.45	295,659.00
	SEEK LTD	10,700	31.61	338,227.00
	WESFARMERS LTD	47,175	59.12	2,788,986.00
	COLES GROUP LTD	52,085	17.05	888,049.25
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	6.45	325,479.90
	WOOLWORTHS GROUP LTD	50,462	38.24	1,929,666.88
	TREASURY WINE ESTATES LTD	25,746	11.95	307,664.70
	COCHLEAR LTD	2,917	239.29	698,008.93
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,995	63.10	567,584.50
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,610	39.09	844,734.90
	CSL LTD	18,032	277.72	5,007,847.04
	AUST AND NZ BANKING GROUP	116,069	27.43	3,183,772.67
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	69,927	98.19	6,866,132.13
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	129,523	25.96	3,362,417.08
	WESTPAC BANKING CORP	140,771	24.91	3,506,605.61
	ASX LTD	7,925	76.02	602,458.50
	MACQUARIE GROUP LTD	13,374	155.49	2,079,523.26
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,820	54.59	263,123.80
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.93	468,966.25
	MEDIBANK PRIVATE LTD	92,560	3.27	302,671.20
	QBE INSURANCE GROUP LTD	64,150	10.72	687,688.00
	SUNCORP GROUP LTD	57,276	11.50	658,674.00
	AFTERPAY LTD	8,240	103.21	850,450.40
	COMPUTERSHARE LTD	17,450	16.14	281,643.00
	WISETECH GLOBAL LTD	5,130	30.61	157,029.30
	XERO LTD	5,480	137.20	751,856.00
	TELSTRA CORPORATION LTD	182,084	3.77	686,456.68
	AGL ENERGY LTD	21,261	8.10	172,214.10
	APA GROUP	45,818	9.59	439,394.62
	AUSNET SERVICES	72,810	1.80	131,422.05
	ORIGIN ENERGY LTD	53,520	4.54	242,980.80
豪ドル小計		2,739,059		60,246,307.23 (4,879,950,885)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	7.55	426,688.25
	A2 MILK CO LTD	23,220	7.38	171,363.60

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,200	30.45	645,540.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,870	13.10	155,497.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.79	366,803.83	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.55	133,620.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	5.28	243,004.30	
ニュージーランドドル小計		255,762		2,142,516.98	(164,202,501)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,208	58.65	6,522,349.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	55,000	135.00	7,425,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	82,000	33.60	2,755,200.00	
	MTR CORP	57,500	44.65	2,567,375.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	92,000	58.70	5,400,400.00	
	SANDS CHINA LTD	111,400	30.60	3,408,840.00	
	SJM HOLDINGS LTD	91,000	7.92	720,720.00	
	WYNN MACAU LTD	63,000	11.44	720,720.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	24.50	1,663,550.00	
	WH GROUP LTD	441,500	6.58	2,905,070.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,240	13.54	612,549.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	25.55	3,832,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	27,300	152.80	4,171,440.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	47,400	524.00	24,837,600.00	
	AIA GROUP LTD	476,990	96.15	45,862,588.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	53.70	4,136,940.60	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	26.85	2,035,230.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	18.68	1,457,040.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	36.50	2,113,386.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	37.50	2,724,975.00	
	SINO LAND CO	143,050	12.58	1,799,569.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,980	116.80	6,188,064.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	53.05	929,276.85	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	23.15	963,040.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	44.95	2,867,810.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.66	1,599,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	46.30	1,157,500.00	
CLP HOLDINGS LTD	55,000	77.80	4,279,000.00		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.81	741,950.00		
HONG KONG & CHINA GAS	474,237	12.36	5,861,569.32		
POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	48.80	2,684,000.00		
香港ドル小計		3,454,027		154,944,253.57	(2,192,461,188)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	5.22	278,539.20	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,900	3.99	207,081.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	4.89	263,571.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.82	173,102.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.55	336,518.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,715	30.12	2,160,055.80	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	137,740	12.07	1,662,521.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	26.09	1,090,562.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,700	11.37	451,389.00	
	CAPITALAND LTD	118,500	3.81	451,485.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.87	118,851.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	7.35	114,292.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	19.03	188,397.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	369,180	2.27	838,038.60	
シンガポールドル小計		1,265,605		8,334,403.90	(674,253,275)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	22.61	589,894.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	417.00	500,400.00	
	BANK HAPOLIM BM	45,535	26.20	1,193,017.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	24.93	1,421,134.65	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	40,300	15.25	614,575.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	96.64	473,536.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	244.20	327,228.00	
	NICE LTD	2,715	833.20	2,262,138.00	
イスラエルシュケル小計		179,085		7,381,923.55	(246,590,203)
合 計		43,318,587		229,180,032,954	(229,180,032,954)

(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	19,130	308,566.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	1,014,516.40	
		AMERICAN TOWER CORP	17,639	4,982,311.94	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	515,823.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,925	1,338,279.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,977	694,168.78	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	581,840.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,080	3,469,118.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,095	1,745,465.40	
		DUKE REALTY CORPORATION	16,085	810,684.00	
		EQUINIX INC	3,588	2,983,314.36	

		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	504,630.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	14,290	1,196,930.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	814,258.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	878,613.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	724,535.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	31,199	498,560.02	
		INVITATION HOMES INC	22,810	911,715.70	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	507,927.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	414,462.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,030	744,421.60	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	416,044.80	
		PROLOGIS INC	29,068	3,699,775.04	
		PUBLIC STORAGE	6,119	1,920,998.86	
		REALTY INCOME CORP	15,030	1,045,486.80	
		REGENCY CENTERS CORP	6,695	433,166.50	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,100	1,369,851.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,554	1,562,973.00	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	806,708.40	
		UDR INC	13,480	717,810.00	
		VENTAS INC	14,825	883,866.50	
		VEREIT INC	7,592	367,528.72	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	664,527.60	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	309,733.71	
		WELLTOWER INC	17,230	1,545,186.40	
		WEYERHAEUSER CO	27,788	945,347.76	
		WP CAREY INC	6,460	512,148.80	
米ドル小計			509,790	42,841,297.54 (4,707,401,773)	
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	172,452.00	
加ドル小計			2,800	172,452.00 (14,996,425)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	149,842.00	
		GECINA SA	1,950	258,570.00	
		KLEPIERRE	6,642	141,474.60	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,360	389,725.60	
ユーロ小計			15,877	939,612.20 (121,858,306)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	184,350.28	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	229,380.48	
		SEGRO PLC	45,033	528,462.25	
英ポンド小計			116,148	942,193.01 (142,393,629)	

豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	35,587	365,834.36
		GOODMAN GROUP	63,582	1,395,624.90
		GPT GROUP	71,335	338,127.90
		LENDLEASE GROUP	28,927	335,263.93
		MIRVAC GROUP	135,075	386,314.50
		SCENTRE GROUP	198,271	519,470.02
		STOCKLAND	96,900	425,391.00
		VICINITY CENTRES	191,002	289,368.03
豪ドル小計			820,679	4,055,394.64 (328,486,965)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	87,500	6,615,000.00
香港ドル小計			87,500	6,615,000.00 (93,602,250)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	355,703.58
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	191,228	411,140.20
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	155,230.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	295,525.88
シンガポールドル小計			519,070	1,217,599.66 (98,503,812)
合計				5,507,243,160 (5,507,243,160)

(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 599銘柄	97.2%		70.7%
	投資証券 37銘柄		2.8%	2.0%
加ドル	株式 88銘柄	99.8%		3.5%
	投資証券 1銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 230銘柄	99.5%		10.3%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.1%
英ポンド	株式 84銘柄	98.7%		4.4%
	投資証券 3銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%		3.1%
スウェーデンクローナ	株式 41銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 55銘柄	93.7%		2.1%
	投資証券 8銘柄		6.3%	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	31銘柄	95.9%		0.9%
	投資証券	1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.3%		0.3%
	投資証券	4銘柄		12.7%	0.0%
イスラエルシケル	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。

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	717,399	480,504
親投資信託受益証券	69,101,154	44,874,518
流動資産合計	69,818,553	45,355,022
資産合計	69,818,553	45,355,022
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	126	162
未払委託者報酬	254	328
その他未払費用	43,533	36,448
流動負債合計	43,913	36,938
負債合計	43,913	36,938
純資産の部		
元本等		
元本	71,210,194	32,023,021
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,435,554	13,295,063
（分配準備積立金）	13,433,072	13,641,373
元本等合計	69,774,640	45,318,084
純資産合計	69,774,640	45,318,084
負債純資産合計	69,818,553	45,355,022

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）

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	79,574,737円	71,210,194円
	期首からの追加設定元本額	31,756,460円	5,797,048円
	期首からの一部解約元本額	40,121,003円	44,984,221円
2.	受益権の総数	71,210,194口	32,023,021口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,435,554円	- 円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2020年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	283,026
合計	283,026

（2021年 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,915
合計	6,915

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	0.9798円	1口当たり純資産額	1.4152円
(1万口当たり純資産額)	(9,798円)	(1万口当たり純資産額)	(14,152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
親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	17,287,356	44,874,518	
合計		17,287,356	44,874,518	

（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。

「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」は、「海外リートインデックス（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。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,067,341,060	628,484,684
コール・ローン	13,590,779	22,500,503
投資証券	122,987,484,130	75,971,366,832
未収入金	80,599	880,542
未収配当金	259,511,508	129,177,567
流動資産合計	124,328,008,076	76,752,410,128
資産合計		
124,328,008,076		
負債の部		
流動負債		
未払利息	11	16
流動負債合計	11	16
負債合計		
11		
純資産の部		
元本等		
元本	69,758,679,027	29,567,818,913
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	54,569,329,038	47,184,591,199
元本等合計	124,328,008,065	76,752,410,112
純資産合計		
124,328,008,065		
負債純資産合計		
124,328,008,076		

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

3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	16,383,427,395円	69,758,679,027円
	期首からの追加設定元本額	60,467,541,718円	90,636,247円
	期首からの一部解約元本額	7,092,290,086円	40,281,496,361円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,565,026,234円	2,236,296,361円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	38,770,776円	17,287,356円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	66,810,104,513円	26,987,171,766円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	344,777,504円	327,063,430円
	計	69,758,679,027円	29,567,818,913円
2.	受益権の総数	69,758,679,027口	29,567,818,913口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	5,156,231,447
合計	5,156,231,447

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	16,374,456
合計	16,374,456

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

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.7823円	1口当たり純資産額	2.5958円
(1万口当たり純資産額)	(17,823円)	(1万口当たり純資産額)	(25,958円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	38,928	825,662.88	
		AGREE REALTY CORPORATION	30,607	2,249,308.43	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	32,207	600,338.48	
		ALEXANDER'S INC	1,007	273,390.43	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	61,664	11,938,767.04	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,546	834,202.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	61,887	3,125,912.37	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	48,570	409,930.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	122,960	5,122,513.60	
		AMERICOLD REALTY TRUST	113,513	4,516,682.27	
		APARTMENT INCOME REIT CO	70,686	3,645,983.88	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	67,157	473,456.85	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	92,825	1,347,819.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	26,923	358,345.13	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	62,759	14,175,375.33	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	12,764	141,552.76	
BOSTON PROPERTIES INC	63,949	7,427,036.86	
BRANDYWINE REALTY TRUST	77,178	1,076,633.10	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	133,403	2,992,229.29	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	69,996	1,721,901.60	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	17,390	319,280.40	
BRT APARTMENTS CORP	4,777	84,743.98	
CAMDEN PROPERTY TRUST	43,891	6,321,181.82	
CARETRUST REIT INC	43,112	1,026,496.72	
CENTERSPACE	5,844	506,031.96	
CHATHAM LODGING TRUST	21,530	258,144.70	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	10,211	85,261.85	
CITY OFFICE REIT INC	19,574	244,087.78	
CLIPPER REALTY INC	6,271	51,422.20	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	51,527	884,718.59	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	10,029	496,335.21	
COREPOINT LODGING INC	17,007	237,587.79	
CORESITE REALTY CORP	19,396	2,680,721.16	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	50,556	1,502,018.76	
COUSINS PROPERTIES INC	66,790	2,605,477.90	
CTO REALTY GROWTH INC	2,671	147,733.01	
CUBESMART	90,642	4,404,294.78	
CYRUSONE INC	55,104	4,076,042.88	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	93,750	850,312.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	126,586	19,914,509.52	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	218,095	1,579,007.80	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	107,405	434,990.25	
DOUGLAS EMMETT INC	74,390	2,532,235.60	
DUKE REALTY CORPORATION	168,483	8,491,543.20	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	37,860	826,483.80	
EASTGROUP PROPERTIES INC	17,970	3,109,888.20	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	64,072	759,253.20	
EPR PROPERTIES	33,588	1,796,622.12	

EQUINIX INC	40,261	33,475,813.67	
EQUITY COMMONWEALTH	55,378	1,501,297.58	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,233	6,106,263.30	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	154,718	12,959,179.68	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	52,544	1,469,130.24	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,224	9,595,115.92	
EXTRA SPACE STORAGE INC	60,156	10,343,222.64	
FARMLAND PARTNERS INC	12,266	151,730.42	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	31,876	3,734,273.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	57,989	3,151,122.26	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	33,886	975,239.08	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	43,801	222,947.09	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	98,180	4,589,915.00	
GEO GROUP INC/THE	55,946	363,649.00	
GETTY REALTY CORPORATION	16,586	533,239.90	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	15,683	358,356.55	
GLADSTONE LAND CORP	11,286	270,299.70	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	23,973	366,547.17	
GLOBAL NET LEASE INC	42,315	779,442.30	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	63,991	1,996,519.20	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	98,683	2,758,189.85	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	242,250	8,614,410.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,561	161,635.36	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	46,804	2,199,788.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	317,313	5,070,661.74	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	67,894	1,880,663.80	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	45,673	900,214.83	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	29,100	785,409.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	10,695	2,235,682.80	
INVITATION HOMES INC	254,856	10,186,594.32	
IRON MOUNTAIN INC	129,933	5,628,697.56	
JBG SMITH PROPERTIES	49,730	1,638,603.50	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	324,700	263,007.00	
KILROY REALTY CORPORATION	47,743	3,360,152.34	
KIMCO REALTY CORPORATION	194,837	4,114,957.44	

KITE REALTY GROUP TRUST	37,822	787,832.26	
LEXINGTON REALTY TRUST	125,058	1,576,981.38	
LIFE STORAGE INC	34,536	3,931,578.24	
LTC PROPERTIES INC	17,693	704,004.47	
MACERICH CO/THE	75,302	1,263,567.56	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	39,119	689,667.97	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	648,347	525,161.07	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	264,322	5,450,319.64	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	51,426	9,499,410.72	
MONMOUTH RE INVST CORP	43,805	842,370.15	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	78,982	3,825,888.08	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	30,992	1,652,493.44	
NATL HEALTH INVESTORS INC	20,558	1,394,243.56	
NETSTREIT CORP	10,855	274,197.30	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	34,458	317,013.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,142	604,868.88	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	21,711	634,829.64	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	105,693	3,940,235.04	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,042	208,231.94	
PARAMOUNT GROUP INC	74,945	740,456.60	
PARK HOTELS & RESORTS INC	106,089	1,950,976.71	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	58,749	1,313,040.15	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	28,444	57,172.44	
PHYSICIANS REALTY TRUST	96,943	1,807,017.52	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	55,958	1,068,797.80	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,780	278,220.60	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	22,957	236,686.67	
PRIME US REIT	215,000	184,900.00	
PROLOGIS INC	332,373	42,304,435.44	
PS BUSINESS PARKS INC	9,069	1,403,699.82	
PUBLIC STORAGE	68,464	21,493,588.16	
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	30,976	2,402,498.56	
REALTY INCOME CORP	167,907	11,679,610.92	
REGENCY CENTERS CORP	71,060	4,597,582.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	53,170	927,816.50	

RETAIL PROPERTIES OF AME - A	96,233	1,108,604.16	
RETAIL VALUE INC	7,745	188,435.85	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	60,106	3,555,870.96	
RLJ LODGING TRUST	73,835	1,035,166.70	
RPT REALTY	36,269	459,165.54	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,709	1,937,926.87	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	96,623	1,770,133.36	
SAFEHOLD INC	6,406	532,210.48	
SAUL CENTERS INC	5,805	256,348.80	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	17,972	281,082.08	
SERVICE PROPERTIES TRUST	74,300	870,796.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	147,649	18,382,300.50	
SITE CENTERS CORP	75,803	1,136,286.97	
SL GREEN REALTY CORP	31,256	2,368,267.12	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	51,462	2,495,907.00	
STAG INDUSTRIAL INC	71,699	2,872,261.94	
STORE CAPITAL CORP	109,336	3,950,309.68	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	46,945	416,871.60	
SUN COMMUNITIES INC	50,230	9,251,361.40	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	96,967	1,106,393.47	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	45,402	802,707.36	
TERRENO REALTY CORP	31,195	2,090,376.95	
UDR INC	133,455	7,106,478.75	
UMH PROPERTIES INC	18,388	418,878.64	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	5,714	356,610.74	
URBAN EDGE PROPERTIES	49,469	913,692.43	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	13,164	251,958.96	
VENTAS INC	168,482	10,044,896.84	
VEREIT INC	102,998	4,986,133.18	
VICI PROPERTIES INC	240,978	7,504,054.92	
VORNADO REALTY TRUST	70,731	3,197,748.51	
WASHINGTON REIT	38,231	942,394.15	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	53,844	1,748,314.68	
WELLTOWER INC	187,604	16,824,326.72	
WHITESTONE REIT	18,449	146,854.04	

		WP CAREY INC	80,001	6,342,479.28
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	50,973	906,299.94
米ドル小計			11,596,989	521,423,338.72 (57,293,996,458)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	28,156	1,290,389.48
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	29,573	352,214.43
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	8,129	103,075.72
		BOARDWALK EQUITIES INC	10,130	460,104.60
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	38,173	2,351,075.07
		CHOICE PROPERTIES REIT	73,653	1,087,118.28
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,339	465,477.14
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,564	393,543.00
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	23,632	402,216.64
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	40,958	656,556.74
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	11,358	255,100.68
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,041	893,036.61
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	14,465	1,248,329.50
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	63,655	1,071,313.65
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	30,999	559,841.94
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	24,931	529,534.44
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	8,324	205,686.04
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	9,333	167,994.00
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	42,976	562,555.84
		PLAZA RETAIL REIT	24,148	110,356.36
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	70,585	1,608,632.15
		SLATE GROCERY REIT	10,399	138,098.72
		SLATE OFFICE REIT	15,721	85,050.61
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	32,118	974,781.30		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	36,399	685,029.18		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	18,101	135,757.50		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	18,412	428,999.60		
加ドル小計			796,272	17,221,869.22 (1,497,613,747)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	16,117	1,909,864.50
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	80,280	1,354,323.60

		ALTAREA	1,640	303,400.00	
		BEFIMMO S.C.A.	12,085	429,621.75	
		CARE PROPERTY INVEST	11,602	328,916.70	
		CARMILA	20,909	244,635.30	
		COFINIMMO	13,314	1,774,756.20	
		COVIVIO	21,648	1,685,080.32	
		CROMWELL REIT EUR	133,460	337,653.80	
		EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	16,969	361,779.08	
		GECINA SA	24,428	3,239,152.80	
		HAMBORNER REIT AG	32,810	306,248.54	
		HIBERNIA REIT PLC	316,684	408,522.36	
		ICADE	14,078	1,052,330.50	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	24,346	99,940.33	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	115,061	996,428.26	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,525	257,336.25	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	206,793	326,732.94	
		KLEPIERRE	90,029	1,917,617.70	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	28,994	149,609.04	
		MERCIALYS	17,784	186,198.48	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	151,418	1,382,143.50	
		MONTEA	4,513	493,722.20	
		NSI NV	7,741	276,740.75	
		RETAIL ESTATES	4,949	362,761.70	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	62,261	4,526,997.31	
		VASTNED RETAIL	8,663	223,938.55	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	61,223	2,151,376.22	
		WERELDHAVE NV	18,131	260,361.16	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	8,090	438,478.00	
			1,536,545	27,786,667.84	
				(3,603,652,952)	
英債券	投資証券	AEW UK REIT PLC	72,924	72,559.38	
		ASSURA PLC	1,213,166	932,924.65	
		BIG YELLOW GROUP PLC	74,343	1,043,775.72	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	359,635	327,987.12	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	421,731	2,102,329.03	

		CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	383,595	635,616.91	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	285,824	331,555.84	
		CUSTODIAN REIT PLC	197,901	198,296.80	
		DERWENT LONDON PLC	50,406	1,745,559.78	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	272,190	250,686.99	
		GCP STUDENT LIVING PLC	203,694	439,979.04	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	114,290	841,745.85	
		HAMMERSON PLC	1,893,669	686,455.01	
		HOME REIT PLC	105,775	118,996.87	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	160,154	184,177.10	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	337,855	2,270,385.60	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	409,837	1,006,559.67	
		LXI REIT PLC	281,356	406,278.06	
		NEWRIVER REIT PLC	142,157	116,568.74	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	247,304	221,831.68	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	602,737	962,570.98	
		REGIONAL REIT LTD	193,068	169,899.84	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	94,848	975,037.44	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	255,481	125,185.69	
		SEGRO PLC	539,023	6,325,434.90	
		SHAFTESBURY PLC	137,066	798,409.45	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	182,745	129,017.97	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	370,554	431,695.41	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	170,366	177,862.10	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	773,852	1,583,301.19	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	334,850	261,852.70	
		UNITE GROUP PLC	178,532	2,017,411.60	
		WORKSPACE GROUP PLC	57,458	475,752.24	
			11,877,132	28,367,701.35	
		英債券小計		(4,287,210,705)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	190,672	600,616.80	
		APN INDUSTRIA REIT	72,032	237,705.60	
		ARENA REIT	156,277	562,597.20	
		AVENTUS GROUP	172,986	529,337.16	

		BWP TRUST	229,118	964,586.78	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	258,471	790,921.26	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	215,725	821,912.25	
		CENTURIA OFFICE REIT	176,379	430,364.76	
		CHARTER HALL GROUP	209,554	3,206,176.20	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	255,728	1,253,067.20	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	240,876	891,241.20	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	151,159	536,614.45	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	887,915	776,925.62	
		DEXUS/AU	488,896	5,025,850.88	
		GDI PROPERTY GROUP	254,950	281,719.75	
		GOODMAN GROUP	756,563	16,606,557.85	
		GPT GROUP	870,829	4,127,729.46	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	138,163	538,835.70	
		HOME CONSORTIUM	81,962	450,791.00	
		HOMEKO DAILY NEEDS REIT	210,394	313,487.06	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	80,574	260,254.02	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	133,895	792,658.40	
		IRONGATE GROUP	256,806	377,504.82	
		MIRVAC GROUP	1,776,291	5,080,192.26	
		NATIONAL STORAGE REIT	497,047	1,058,710.11	
		RURAL FUNDS GROUP	159,707	415,238.20	
		RURAL FUNDS GROUP-RTS	19,012	2,471.56	
		SCENTRE GROUP	2,336,947	6,122,801.14	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	501,414	1,223,450.16	
		STOCKLAND	1,074,019	4,714,943.41	
		VICINITY CENTRES	1,746,600	2,646,099.00	
		WAYPOINT REIT LTD	370,032	958,382.88	
豪ドル小計			14,970,993	62,599,744.14	(5,070,579,275)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	620,082	1,475,795.16	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	267,610	864,380.30	
ニュージーランドドル小計			887,692	2,340,175.46	(179,351,047)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	903,000	4,027,380.00	

		FORTUNE REIT	655,000	5,502,000.00	
		LINK REIT	938,200	70,927,920.00	
		PROSPERITY REIT	578,000	1,762,900.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	477,000	2,289,600.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	732,000	2,942,640.00	
香港ドル小計			4,484,200	88,326,790.00	(1,249,824,078)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	208,725	329,785.50	
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	576,994	516,409.63	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,486,332	4,548,175.92	
		ASCOTT TRUST	852,192	886,279.68	
		CAPITALAND CHINA TRUST	447,785	613,465.45	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,047,392	4,401,892.80	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	344,300	426,932.00	
		EC WORLD REIT	122,900	100,163.50	
		ESR REIT	1,181,659	519,929.96	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	470,700	280,066.50	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	608,040	161,130.60	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	607,105	1,499,549.35	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	341,400	180,942.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,286,660	1,968,589.80	
		IREIT GLOBAL	213,454	138,745.10	
		IREIT GLOBAL(N)	45,679	29,691.35	
		KEPPEL DC REIT	575,077	1,506,701.74	
		KEPPEL REIT	890,900	1,060,171.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	400,800	350,700.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	2,605,760	164,162.88	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	989,631	2,127,706.65	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	875,408	2,529,929.12	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,309,614	2,776,381.68	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	955,600	984,268.00			
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,116,935	474,697.37			
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	177,100	850,080.00			
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	317,700	138,199.50			

		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	234,200	227,174.00	
		SPH REIT	475,100	451,345.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	647,900	395,219.00	
		SUNTEC REIT	990,600	1,505,712.00	
シンガポールドル小計			23,403,642	32,144,197.08	(2,600,465,543)
韓国ウォン	投資証券	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,316	336,244,720.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,383	62,947,990.00	
		JR REIT XXVII	50,551	267,414,790.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17,547	108,089,520.00	
		LOTTE REIT CO LTD	61,671	363,858,900.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,250	75,237,500.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	28,125	223,031,250.00	
韓国ウォン小計			230,843	1,436,824,670.00	(137,935,168)
イスラエルシェケル	投資証券	REIT 1 LTD	87,544	1,518,888.40	
イスラエルシェケル小計			87,544	1,518,888.40	(50,737,859)
合計				75,971,366,832	(75,971,366,832)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 156銘柄	100.0%	75.5%
加ドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	4.7%
英債券	投資証券 34銘柄	100.0%	5.6%
豪ドル	投資証券 32銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	1.6%

シンガポールドル	投資証券	31銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券	7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)

貸借対照表

(単位:円)

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	162,158	109,151
親投資信託受益証券	14,062,357	10,598,705
流動資産合計	14,224,515	10,707,856
資産合計	14,224,515	10,707,856
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	12	28
未払委託者報酬	26	58
その他未払費用	9,654	8,986
流動負債合計	9,692	9,072
負債合計	9,692	9,072
純資産の部		
元本等		
元本	12,781,905	9,085,632
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,432,918	1,613,152
(分配準備積立金)	3,072,858	2,554,611
元本等合計	14,214,823	10,698,784
純資産合計	14,214,823	10,698,784
負債純資産合計	14,224,515	10,707,856

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)

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	17,586,949円	12,781,905円
	期首からの追加設定元本額	1,094,219円	815,497円
	期首からの一部解約元本額	5,899,263円	4,511,770円
2.	受益権の総数	12,781,905口	9,085,632口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2020年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	25,205
合計	25,205

（2021年 7月19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	12,438
合計	12,438

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1,112円	1口当たり純資産額	1,177円
(1万口当たり純資産額)	(11,121円)	(1万口当たり純資産額)	(11,775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
親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	7,774,302	10,598,705	
合計		7,774,302	10,598,705	

（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。

「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」は、「海外新興国債券インデックスLocal（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。

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	12,223,841	19,499,438
コール・ローン	64,840,974	48,663,597
国債証券	5,561,548,702	6,691,362,111
派生商品評価勘定	6,570	-
未収利息	79,606,614	97,287,071
前払費用	5,542,711	4,325,642
流動資産合計	5,723,769,412	6,861,137,859
資産合計	5,723,769,412	6,861,137,859
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,021	150,963
未払金	15,276,606	35,065,033
未払解約金	3,843,741	1,098,422
未払利息	53	36
流動負債合計	19,128,421	36,314,454
負債合計	19,128,421	36,314,454
純資産の部		
元本等		
元本	4,445,728,274	5,006,114,052
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,258,912,717	1,818,709,353
元本等合計	5,704,640,991	6,824,823,405
純資産合計	5,704,640,991	6,824,823,405
負債純資産合計	5,723,769,412	6,861,137,859

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	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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	3,789,304,628円	4,445,728,274円
	期首からの追加設定元本額	867,055,574円	804,403,355円
	期首からの一部解約元本額	210,631,928円	244,017,577円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（1年決算型）	4,434,769,454円	4,998,339,750円
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	10,958,820円	7,774,302円
	計	4,445,728,274円	5,006,114,052円
2.	受益権の総数	4,445,728,274口	5,006,114,052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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	46,390,908
合計	46,390,908

（2021年 7月19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	2,659,535
合計	2,659,535

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	15,585,453	-	15,584,002	1,451
	メキシコペソ	4,402,200	-	4,397,600	4,600
	チェココルナ	5,226,453	-	5,223,032	3,421
	ポーランドズロチ	5,956,800	-	5,963,370	6,570
	合計	15,585,453	-	15,584,002	1,451

(2021年 7月19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	61,778,220	-	61,615,047	163,173
	米ドル	26,376,000	-	26,370,960	5,040
	ブラジルリアル	11,979,101	-	11,898,374	80,727
	コロンビアペソ	11,711,361	-	11,654,102	57,259
	ウルグアイペソ	11,711,758	-	11,691,611	20,147
	売建	35,402,220	-	35,390,010	12,210
	米ドル	35,402,220	-	35,390,010	12,210
	合計	97,180,440	-	97,005,057	150,963

(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)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2832円	1口当たり純資産額	1.3633円
(1万口当たり純資産額)	(12,832円)	(1万口当たり純資産額)	(13,633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
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	10,000,000.00	10,093,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	8,800,000.00	8,956,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,830,000.00	9,243,906.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	7,800,000.00	8,202,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	9,010,000.00	10,040,518.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,800,000.00	10,486,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	10,230,000.00	10,636,003.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	9,560,000.00	10,521,975.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	7,450,000.00	7,880,703.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	3,000,000.00	3,177,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	2,530,000.00	3,192,543.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	7,190,000.00	7,933,715.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	6,360,000.00	6,536,887.50	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	6,250,000.00	6,576,171.87			
メキシコペソ小計			107,810,000.00	113,478,424.98 (625,368,252)	

ブラジル レアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-8.5%-24/01/05	350,000.00	356,125.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	265,859.37	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-22/07/01	2,550,000.00	2,398,408.42	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-23/07/01	4,400,000.00	3,796,538.62	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-24/01/01	6,900,000.00	5,702,507.88	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-24/07/01	1,400,000.00	1,108,650.52	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%- 23/01/01	3,650,000.00	3,773,004.22	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%- 25/01/01	3,490,000.00	3,665,372.29	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%- 27/01/01	2,690,000.00	2,838,865.43	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%- 29/01/01	1,620,000.00	1,713,961.87	
NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%- 31/01/01	650,000.00	682,191.97			
ブラジルレアル小計			27,950,000.00	26,301,485.59	(564,984,842)
チリペソ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS-4.0%-23/03/01	80,000,000.00	82,327,480.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-2.5%-25/03/01	215,000,000.00	210,415,866.75	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-26/03/01	185,000,000.00	193,438,303.25	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.7%-30/09/01	95,000,000.00	98,417,017.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-35/03/01	210,000,000.00	216,291,033.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-43/01/01	145,000,000.00	165,120,656.75	
チリペソ小計			930,000,000.00	966,010,356.75	(140,063,773)
コロンビ アペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	29,953,125.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	113,975,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA-6.25%-36/07/09	450,000,000.00	397,406,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.25%-50/10/26	400,000,000.00	374,250,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	945,000,000.00	976,598,437.50	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,085,000,000.00	1,237,239,062.50	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	900,000,000.00	916,875,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,720,000,000.00	1,824,812,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	1,580,000,000.00	1,531,612,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	905,000,000.00	955,057,812.50	

		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	910,000,000.00	897,203,125.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.25%-34/10/18	1,340,000,000.00	1,324,925,000.00	
コロンビアペソ小計			10,362,000,000.00	10,579,907,812.50	(304,458,007)
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	310,000.00	340,099.14	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	810,000.00	888,730.78	
		BONOS DE TESORERIA-5.94%-29/02/12	450,000.00	481,574.92	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	700,000.00	720,149.15	
		BONOS DE TESORERIA-5.4%-34/08/12	350,000.00	325,252.72	
		BONOS DE TESORERIA-5.35%-40/08/12	450,000.00	395,306.10	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	640,000.00	773,589.44	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	490,000.00	541,705.04	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	770,000.00	799,792.45	
ペルーヌエボソル小計			4,970,000.00	5,266,199.74	(148,162,949)
ウルグアイペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%-28/03/15	1,300,000.00	1,353,288.82	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.25%-31/05/21	4,500,000.00	4,587,759.22	
ウルグアイペソ小計			5,800,000.00	5,941,048.04	(14,885,295)
ドミニカペソ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC-8.9%-23/02/15	8,000,000.00	8,410,960.00	
ドミニカペソ小計			8,000,000.00	8,410,960.00	(16,207,078)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-22/03/02	790,000.00	757,610.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-22/08/17	720,000.00	669,060.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	490,000.00	443,082.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.2%-23/01/18	720,000.00	668,880.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	860,000.00	731,430.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-16.2%-23/06/14	800,000.00	776,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	350,000.00	298,287.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	760,000.00	611,800.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	820,000.00	614,180.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.6%-25/10/01	900,000.00	769,950.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	1,160,000.00	911,180.00	

		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	810,000.00	628,155.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	840,000.00	630,630.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.4%-28/03/08	450,000.00	369,450.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.7%-30/11/13	1,400,000.00	1,072,750.00	
トルコリラ小計			11,870,000.00	9,952,445.00	(128,278,058)
チェコ ルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-4.7%-22/09/12	3,420,000.00	3,594,420.00	
		CZECH REPUBLIC-0.45%-23/10/25	4,300,000.00	4,218,300.00	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	3,220,000.00	3,614,248.75	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	4,300,000.00	4,436,869.00	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	5,100,000.00	4,941,925.50	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	5,100,000.00	4,722,625.50	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	5,070,000.00	5,336,200.35	
		CZECH REPUBLIC-2.75%-29/07/23	4,400,000.00	4,736,622.00	
		CZECH REPUBLIC-0.05%-29/11/29	1,800,000.00	1,564,209.00	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	4,550,000.00	4,247,447.75	
		CZECH REPUBLIC-1.2%-31/03/13	4,300,000.00	4,074,250.00	
		CZECH REPUBLIC-2.0%-33/10/13	4,900,000.00	4,985,848.00	
		CZECH REPUBLIC-4.2%-36/12/04	2,600,000.00	3,389,165.00	
チェコルナ小計			53,060,000.00	53,862,130.85	(273,538,831)
ハンガ リー フォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	18,800,000.00	19,894,160.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.75%- 22/10/26	53,000,000.00	53,726,895.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	50,000,000.00	55,209,750.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	44,000,000.00	45,610,400.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-24/10/24	58,000,000.00	59,273,100.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	59,800,000.00	67,788,981.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-25/11/26	40,000,000.00	38,355,200.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/04/22	23,000,000.00	22,421,435.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%- 26/12/22	51,000,000.00	52,692,690.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	67,000,000.00	69,864,585.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%- 28/10/22	33,300,000.00	43,110,013.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-29/05/23	29,000,000.00	28,289,790.00	

		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-30/08/21	45,000,000.00	47,012,625.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.25%-31/10/22	60,000,000.00	63,717,300.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%-33/04/20	33,000,000.00	31,075,770.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-38/10/27	27,500,000.00	27,081,587.50	
ハンガリーフォリント小計			692,400,000.00	725,124,282.00	(261,625,566)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	1,420,000.00	1,445,063.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,067,600.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	1,580,000.00	1,634,036.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,210,000.00	1,308,348.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	1,420,000.00	1,496,197.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,230,000.00	1,291,426.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	870,000.00	868,529.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,270,000.00	1,384,465.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,930,000.00	2,053,751.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	850,000.00	806,769.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,370,000.00	1,461,310.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	1,340,000.00	1,459,407.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,090,000.00	2,285,895.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	1,410,000.00	1,363,526.40	
ポーランドズロチ小計			18,990,000.00	19,926,326.60	(563,582,273)
ロシアルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	13,500,000.00	13,648,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-22/12/07	14,700,000.00	14,869,050.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	7,400,000.00	7,435,520.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	12,400,000.00	12,457,908.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.5%-24/02/28	14,900,000.00	14,783,780.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-24/07/17	19,800,000.00	20,113,236.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.1%-24/10/16	16,900,000.00	17,043,819.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-4.5%-25/07/16	3,000,000.00	2,761,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.15%-25/11/12	21,800,000.00	22,050,700.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.75%-26/09/16	16,700,000.00	17,312,890.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.95%-26/10/07	15,000,000.00	15,682,500.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	15,400,000.00	16,247,000.00	

		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.0%-27/10/06	21,000,000.00	20,004,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	15,900,000.00	15,963,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-5.7%-28/05/17	10,000,000.00	9,320,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.9%-29/05/23	15,300,000.00	15,220,746.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.65%-30/04/10	20,400,000.00	21,205,800.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.5%-31/09/17	11,650,000.00	12,842,144.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.7%-33/03/23	16,000,000.00	16,768,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.25%-34/05/10	15,000,000.00	15,172,650.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.1%-35/07/18	16,000,000.00	14,576,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.7%-39/03/16	14,500,000.00	15,239,500.00	
ロシアルーブル小計			327,250,000.00	330,719,443.50 (489,464,776)	
ルーマニア アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.4%-22/03/08	450,000.00	453,406.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	560,000.00	568,892.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	480,000.00	508,432.80	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.25%- 23/06/28	480,000.00	496,346.40	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.4%-23/09/25	500,000.00	519,690.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	250,000.00	257,803.75	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 24/04/29	630,000.00	639,944.55	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.5%-24/06/17	450,000.00	472,740.75	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.7%-24/11/25	200,000.00	206,368.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	550,000.00	586,940.75	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%- 25/07/28	320,000.00	329,352.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%- 26/04/22	450,000.00	485,925.75	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 26/06/24	200,000.00	201,436.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	520,000.00	594,768.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%- 28/01/26	400,000.00	419,114.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.0%-29/02/12	460,000.00	507,658.30	
ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%- 31/09/24	470,000.00	466,647.72			

ルーマニアレイ小計			7,370,000.00	7,715,468.27 (203,092,728)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	470,000.00	484,899.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	500,000.00	519,025.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	400,000.00	413,900.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	500,000.00	526,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	850,000.00	898,450.03	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	480,000.00	508,080.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	500,000.00	533,625.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	690,000.00	729,675.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	940,000.00	990,760.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	450,000.00	429,075.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	820,000.00	821,230.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	550,000.00	579,975.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	635,000.00	699,452.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	760,000.00	734,920.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	550,000.00	540,375.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.729%- 22/03/31	350,000.00	354,690.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.948%- 22/04/14	530,000.00	538,453.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.151%- 23/05/15	300,000.00	306,558.75	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.094%- 23/11/30	500,000.00	524,025.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.655%- 24/10/15	170,000.00	177,284.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.128%- 25/08/15	700,000.00	742,560.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.726%- 26/03/31	550,000.00	577,500.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%- 27/07/26	580,000.00	620,890.00	
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.422%- 27/09/30	570,000.00	584,820.00			
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.369%- 28/10/31	730,000.00	792,415.00			
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.13%- 29/07/09	570,000.00	607,050.00			

		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.465%-30/10/15	750,000.00	761,625.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.447%-36/07/15	200,000.00	189,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	980,000.00	1,005,235.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	730,000.00	769,493.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	450,000.00	465,525.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	750,000.00	786,375.00	
		マレーシアリングット小計	18,505,000.00	19,213,641.28 (501,370,362)	
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-22/06/17	6,000,000.00	6,077,354.40	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-22/12/17	9,000,000.00	9,192,353.40	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	7,100,000.00	7,520,915.69	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.4%-23/12/17	8,700,000.00	9,088,700.34	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.75%-24/06/17	5,500,000.00	5,531,661.85	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.45%-24/12/17	9,700,000.00	9,979,319.26	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.95%-25/06/17	9,800,000.00	9,908,541.86	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	7,370,000.00	8,364,571.91	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-26/12/17	10,300,000.00	10,992,728.56	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%-28/12/17	8,200,000.00	9,146,125.84	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	10,680,000.00	13,417,351.28	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%-29/12/17	6,300,000.00	6,370,560.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-31/06/20	8,300,000.00	9,808,940.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-31/12/17	3,000,000.00	3,096,592.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%-32/06/25	10,500,000.00	12,543,408.15	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%- 35/06/17	4,500,000.00	4,282,235.10	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.585%- 35/12/17	4,700,000.00	4,428,340.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%- 36/06/17	8,250,000.00	9,536,175.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.3%- 38/06/17	10,300,000.00	11,788,746.03	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%- 42/06/17	2,500,000.00	2,332,319.75	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%- 46/06/17	7,300,000.00	7,735,080.00	
タイパーツ小計			158,000,000.00	171,142,020.62 (571,614,348)	
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-3.9%-22/11/26	10,000,000.00	10,092,045.00	
フィリピン小計			10,000,000.00	10,092,045.00 (22,072,311)	
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	3,370,000,000.00	3,471,100,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	4,250,000,000.00	4,362,625,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	5,400,000,000.00	5,921,100,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.125%-24/05/15	3,200,000,000.00	3,505,600,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-25/06/15	5,700,000,000.00	6,010,650,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	1,060,000,000.00	1,285,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.5%-26/04/15	500,000,000.00	504,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,890,000,000.00	4,409,315,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	2,900,000,000.00	3,094,300,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	3,600,000,000.00	3,627,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	3,350,000,000.00	3,931,225,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-29/05/15	4,300,000,000.00	4,850,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	1,034,775,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-30/09/15	4,300,000,000.00	4,510,700,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-31/02/15	2,300,000,000.00	2,327,600,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	2,300,000,000.00	2,677,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	1,120,000,000.00	1,360,240,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,400,000,000.00	1,571,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	1,600,000,000.00	1,706,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	3,330,000,000.00	3,321,675,000.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	4,300,000,000.00	4,822,450,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-35/06/15	3,150,000,000.00	3,296,474,842.50	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,560,000,000.00	2,850,560,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.25%-36/06/15	800,000,000.00	792,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	3,300,000,000.00	3,423,750,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-39/04/15	1,950,000,000.00	2,185,950,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-40/04/15	2,700,000,000.00	2,820,150,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.75%-23/08/15	500,000,000.00	539,967,900.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%-31/11/15	1,090,000,000.00	1,271,493,338.50	
インドネシアルピア小計			79,030,000,000.00	85,485,951,081.00	(649,693,228)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.36%-23/07/02	1,000,000.00	996,457.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-23/10/18	3,100,000.00	3,155,206.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	1,000,000.00	1,006,498.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	1,300,000.00	1,321,133.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	2,400,000.00	2,418,852.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	3,300,000.00	3,210,357.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,020,883.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	2,000,000.00	2,036,472.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	2,100,000.00	2,145,706.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	2,300,000.00	2,335,779.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	3,000,000.00	2,994,268.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	2,000,000.00	2,047,964.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	2,200,000.00	2,244,453.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	3,100,000.00	3,170,242.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,100,000.00	2,119,497.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	3,000,000.00	2,915,064.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	2,000,000.00	2,046,915.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	2,000,000.00	2,093,453.00	
中国元小計			39,900,000.00	40,279,203.95	(683,252,108)
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%-23/02/28	4,650,000.00	4,830,947.54	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	11,250,000.00	12,717,889.31	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	8,930,000.00	8,449,395.88	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	4,440,000.00	3,797,409.45	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,350,000.00	5,774,877.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	5,800,000.00	5,222,672.64	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	4,190,000.00	2,938,864.53	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	7,510,000.00	6,376,887.44	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	4,770,000.00	4,149,577.78	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	3,090,000.00	2,044,940.83	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	5,680,000.00	4,744,026.31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	10,250,000.00	8,551,371.53	
南アフリカランド小計		76,910,000.00	69,598,860.24 (529,647,326)	
合計			6,691,362,111 (6,691,362,111)	

(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
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.3%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.4%
チリペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.6%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.2%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.9%

チェココルナ	国債証券	13銘柄	100.0%	4.1%
ハンガリーフォリント	国債証券	16銘柄	100.0%	3.9%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	8.4%
ロシアルーブル	国債証券	22銘柄	100.0%	7.3%
ルーマニアレイ	国債証券	17銘柄	100.0%	3.0%
マレーシアリングット	国債証券	32銘柄	100.0%	7.5%
タイバーツ	国債証券	21銘柄	100.0%	8.5%
フィリピンペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアアルピア	国債証券	29銘柄	100.0%	9.7%
中国元	国債証券	18銘柄	100.0%	10.5%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	7.9%

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。

F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,978,524	15,254,191
親投資信託受益証券	3,929,324,968	2,976,684,746
派生商品評価勘定	-	9,706,572
未収入金	8,642,153	-
流動資産合計	3,957,945,645	3,001,645,509
資産合計		
	3,957,945,645	3,001,645,509
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,526,518	-
未払解約金	8,568,475	-
未払受託者報酬	32,553	29,854
未払委託者報酬	108,523	99,522
未払利息	18	11
その他未払費用	15,649	24,432
流動負債合計	24,251,736	153,819

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
負債合計	24,251,736	153,819
純資産の部		
元本等		
元本	3,066,638,104	2,350,360,311
剰余金		
剰余金又は欠損金()	867,055,805	651,131,379
(分配準備積立金)	816,488,502	541,094,924
元本等合計	3,933,693,909	3,001,491,690
純資産合計	3,933,693,909	3,001,491,690
負債純資産合計	3,957,945,645	3,001,645,509

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1. 期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
期首元本額	3,344,017,513円	3,066,638,104円
期首からの追加設定元本額	1,223,569,464円	381,138,153円
期首からの一部解約元本額	1,500,948,873円	1,097,415,946円
2. 受益権の総数	3,066,638,104口	2,350,360,311口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	19,900,192
合計	19,900,192

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,674,415
合計	6,674,415

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	3,957,276,622	-	3,972,803,140	15,526,518
	米ドル	3,957,276,622	-	3,972,803,140	15,526,518
	合計	3,957,276,622	-	3,972,803,140	15,526,518

(2021年 7月19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	3,007,215,377	-	2,997,508,805	9,706,572
	米ドル	3,007,215,377	-	2,997,508,805	9,706,572
	合計	3,007,215,377	-	2,997,508,805	9,706,572

(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)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2827円	1口当たり純資産額	1.2770円
(1万口当たり純資産額)	(12,827円)	(1万口当たり純資産額)	(12,770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
親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,361,885,858	2,976,684,746	
	合計	2,361,885,858	2,976,684,746	

(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

「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。

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」は、「ゴールド・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。

ゴールド・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	54,420,706	82,869,173
コール・ローン	182,047,873	48,649,116
投資信託受益証券	138,128,807,280	149,260,981,781
派生商品評価勘定	-	2,624
流動資産合計	138,365,275,859	149,392,502,694
資産合計	138,365,275,859	149,392,502,694
負債の部		
流動負債		
未払金	53,010,374	112,446,797
未払解約金	132,670,215	-
未払利息	167	37
流動負債合計	185,680,756	112,446,834
負債合計	185,680,756	112,446,834
純資産の部		
元本等		
元本	112,869,912,034	118,451,694,130
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	25,309,683,069	30,828,361,730
元本等合計	138,179,595,103	149,280,055,860
純資産合計	138,179,595,103	149,280,055,860
負債純資産合計	138,365,275,859	149,392,502,694

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	<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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	118,814,505,273円	112,869,912,034円
	期首からの追加設定元本額	57,260,089,217円	47,596,834,553円
	期首からの一部解約元本額	63,204,682,456円	42,015,052,457円
	元本の内訳		
	ファイン・ブレンド(毎月分配型)	5,896,085,293円	5,897,221,753円
	ファイン・ブレンド(資産成長型)	3,133,815,833円	3,231,580,941円
	スマート・ファイブ(毎月決算型)	46,634,949,674円	46,309,781,339円
	スマート・ファイブ(1年決算型)	7,166,778,928円	7,561,340,256円
	ゴールド・ファンド(適格機関投資家向け)	6,259,601,227円	5,578,559,355円
	ゴールド・ファンド(為替ヘッジあり)	5,277,100,669円	7,627,138,530円
	ゴールド・ファンド(為替ヘッジなし)	3,583,302,183円	6,272,265,786円
	ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	31,649,075,620円	33,556,626,167円
	F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	3,209,708,355円	2,361,885,858円
	ファイン・ブレンド(適格機関投資家向け)	59,494,252円	55,294,145円
	計	112,869,912,034円	118,451,694,130円
2.	受益権の総数	112,869,912,034口	118,451,694,130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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19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 「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 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年 7月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	9,419,807,940
合計	9,419,807,940

（2021年 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	8,928,539,158
合計	8,928,539,158

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2020年 7月17日現在）

該当事項はありません。

（2021年 7月19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	35,158,656	-	35,161,280	2,624
	米ドル	35,158,656	-	35,161,280	2,624
	合計	35,158,656	-	35,161,280	2,624

（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)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2242円	1口当たり純資産額	1.2603円
(1万口当たり純資産額)	(12,242円)	(1万口当たり純資産額)	(12,603円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資信託受益証券	i シェアーズ ゴールド・トラスト	27,875,000	961,130,000.00	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	17,800,000	320,578,000.00	
		SPDR GOLD TRUST-ETF	452,700	76,691,907.00	
米ドル小計			46,127,700	1,358,399,907.00 (149,260,981,781)	
		合計		149,260,981,781 (149,260,981,781)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	100.0%	100.0%

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。

インデックス マザーファンド TOPIX

貸借対照表

（単位：円）		
	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	71,041,494	104,999,800
株式	37,314,733,910	42,776,833,300
未収配当金	57,532,196	54,012,320
前払金	1,260,000	1,500,000
流動資産合計	37,444,567,600	42,937,345,420
資産合計	37,444,567,600	42,937,345,420
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,473,300	2,552,750
未払解約金	35,427,998	66,041,722
未払利息	65	80
流動負債合計	36,901,363	68,594,552
負債合計	36,901,363	68,594,552
純資産の部		
元本等		
元本	18,584,035,558	17,201,994,044
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,823,630,679	25,666,756,824
元本等合計	37,407,666,237	42,868,750,868
純資産合計	37,407,666,237	42,868,750,868
負債純資産合計	37,444,567,600	42,937,345,420

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</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	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	19,773,090,141円	18,584,035,558円
	期首からの追加設定元本額	2,104,168,125円	1,719,098,543円
	期首からの一部解約元本額	3,293,222,708円	3,101,140,057円
	元本の内訳		
	インデックスファンドTSP	9,928,326,264円	8,811,054,909円
	財形株投(一般財形30)	16,026,578円	13,582,616円
	財形株投(一般財形50)	50,686,422円	39,976,109円
	財形株投(年金・住宅財形30)	30,361,533円	27,012,260円
	インデックスファンドTOPIX(日本株式)	7,981,577,436円	7,780,221,313円
	TOPIXインデックスファンド(個人型年金向け)	473,026,465円	475,727,825円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	29,794,816円	24,324,040円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	15,164,720円	-円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	11,295,753円	8,465,321円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	22,561,752円	-円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	9,798,599円	8,412,946円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	15,415,220円	13,216,705円
	計	18,584,035,558円	17,201,994,044円
2.	受益権の総数	18,584,035,558口	17,201,994,044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	239,265,000円	330,266,000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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,260,174,348
合計	3,260,174,348

(2021年 7月19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	601,423,933
合計	601,423,933

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	95,880,000	-	94,410,000	1,470,000
合計		95,880,000	-	94,410,000	1,470,000

(2021年 7月19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	97,825,000	-	95,275,000	2,550,000
合計		97,825,000	-	95,275,000	2,550,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	2,0129円	1口当たり純資産額	2,4921円
(1万口当たり純資産額)	(20,129円)	(1万口当たり純資産額)	(24,921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	2,917.00	2,041,900	
日本水産	20,600	549.00	11,309,400	
マルハニチロ	3,500	2,390.00	8,365,000	
雪国まいたけ	1,900	1,664.00	3,161,600	
カネコ種苗	700	1,420.00	994,000	
サカタのタネ	2,600	3,690.00	9,594,000	
ホクト	1,900	1,931.00	3,668,900	
ホクリヨウ	400	825.00	330,000	
住石ホールディングス	4,600	127.00	584,200	
日鉄鉱業	500	5,790.00	2,895,000	
三井松島ホールディングス	1,000	1,011.00	1,011,000	
I N P E X	81,600	793.00	64,708,800	
石油資源開発	2,900	1,867.00	5,414,300	
K & O エナジーグループ	1,000	1,300.00	1,300,000	
ヒノキヤグループ	600	2,364.00	1,418,400	
ショーボンドホールディングス	3,200	4,740.00	15,168,000	

ミライト・ホールディングス	7,700	2,053.00	15,808,100
タマホーム	1,400	3,215.00	4,501,000
サンヨーホームズ	300	721.00	216,300
日本アクア	1,000	544.00	544,000
ファーストコーポレーション	800	778.00	622,400
ベストテラ	500	1,410.00	705,000
キャンディル	500	574.00	287,000
スペースバリューホールディングス	2,800	744.00	2,083,200
ダイセキ環境ソリューション	500	1,283.00	641,500
第一カッター興業	600	1,329.00	797,400
安藤・間	14,300	858.00	12,269,400
東急建設	6,700	798.00	5,346,600
コムシスホールディングス	7,900	3,025.00	23,897,500
ビーアールホールディングス	3,100	464.00	1,438,400
高松コンストラクショングループ	1,400	2,010.00	2,814,000
東建コーポレーション	700	10,020.00	7,014,000
ソネック	300	1,022.00	306,600
ヤマウラ	1,000	898.00	898,000
大成建設	15,900	3,850.00	61,215,000
大林組	51,200	923.00	47,257,600
清水建設	48,100	895.00	43,049,500
飛鳥建設	1,500	1,091.00	1,636,500
長谷工コーポレーション	16,800	1,485.00	24,948,000
松井建設	2,100	752.00	1,579,200
銭高組	200	4,080.00	816,000
鹿島建設	37,500	1,447.00	54,262,500
不動テトラ	1,300	1,817.00	2,362,100
大末建設	600	984.00	590,400
鉄建建設	1,100	1,929.00	2,121,900
西松建設	3,700	3,485.00	12,894,500
三井住友建設	12,500	486.00	6,075,000
大豊建設	1,100	4,275.00	4,702,500
前田建設工業	12,900	931.00	12,009,900
ナカノフドー建設	1,400	420.00	588,000
奥村組	2,800	2,944.00	8,243,200
東鉄工業	2,200	2,336.00	5,139,200
イチケン	400	1,875.00	750,000
富士ピー・エス	700	553.00	387,100
浅沼組	600	4,740.00	2,844,000
戸田建設	21,200	770.00	16,324,000
熊谷組	2,400	2,875.00	6,900,000
北野建設	300	2,302.00	690,600

植木組	400	1,411.00	564,400
矢作建設工業	2,200	724.00	1,592,800
ピーエス三菱	1,800	611.00	1,099,800
日本ハウスホールディングス	3,700	400.00	1,480,000
大東建託	5,600	13,400.00	75,040,000
新日本建設	2,200	836.00	1,839,200
N I P P O	4,200	3,065.00	12,873,000
東亜道路工業	300	4,635.00	1,390,500
前田道路	3,200	2,116.00	6,771,200
日本道路	500	8,140.00	4,070,000
東亜建設工業	1,400	2,468.00	3,455,200
日本国土開発	5,000	572.00	2,860,000
若築建設	900	1,677.00	1,509,300
東洋建設	5,800	572.00	3,317,600
五洋建設	21,900	755.00	16,534,500
世紀東急工業	2,500	884.00	2,210,000
福田組	600	4,890.00	2,934,000
住友林業	13,100	2,025.00	26,527,500
日本基礎技術	1,600	576.00	921,600
巴コーポレーション	2,300	373.00	857,900
大和ハウス工業	47,300	3,367.00	159,259,100
ライト工業	2,900	1,879.00	5,449,100
積水ハウス	55,500	2,250.50	124,902,750
日特建設	1,300	756.00	982,800
北陸電気工事	900	1,282.00	1,153,800
ユアテック	2,900	728.00	2,111,200
日本リーテック	1,100	1,701.00	1,871,100
四電工	300	2,950.00	885,000
中電工	2,300	2,282.00	5,248,600
関電工	8,300	902.00	7,486,600
きんでん	10,400	1,810.00	18,824,000
東京エネシス	1,700	980.00	1,666,000
トーエネック	500	3,685.00	1,842,500
住友電設	1,500	2,203.00	3,304,500
日本電設工業	2,800	1,884.00	5,275,200
協和エクシオ	7,700	2,708.00	20,851,600
新日本空調	1,400	2,119.00	2,966,600
九電工	3,600	3,655.00	13,158,000
三機工業	3,600	1,484.00	5,342,400
日揮ホールディングス	17,200	1,012.00	17,406,400
中外炉工業	600	1,924.00	1,154,400
ヤマト	1,700	807.00	1,371,900

太平電業	1,100	2,659.00	2,924,900
高砂熱学工業	4,600	1,943.00	8,937,800
三晃金属工業	200	2,410.00	482,000
朝日工業社	400	3,215.00	1,286,000
明星工業	3,300	743.00	2,451,900
大気社	2,500	3,380.00	8,450,000
ダイダン	1,100	2,611.00	2,872,100
日比谷総合設備	1,700	1,854.00	3,151,800
フィル・カンパニー	300	2,635.00	790,500
テスホールディングス	1,000	2,220.00	2,220,000
東洋エンジニアリング	2,300	780.00	1,794,000
レイズネクスト	2,700	1,155.00	3,118,500
ニッポン	4,700	1,575.00	7,402,500
日清製粉グループ本社	18,500	1,676.00	31,006,000
日東富士製粉	100	6,830.00	683,000
昭和産業	1,400	3,015.00	4,221,000
鳥越製粉	1,400	782.00	1,094,800
中部飼料	2,000	1,131.00	2,262,000
フィード・ワン	2,200	750.00	1,650,000
東洋精糖	200	1,181.00	236,200
日本甜菜製糖	800	1,628.00	1,302,400
D M三井製糖ホールディングス	1,300	1,876.00	2,438,800
塩水港精糖	2,200	220.00	484,000
日新製糖	700	1,686.00	1,180,200
森永製菓	3,900	3,580.00	13,962,000
中村屋	400	3,740.00	1,496,000
江崎グリコ	4,500	4,180.00	18,810,000
名糖産業	700	1,589.00	1,112,300
井村屋グループ	1,000	2,274.00	2,274,000
不二家	1,000	2,145.00	2,145,000
山崎製パン	12,300	1,538.00	18,917,400
第一屋製パン	400	931.00	372,400
モロゾフ	300	5,260.00	1,578,000
亀田製菓	900	4,590.00	4,131,000
寿スピリッツ	1,600	6,700.00	10,720,000
カルビー	7,500	2,560.00	19,200,000
森永乳業	3,100	6,050.00	18,755,000
六甲バター	1,100	1,516.00	1,667,600
ヤクルト本社	11,300	6,330.00	71,529,000
明治ホールディングス	10,800	6,820.00	73,656,000
雪印メグミルク	3,900	2,065.00	8,053,500
プリマハム	2,300	3,020.00	6,946,000

日本ハム	6,300	4,375.00	27,562,500
林兼産業	600	581.00	348,600
丸大食品	1,600	1,724.00	2,758,400
S Foods	1,500	3,415.00	5,122,500
柿安本店	600	2,501.00	1,500,600
伊藤ハム米久ホールディングス	10,300	719.00	7,405,700
サッポロホールディングス	5,600	2,297.00	12,863,200
アサヒグループホールディングス	35,800	4,940.00	176,852,000
キリンホールディングス	69,500	2,052.50	142,648,750
宝ホールディングス	12,200	1,332.00	16,250,400
オエノンホールディングス	4,800	368.00	1,766,400
養命酒製造	500	1,802.00	901,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,600	1,804.00	22,730,400
サントリー食品インターナショナル	11,000	3,970.00	43,670,000
ダイトーグループホールディングス	900	4,945.00	4,450,500
伊藤園	5,000	6,320.00	31,600,000
キーコーヒー	1,700	2,083.00	3,541,100
ユニカフェ	600	991.00	594,600
ジャパンフーズ	300	1,210.00	363,000
日清オイリオグループ	2,000	3,105.00	6,210,000
不二製油グループ本社	4,000	2,540.00	10,160,000
かどや製油	200	4,000.00	800,000
J - オイルミルズ	1,500	1,871.00	2,806,500
キッコーマン	11,800	6,980.00	82,364,000
味の素	39,000	2,830.00	110,370,000
ブルドックソース	800	2,354.00	1,883,200
キューピー	9,100	2,442.00	22,222,200
ハウス食品グループ本社	6,100	3,395.00	20,709,500
カゴメ	6,700	2,819.00	18,887,300
焼津水産化学工業	800	954.00	763,200
アリアケジャパン	1,500	6,630.00	9,945,000
ピエトロ	300	1,714.00	514,200
エバラ食品工業	400	2,628.00	1,051,200
やまみ	200	1,893.00	378,600
ニチレイ	7,800	2,950.00	23,010,000
東洋水産	8,500	4,240.00	36,040,000
イトアンドホールディングス	700	1,970.00	1,379,000
大冷	200	1,995.00	399,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	775.00	775,000
日清食品ホールディングス	6,400	7,940.00	50,816,000
永谷園ホールディングス	800	2,136.00	1,708,800
一正蒲鉾	700	920.00	644,000

フジッコ	1,700	1,919.00	3,262,300
ロック・フィールド	1,800	1,479.00	2,662,200
日本たばこ産業	87,900	2,147.00	188,721,300
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,495.00	1,495,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,365.00	2,601,500
なとり	1,000	1,927.00	1,927,000
イフジ産業	300	949.00	284,700
ピクルスコーポレーション	400	3,390.00	1,356,000
ファーマフーズ	1,500	3,375.00	5,062,500
北の達人コーポレーション	5,800	529.00	3,068,200
ユーグレナ	8,400	976.00	8,198,400
紀文食品	1,000	1,348.00	1,348,000
ミヨシ油脂	500	1,254.00	627,000
理研ビタミン	1,600	1,590.00	2,544,000
片倉工業	2,200	1,461.00	3,214,200
ゲンゼ	1,200	4,570.00	5,484,000
東洋紡	6,300	1,321.00	8,322,300
ユニチカ	4,900	338.00	1,656,200
富士紡ホールディングス	800	3,790.00	3,032,000
倉敷紡績	1,400	1,935.00	2,709,000
シキボウ	1,000	922.00	922,000
日本毛織	5,200	962.00	5,002,400
ダイトウボウ	3,800	100.00	380,000
トーア紡コーポレーション	700	435.00	304,500
ダイドーリミテッド	2,800	175.00	490,000
帝国繊維	1,800	1,980.00	3,564,000
帝人	15,000	1,672.00	25,080,000
東レ	115,900	686.50	79,565,350
サカイオーベックス	400	3,040.00	1,216,000
住江織物	400	1,950.00	780,000
日本フェルト	900	443.00	398,700
日東製網	200	1,520.00	304,000
アツギ	1,300	622.00	808,600
ダイニック	600	762.00	457,200
セーレン	3,900	2,138.00	8,338,200
ソトー	700	803.00	562,100
東海染工	200	1,130.00	226,000
小松マテーレ	2,600	926.00	2,407,600
ワコールホールディングス	4,000	2,447.00	9,788,000
ホギメディカル	2,200	3,475.00	7,645,000
クラウディアホールディングス	600	295.00	177,000
T S Iホールディングス	5,000	345.00	1,725,000

マツオカコーポレーション	500	1,582.00	791,000
ワールド	2,100	1,365.00	2,866,500
三陽商会	1,000	941.00	941,000
ナイガイ	800	334.00	267,200
オンワードホールディングス	9,900	320.00	3,168,000
ルックホールディングス	500	1,424.00	712,000
ゴールドウイン	2,600	6,420.00	16,692,000
デサント	2,700	2,861.00	7,724,700
キング	800	461.00	368,800
ヤマトインターナショナル	1,400	337.00	471,800
特種東海製紙	1,000	4,380.00	4,380,000
王子ホールディングス	72,100	633.00	45,639,300
日本製紙	7,100	1,252.00	8,889,200
三菱製紙	2,700	352.00	950,400
北越コーポレーション	11,400	609.00	6,942,600
中越パルプ工業	700	1,269.00	888,300
巴川製紙所	600	802.00	481,200
大王製紙	7,700	1,798.00	13,844,600
阿波製紙	600	401.00	240,600
レンゴー	16,500	921.00	15,196,500
トーモク	1,000	1,933.00	1,933,000
ザ・パック	1,200	2,749.00	3,298,800
クラレ	25,200	1,015.00	25,578,000
旭化成	106,000	1,177.00	124,762,000
共和レザー	900	705.00	634,500
昭和電工	12,200	3,100.00	37,820,000
住友化学	126,000	567.00	71,442,000
住友精化	800	3,705.00	2,964,000
日産化学	8,800	5,290.00	46,552,000
ラサ工業	600	1,796.00	1,077,600
クレハ	1,400	6,650.00	9,310,000
多木化学	600	5,480.00	3,288,000
テイカ	1,200	1,282.00	1,538,400
石原産業	2,900	1,114.00	3,230,600
片倉コープアグリ	300	1,220.00	366,000
日本曹達	2,200	3,280.00	7,216,000
東ソー	24,700	1,877.00	46,361,900
トクヤマ	4,800	2,235.00	10,728,000
セントラル硝子	3,000	2,156.00	6,468,000
東亜合成	9,700	1,124.00	10,902,800
大阪ソーダ	1,600	2,440.00	3,904,000
関東電化工業	3,800	1,010.00	3,838,000

デンカ	5,800	3,705.00	21,489,000
信越化学工業	29,600	17,530.00	518,888,000
日本カーバイド工業	600	1,274.00	764,400
堺化学工業	1,100	1,893.00	2,082,300
第一稀元素化学工業	1,700	1,840.00	3,128,000
エア・ウォーター	16,300	1,643.00	26,780,900
日本酸素ホールディングス	13,200	2,378.00	31,389,600
日本化学工業	500	3,065.00	1,532,500
東邦アセチレン	300	1,175.00	352,500
日本パーカラライジング	8,100	1,102.00	8,926,200
高压ガス工業	2,500	650.00	1,625,000
四国化成工業	2,100	1,320.00	2,772,000
戸田工業	400	2,637.00	1,054,800
ステラ ケミファ	900	2,803.00	2,522,700
保土谷化学工業	500	3,865.00	1,932,500
日本触媒	2,900	5,230.00	15,167,000
大日精化工業	1,300	2,232.00	2,901,600
カネカ	4,100	4,360.00	17,876,000
三菱瓦斯化学	16,000	2,306.00	36,896,000
三井化学	13,800	3,540.00	48,852,000
J S R	16,100	3,450.00	55,545,000
東京応化工業	2,700	6,920.00	18,684,000
大阪有機化学工業	1,500	3,630.00	5,445,000
三菱ケミカルホールディングス	107,100	926.90	99,270,990
K Hネオケム	2,600	2,553.00	6,637,800
ダイセル	21,600	894.00	19,310,400
住友ベークライト	2,500	4,640.00	11,600,000
積水化学工業	33,400	1,875.00	62,625,000
日本ゼオン	14,400	1,418.00	20,419,200
アイカ工業	4,400	3,900.00	17,160,000
宇部興産	8,100	2,183.00	17,682,300
積水樹脂	2,400	2,113.00	5,071,200
タキロンシーアイ	3,500	589.00	2,061,500
旭有機材	900	1,335.00	1,201,500
ニチバン	900	1,730.00	1,557,000
リケンテクノス	3,900	592.00	2,308,800
大倉工業	800	2,454.00	1,963,200
積水化成成品工業	2,100	601.00	1,262,100
群栄化学工業	400	2,421.00	968,400
タイガースポリマー	900	453.00	407,700
ミライアル	500	1,228.00	614,000
ダイキアクシス	700	827.00	578,900

ダイキョーニシカワ	3,400	702.00	2,386,800
竹本容器	700	1,024.00	716,800
森六ホールディングス	900	2,184.00	1,965,600
恵和	300	3,460.00	1,038,000
日本化薬	9,800	1,090.00	10,682,000
カーリットホールディングス	1,700	731.00	1,242,700
日本精化	1,200	1,627.00	1,952,400
扶桑化学工業	1,300	3,840.00	4,992,000
トリケミカル研究所	1,500	2,956.00	4,434,000
A D E K A	7,300	2,144.00	15,651,200
日油	6,000	5,600.00	33,600,000
新日本理化	2,900	267.00	774,300
ハリマ化成グループ	1,200	885.00	1,062,000
花王	39,100	6,745.00	263,729,500
第一工業製薬	600	3,210.00	1,926,000
石原ケミカル	400	2,108.00	843,200
日華化学	600	1,374.00	824,400
ニイタカ	400	2,015.00	806,000
三洋化成工業	900	5,640.00	5,076,000
有機合成薬品工業	1,400	361.00	505,400
大日本塗料	1,800	836.00	1,504,800
日本ペイントホールディングス	66,000	1,373.00	90,618,000
関西ペイント	18,000	2,730.00	49,140,000
神東塗料	1,400	196.00	274,400
中国塗料	3,900	857.00	3,342,300
日本特殊塗料	1,200	1,085.00	1,302,000
藤倉化成	2,200	499.00	1,097,800
太陽ホールディングス	1,200	5,000.00	6,000,000
D I C	6,800	2,763.00	18,788,400
サカタインクス	3,500	1,027.00	3,594,500
東洋インキ S C ホールディングス	3,300	1,977.00	6,524,100
T & K T O K A	1,100	805.00	885,500
富士フイルムホールディングス	28,700	7,866.00	225,754,200
資生堂	32,500	7,650.00	248,625,000
ライオン	21,300	1,941.00	41,343,300
高砂香料工業	1,000	2,672.00	2,672,000
マンダム	3,400	1,875.00	6,375,000
ミルボン	2,200	6,110.00	13,442,000
ファンケル	5,900	3,485.00	20,561,500
コーセー	3,100	17,440.00	54,064,000
コタ	1,000	1,404.00	1,404,000
シーボン	300	1,940.00	582,000

ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	2,823.00	19,761,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,430.00	7,602,000
アジュバンコスメジャパン	400	1,053.00	421,200
新日本製薬	400	2,041.00	816,400
エステー	1,000	1,712.00	1,712,000
アグロ カネショウ	600	1,354.00	812,400
コニシ	2,700	1,601.00	4,322,700
長谷川香料	2,800	2,465.00	6,902,000
星光P M C	1,000	942.00	942,000
小林製薬	4,600	9,150.00	42,090,000
荒川化学工業	1,400	1,193.00	1,670,200
メック	1,100	3,325.00	3,657,500
日本高純度化学	500	2,873.00	1,436,500
タカラバイオ	4,300	2,805.00	12,061,500
J C U	1,800	3,700.00	6,660,000
新田ゼラチン	1,100	625.00	687,500
O A T アグリオ	300	1,400.00	420,000
デクセリアルズ	4,600	2,344.00	10,782,400
アース製薬	1,200	6,590.00	7,908,000
北興化学工業	1,600	1,042.00	1,667,200
大成ラミック	600	2,739.00	1,643,400
クミアイ化学工業	6,800	849.00	5,773,200
日本農薬	2,900	506.00	1,467,400
アキレス	1,200	1,358.00	1,629,600
有沢製作所	2,300	873.00	2,007,900
日東電工	9,900	8,140.00	80,586,000
レック	1,900	1,111.00	2,110,900
三光合成	1,900	531.00	1,008,900
きもと	2,900	284.00	823,600
藤森工業	1,500	4,115.00	6,172,500
前澤化成工業	1,100	1,224.00	1,346,400
未来工業	600	1,661.00	996,600
ウェーブロックホールディングス	600	692.00	415,200
J S P	1,100	1,617.00	1,778,700
エフピコ	3,000	4,045.00	12,135,000
天馬	1,200	2,608.00	3,129,600
信越ポリマー	2,600	1,020.00	2,652,000
東リ	4,300	238.00	1,023,400
ニフコ	6,000	3,665.00	21,990,000
バルカー	1,300	2,190.00	2,847,000
ユニ・チャーム	34,600	4,376.00	151,409,600
ショーエイコーポレーション	400	972.00	388,800

協和キリン	16,400	3,785.00	62,074,000
武田薬品工業	135,900	3,739.00	508,130,100
アステラス製薬	141,600	1,910.00	270,456,000
大日本住友製薬	12,100	2,226.00	26,934,600
塩野義製薬	20,500	5,694.00	116,727,000
わかもと製薬	2,100	307.00	644,700
日本新薬	4,600	8,540.00	39,284,000
ピオフェルミン製薬	300	3,105.00	931,500
中外製薬	51,100	4,149.00	212,013,900
科研製薬	2,800	4,825.00	13,510,000
エーザイ	18,100	9,268.00	167,750,800
ロート製薬	7,800	2,968.00	23,150,400
小野薬品工業	37,500	2,501.50	93,806,250
久光製薬	4,800	5,140.00	24,672,000
持田製薬	2,200	3,635.00	7,997,000
参天製薬	28,500	1,511.00	43,063,500
扶桑薬品工業	500	2,323.00	1,161,500
日本ケミファ	200	2,245.00	449,000
ツムラ	5,500	3,405.00	18,727,500
日医工	4,700	846.00	3,976,200
キッセイ薬品工業	2,900	2,231.00	6,469,900
生化学工業	2,900	1,075.00	3,117,500
栄研化学	2,900	2,124.00	6,159,600
日水製薬	600	979.00	587,400
鳥居薬品	1,000	2,507.00	2,507,000
JCRファーマ	4,600	3,310.00	15,226,000
東和薬品	2,300	2,656.00	6,108,800
富士製薬工業	1,000	1,130.00	1,130,000
ゼリア新薬工業	3,000	2,063.00	6,189,000
第一三共	128,400	2,227.00	285,946,800
キョーリン製薬ホールディングス	3,600	1,797.00	6,469,200
大幸薬品	2,100	994.00	2,087,400
ダイト	1,100	3,190.00	3,509,000
大塚ホールディングス	33,900	4,475.00	151,702,500
大正製薬ホールディングス	3,900	6,190.00	24,141,000
ペプチドリーム	8,600	4,720.00	40,592,000
あすか製薬ホールディングス	1,900	958.00	1,820,200
サワイグループホールディングス	3,600	4,695.00	16,902,000
日本コークス工業	14,000	101.00	1,414,000
ニチレキ	2,000	1,361.00	2,722,000
ユシロ化学工業	900	1,154.00	1,038,600
ビーピー・カストロール	600	1,328.00	796,800

富士石油	4,400	253.00	1,113,200
MORESCO	600	1,137.00	682,200
出光興産	18,100	2,616.00	47,349,600
ENEOSホールディングス	245,600	461.40	113,319,840
コスモエネルギーホールディングス	5,100	2,501.00	12,755,100
横浜ゴム	9,500	2,163.00	20,548,500
TOYO TIRE	8,600	2,038.00	17,526,800
ブリヂストン	43,400	4,681.00	203,155,400
住友ゴム工業	14,700	1,455.00	21,388,500
藤倉コンポジット	1,500	478.00	717,000
オカモト	1,000	4,065.00	4,065,000
フコク	800	946.00	756,800
ニッタ	1,700	2,570.00	4,369,000
住友理工	3,200	734.00	2,348,800
三ツ星ベルト	2,000	1,792.00	3,584,000
バンドー化学	2,800	912.00	2,553,600
日東紡績	2,400	3,300.00	7,920,000
AGC	15,000	4,580.00	68,700,000
日本板硝子	8,400	616.00	5,174,400
石塚硝子	300	1,883.00	564,900
日本山村硝子	700	920.00	644,000
日本電気硝子	6,000	2,488.00	14,928,000
オハラ	700	1,379.00	965,300
住友大阪セメント	3,000	3,030.00	9,090,000
太平洋セメント	9,300	2,496.00	23,212,800
日本ヒューム	1,500	718.00	1,077,000
日本コンクリート工業	3,700	312.00	1,154,400
三谷セキサン	800	4,115.00	3,292,000
アジアパイルホールディングス	2,500	453.00	1,132,500
東海カーボン	16,000	1,405.00	22,480,000
日本カーボン	900	4,015.00	3,613,500
東洋炭素	1,000	2,854.00	2,854,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,160.00	3,744,000
TOTO	11,700	5,630.00	65,871,000
日本碍子	18,000	1,803.00	32,454,000
日本特殊陶業	12,400	1,603.00	19,877,200
ダントーホールディングス	1,300	252.00	327,600
MARUWA	600	10,600.00	6,360,000
品川リフラクトリーズ	400	3,955.00	1,582,000
黒崎播磨	300	4,725.00	1,417,500
ヨータイ	1,200	1,261.00	1,513,200
イソライト工業	800	671.00	536,800

東京窯業	2,000	312.00	624,000
ニッカトー	800	661.00	528,800
フジインコーポレーテッド	1,300	4,685.00	6,090,500
クニミネ工業	500	1,155.00	577,500
エーアンドエーマテリアル	300	1,022.00	306,600
ニチアス	4,100	2,782.00	11,406,200
ニチハ	2,300	2,847.00	6,548,100
日本製鉄	77,200	1,785.50	137,840,600
神戸製鋼所	29,600	697.00	20,631,200
合同製鐵	900	1,597.00	1,437,300
ジェイ エフ イー ホールディングス	46,800	1,272.00	59,529,600
東京製鐵	6,300	1,031.00	6,495,300
共英製鋼	1,800	1,365.00	2,457,000
大和工業	3,400	3,500.00	11,900,000
東京鐵鋼	600	1,565.00	939,000
大阪製鐵	900	1,108.00	997,200
淀川製鋼所	2,100	2,306.00	4,842,600
丸一鋼管	5,200	2,616.00	13,603,200
モリ工業	500	2,290.00	1,145,000
大同特殊鋼	2,600	5,240.00	13,624,000
日本高周波鋼業	800	381.00	304,800
日本冶金工業	1,300	2,239.00	2,910,700
山陽特殊製鋼	2,000	1,652.00	3,304,000
愛知製鋼	900	3,005.00	2,704,500
日立金属	15,300	2,132.00	32,619,600
日本金属	400	955.00	382,000
大平洋金属	1,100	1,638.00	1,801,800
新日本電工	10,600	288.00	3,052,800
栗本鐵工所	700	1,660.00	1,162,000
虹技	200	1,123.00	224,600
日本鑄鉄管	200	1,240.00	248,000
三菱製鋼	1,300	1,064.00	1,383,200
日亜鋼業	2,300	295.00	678,500
日本精線	300	4,490.00	1,347,000
エンビプロ・ホールディングス	800	1,247.00	997,600
シンニッタン	2,100	252.00	529,200
新家工業	400	1,501.00	600,400
大紀アルミニウム工業所	2,500	1,159.00	2,897,500
日本輕金属ホールディングス	4,400	1,856.00	8,166,400
三井金属鉱業	4,400	3,045.00	13,398,000
東邦亜鉛	900	1,856.00	1,670,400
三菱マテリアル	10,700	2,235.00	23,914,500

住友金属鉱山	20,700	4,254.00	88,057,800
DOWAホールディングス	4,100	4,195.00	17,199,500
古河機械金属	2,700	1,243.00	3,356,100
エス・サイエンス	11,300	37.00	418,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,900	741.00	1,407,900
東邦チタニウム	3,000	1,007.00	3,021,000
UACJ	2,500	2,798.00	6,995,000
CKサンエツ	300	2,966.00	889,800
古河電気工業	5,000	2,744.00	13,720,000
住友電気工業	56,300	1,535.50	86,448,650
フジクラ	19,700	540.00	10,638,000
昭和電線ホールディングス	1,600	1,776.00	2,841,600
タツタ電線	2,900	566.00	1,641,400
カナレ電気	300	1,680.00	504,000
平河ヒューテック	900	1,158.00	1,042,200
リョービ	2,000	1,362.00	2,724,000
アーレスティ	2,200	472.00	1,038,400
アサヒホールディングス	6,000	2,225.00	13,350,000
稲葉製作所	1,100	1,495.00	1,644,500
宮地エンジニアリンググループ	500	2,500.00	1,250,000
トーカロ	4,100	1,364.00	5,592,400
アルファC o	600	1,124.00	674,400
SUMCO	20,600	2,645.00	54,487,000
川田テクノロジーズ	300	3,775.00	1,132,500
RS Technologies	500	5,840.00	2,920,000
ジェイテックコーポレーション	200	3,220.00	644,000
信和	1,000	701.00	701,000
東洋製罐グループホールディングス	10,200	1,413.00	14,412,600
ホッカンホールディングス	800	1,402.00	1,121,600
コロナ	1,000	916.00	916,000
横河ブリッジホールディングス	2,800	2,010.00	5,628,000
駒井ハルテック	400	1,685.00	674,000
高田機工	100	2,749.00	274,900
三和ホールディングス	15,300	1,318.00	20,165,400
文化シャッター	4,800	1,126.00	5,404,800
三協立山	2,200	825.00	1,815,000
アルインコ	1,100	1,038.00	1,141,800
東洋シャッター	500	653.00	326,500
LIXIL	22,300	2,948.00	65,740,400
日本フィルコン	1,100	504.00	554,400
ノーリツ	3,400	1,826.00	6,208,400
長府製作所	1,700	2,029.00	3,449,300

リンナイ	3,200	10,320.00	33,024,000
ダイニチ工業	900	762.00	685,800
日東精工	2,100	588.00	1,234,800
三洋工業	200	1,868.00	373,600
岡部	3,400	655.00	2,227,000
ジーテクト	2,000	1,508.00	3,016,000
東プレ	3,000	1,540.00	4,620,000
高周波熱錬	3,200	569.00	1,820,800
東京製綱	1,200	1,107.00	1,328,400
サンコール	1,400	445.00	623,000
モリテック スチール	1,400	457.00	639,800
パイオラックス	2,400	1,507.00	3,616,800
エイチワン	1,600	731.00	1,169,600
日本発條	16,200	832.00	13,478,400
中央発條	800	1,360.00	1,088,000
アドバネクス	300	1,272.00	381,600
立川ブラインド工業	700	1,283.00	898,100
三益半導体工業	1,300	2,428.00	3,156,400
日本ドライケミカル	400	1,820.00	728,000
日本製鋼所	4,900	2,704.00	13,249,600
三浦工業	7,000	4,840.00	33,880,000
タクマ	5,500	1,674.00	9,207,000
ツガミ	3,300	1,687.00	5,567,100
オークマ	1,900	5,320.00	10,108,000
芝浦機械	1,700	2,504.00	4,256,800
アマダ	23,700	1,130.00	26,781,000
アイダエンジニアリング	4,200	957.00	4,019,400
滝澤鉄工所	500	1,138.00	569,000
F U J I	6,400	2,503.00	16,019,200
牧野フライス製作所	1,900	4,110.00	7,809,000
オーエスジー	8,000	2,056.00	16,448,000
ダイジェット工業	200	1,307.00	261,400
旭ダイヤモンド工業	4,400	518.00	2,279,200
D M G 森精機	10,300	1,746.00	17,983,800
ソディック	3,900	1,015.00	3,958,500
ディスコ	2,200	31,100.00	68,420,000
日東工器	800	1,847.00	1,477,600
日進工具	1,300	1,437.00	1,868,100
パンチ工業	1,400	614.00	859,600
富士ダイス	800	685.00	548,000
豊和工業	900	809.00	728,100
O K K	900	405.00	364,500

東洋機械金属	1,300	499.00	648,700
津田駒工業	400	865.00	346,000
島精機製作所	2,400	1,846.00	4,430,400
オプトラン	2,000	2,355.00	4,710,000
N Cホールディングス	500	1,217.00	608,500
イワキポンプ	1,000	898.00	898,000
フリュー	1,600	1,403.00	2,244,800
ヤマシンフィルタ	3,300	709.00	2,339,700
日阪製作所	1,900	818.00	1,554,200
やまびこ	3,100	1,218.00	3,775,800
平田機工	800	6,230.00	4,984,000
ペガサスミシン製造	1,800	461.00	829,800
マルマエ	700	2,103.00	1,472,100
タツモ	700	1,710.00	1,197,000
ナプテスコ	9,500	4,205.00	39,947,500
三井海洋開発	1,700	1,908.00	3,243,600
レオン自動機	1,600	1,404.00	2,246,400
S M C	4,800	64,640.00	310,272,000
ホソカワミクロン	600	6,170.00	3,702,000
ユニオンツール	600	4,075.00	2,445,000
オイレス工業	2,300	1,584.00	3,643,200
日精エー・エス・ビー機械	600	4,785.00	2,871,000
サトーホールディングス	2,200	2,700.00	5,940,000
技研製作所	1,400	4,500.00	6,300,000
日本エアテック	600	1,301.00	780,600
カワタ	500	871.00	435,500
日精樹脂工業	1,300	1,359.00	1,766,700
オカダアイヨン	500	1,273.00	636,500
ワイエイシイホールディングス	700	1,084.00	758,800
小松製作所	74,000	2,732.50	202,205,000
住友重機械工業	9,400	3,000.00	28,200,000
日立建機	7,600	3,205.00	24,358,000
日工	2,400	684.00	1,641,600
巴工業	600	2,281.00	1,368,600
井関農機	1,700	1,464.00	2,488,800
T O W A	1,500	2,030.00	3,045,000
丸山製作所	300	1,770.00	531,000
北川鉄工所	800	1,675.00	1,340,000
ローツェ	700	8,570.00	5,999,000
タカキタ	600	605.00	363,000
クボタ	85,800	2,256.50	193,607,700
荏原実業	800	2,880.00	2,304,000

三菱化工機	500	2,482.00	1,241,000
月島機械	3,000	1,147.00	3,441,000
帝国電機製作所	1,100	1,221.00	1,343,100
新東工業	3,900	794.00	3,096,600
澁谷工業	1,400	3,095.00	4,333,000
アイチ コーポレーション	2,700	837.00	2,259,900
小森コーポレーション	4,200	824.00	3,460,800
鶴見製作所	1,200	1,758.00	2,109,600
住友精密工業	200	2,692.00	538,400
日本ギア工業	800	323.00	258,400
酒井重工業	300	2,619.00	785,700
荏原製作所	6,800	5,290.00	35,972,000
石井鐵工所	200	2,990.00	598,000
西島製作所	1,700	855.00	1,453,500
北越工業	1,700	1,051.00	1,786,700
ダイキン工業	20,800	22,205.00	461,864,000
オルガノ	500	6,040.00	3,020,000
トーヨーカネツ	600	2,373.00	1,423,800
栗田工業	8,800	5,400.00	47,520,000
椿本チエイン	2,300	3,300.00	7,590,000
大同工業	800	1,074.00	859,200
木村化工機	1,400	895.00	1,253,000
アネスト岩田	2,800	1,015.00	2,842,000
ダイフク	9,000	9,600.00	86,400,000
サムコ	400	3,045.00	1,218,000
加藤製作所	1,000	967.00	967,000
油研工業	300	1,730.00	519,000
タダノ	7,900	1,097.00	8,666,300
フジテック	5,600	2,360.00	13,216,000
C K D	3,800	2,137.00	8,120,600
キトー	1,400	1,636.00	2,290,400
平和	4,600	1,955.00	8,993,000
理想科学工業	1,300	1,760.00	2,288,000
S A N K Y O	3,900	2,775.00	10,822,500
日本金銭機械	2,200	572.00	1,258,400
マースグループホールディングス	1,100	1,620.00	1,782,000
フクシマガリレイ	1,100	4,480.00	4,928,000
オーイズミ	800	378.00	302,400
ダイコク電機	800	906.00	724,800
竹内製作所	2,700	2,749.00	7,422,300
アマノ	4,300	2,785.00	11,975,500
J U K I	2,400	812.00	1,948,800

サンデンホールディングス	2,600	314.00	816,400
蛇の目ミシン工業	1,600	764.00	1,222,400
マックス	2,200	1,816.00	3,995,200
グローリー	4,200	2,367.00	9,941,400
新晃工業	1,500	2,018.00	3,027,000
大和冷機工業	2,600	1,057.00	2,748,200
セガサミーホールディングス	14,900	1,424.00	21,217,600
日本ピストンリング	700	1,291.00	903,700
リケン	800	2,589.00	2,071,200
T P R	2,200	1,464.00	3,220,800
ツバキ・ナカシマ	3,200	1,599.00	5,116,800
ホシザキ	5,100	9,210.00	46,971,000
大豊工業	1,400	934.00	1,307,600
日本精工	33,700	904.00	30,464,800
N T N	38,500	284.00	10,934,000
ジェイテクト	15,700	1,102.00	17,301,400
不二越	1,500	4,465.00	6,697,500
日本トムソン	4,600	647.00	2,976,200
T H K	10,200	3,245.00	33,099,000
ユーシン精機	1,100	842.00	926,200
前澤給装工業	1,200	1,000.00	1,200,000
イーグル工業	2,000	1,118.00	2,236,000
前澤工業	1,000	634.00	634,000
日本ピラー工業	1,700	2,277.00	3,870,900
キッツ	5,100	773.00	3,942,300
マキタ	21,300	5,600.00	119,280,000
日立造船	13,000	761.00	9,893,000
三菱重工業	25,700	3,092.00	79,464,400
I H I	11,000	2,485.00	27,335,000
スター精密	2,500	1,661.00	4,152,500
日清紡ホールディングス	10,000	929.00	9,290,000
イビデン	7,900	5,690.00	44,951,000
コニカミノルタ	33,300	579.00	19,280,700
ブラザー工業	20,000	2,220.00	44,400,000
ミネベアミツミ	28,200	2,969.00	83,725,800
日立製作所	78,600	6,340.00	498,324,000
東芝	32,300	4,820.00	155,686,000
三菱電機	163,400	1,475.00	241,015,000
富士電機	9,800	5,030.00	49,294,000
東洋電機製造	700	1,165.00	815,500
安川電機	17,600	5,260.00	92,576,000
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,263.00	2,778,600

明電舎	2,800	2,300.00	6,440,000
オリジン	500	1,319.00	659,500
山洋電気	800	7,520.00	6,016,000
デンヨー	1,400	1,961.00	2,745,400
東芝テック	1,800	4,520.00	8,136,000
芝浦メカトロニクス	300	7,480.00	2,244,000
マブチモーター	4,500	4,120.00	18,540,000
日本電産	39,300	12,760.00	501,468,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	775.00	697,500
トレックス・セミコンダクター	900	2,839.00	2,555,100
東光高岳	900	1,347.00	1,212,300
ダイヘン	1,800	4,810.00	8,658,000
ヤーマン	2,700	1,321.00	3,566,700
JVCケンウッド	14,700	268.00	3,939,600
ミマキエンジニアリング	1,500	769.00	1,153,500
I - P E X	800	2,515.00	2,012,000
日新電機	3,800	1,320.00	5,016,000
大崎電気工業	3,300	632.00	2,085,600
オムロン	13,600	8,970.00	121,992,000
日東工業	2,400	1,829.00	4,389,600
I D E C	2,200	2,191.00	4,820,200
正興電機製作所	500	1,745.00	872,500
不二電機工業	300	1,290.00	387,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,900	2,795.00	16,490,500
サクサホールディングス	400	1,335.00	534,000
メルコホールディングス	600	5,610.00	3,366,000
テクノメディカ	400	1,600.00	640,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	3,560.00	1,780,000
日本電気	20,700	5,610.00	116,127,000
富士通	14,700	20,160.00	296,352,000
沖電気工業	6,700	1,009.00	6,760,300
岩崎通信機	800	940.00	752,000
電気興業	800	2,230.00	1,784,000
サンケン電気	1,900	5,080.00	9,652,000
ナカヨ	300	1,403.00	420,900
アイホン	1,000	2,041.00	2,041,000
ルネサスエレクトロニクス	78,300	1,172.00	91,767,600
セイコーエプソン	20,300	1,825.00	37,047,500
ワコム	11,800	670.00	7,906,000
アルバック	3,000	5,340.00	16,020,000
アクセル	700	850.00	595,000
E I Z O	1,400	4,735.00	6,629,000

日本信号	3,800	901.00	3,423,800
京三製作所	3,700	414.00	1,531,800
能美防災	2,100	2,096.00	4,401,600
ホーチキ	1,200	1,140.00	1,368,000
星和電機	900	521.00	468,900
エレコム	3,800	1,993.00	7,573,400
パナソニック	174,300	1,296.00	225,892,800
シャープ	21,800	1,716.00	37,408,800
アンリツ	9,800	2,069.00	20,276,200
富士通ゼネラル	5,000	2,874.00	14,370,000
ソニーグループ	102,400	10,930.00	1,119,232,000
T D K	7,900	13,100.00	103,490,000
帝国通信工業	800	1,114.00	891,200
タムラ製作所	6,100	930.00	5,673,000
アルプスアルパイン	13,400	1,165.00	15,611,000
池上通信機	600	819.00	491,400
鈴木	800	924.00	739,200
日本トリム	400	3,685.00	1,474,000
ローランド ディー . ジー .	1,000	2,719.00	2,719,000
フォスター電機	1,700	924.00	1,570,800
S M K	500	2,464.00	1,232,000
ヨコオ	1,300	2,550.00	3,315,000
ホシデン	4,300	1,005.00	4,321,500
ヒロセ電機	2,500	16,200.00	40,500,000
日本航空電子工業	3,800	1,795.00	6,821,000
T O A	1,900	835.00	1,586,500
マクセルホールディングス	3,300	1,265.00	4,174,500
古野電気	2,100	1,084.00	2,276,400
ユニデンホールディングス	400	2,604.00	1,041,600
スミダコーポレーション	1,400	1,277.00	1,787,800
アイコム	700	2,376.00	1,663,200
リオン	700	2,674.00	1,871,800
本多通信工業	1,500	487.00	730,500
横河電機	16,400	1,660.00	27,224,000
新電元工業	700	4,355.00	3,048,500
アズビル	11,000	4,350.00	47,850,000
東亜ディーケーケー	800	791.00	632,800
日本光電工業	6,800	3,315.00	22,542,000
チノー	500	1,458.00	729,000
共和電業	1,700	377.00	640,900
日本電子材料	700	1,764.00	1,234,800
堀場製作所	3,200	6,900.00	22,080,000

アドバンテスト	12,100	9,160.00	110,836,000
小野測器	800	597.00	477,600
エスベック	1,400	2,173.00	3,042,200
キーエンス	16,000	55,680.00	890,880,000
日置電機	800	6,780.00	5,424,000
シスメックス	12,800	12,880.00	164,864,000
日本マイクロニクス	2,900	1,384.00	4,013,600
メガチップス	1,600	3,275.00	5,240,000
O B A R A G R O U P	800	3,835.00	3,068,000
澤藤電機	200	2,090.00	418,000
原田工業	800	909.00	727,200
コーセル	2,100	1,001.00	2,102,100
イリソ電子工業	1,400	5,260.00	7,364,000
オブテックスグループ	2,700	1,769.00	4,776,300
千代田インテグレ	700	1,741.00	1,218,700
アイ・オー・データ機器	600	987.00	592,200
レーザーテック	7,200	21,250.00	153,000,000
スタンレー電気	11,400	3,000.00	34,200,000
岩崎電気	600	2,049.00	1,229,400
ウシオ電機	8,400	1,940.00	16,296,000
岡谷電機産業	1,400	371.00	519,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	349.00	593,300
エノモト	500	1,702.00	851,000
日本セラミック	1,700	2,834.00	4,817,800
遠藤照明	900	724.00	651,600
古河電池	1,200	1,496.00	1,795,200
双信電機	1,000	557.00	557,000
山一電機	1,100	1,607.00	1,767,700
図研	1,100	3,510.00	3,861,000
日本電子	3,000	6,420.00	19,260,000
カシオ計算機	13,200	1,788.00	23,601,600
ファナック	14,300	25,760.00	368,368,000
日本シイエムケイ	3,700	417.00	1,542,900
エンプラス	800	3,345.00	2,676,000
大真空	600	3,495.00	2,097,000
ローム	6,800	10,060.00	68,408,000
浜松ホトニクス	11,700	6,290.00	73,593,000
三井ハイテック	1,600	5,650.00	9,040,000
新光電気工業	5,500	3,730.00	20,515,000
京セラ	24,900	6,746.00	167,975,400
太陽誘電	7,300	5,310.00	38,763,000
村田製作所	48,000	8,775.00	421,200,000

双葉電子工業	2,900	787.00	2,282,300	
北陸電気工業	700	1,046.00	732,200	
ニチコン	5,200	1,138.00	5,917,600	
日本ケミコン	1,700	2,489.00	4,231,300	
K O A	2,300	1,583.00	3,640,900	
市光工業	2,500	685.00	1,712,500	
小糸製作所	9,800	6,470.00	63,406,000	
ミツバ	3,100	786.00	2,436,600	
S C R E E Nホールディングス	2,800	9,420.00	26,376,000	
キャノン電子	1,600	1,653.00	2,644,800	
キャノン	81,200	2,479.00	201,294,800	
リコー	41,700	1,164.00	48,538,800	
象印マホービン	4,500	1,567.00	7,051,500	
M U T O Hホールディングス	300	1,588.00	476,400	
東京エレクトロン	9,600	44,550.00	427,680,000	
トヨタ紡織	4,800	2,216.00	10,636,800	
芦森工業	400	1,154.00	461,600	
ユニプレス	2,800	943.00	2,640,400	
豊田自動織機	13,200	8,950.00	118,140,000	
モリタホールディングス	2,600	1,600.00	4,160,000	
三櫻工業	2,300	1,219.00	2,803,700	
デンソー	36,000	7,166.00	257,976,000	
東海理化電機製作所	4,300	1,745.00	7,503,500	
三井E & Sホールディングス	6,500	504.00	3,276,000	
川崎重工業	12,800	2,250.00	28,800,000	
名村造船所	5,600	188.00	1,052,800	
日本車輛製造	600	2,100.00	1,260,000	
三菱ロジスネクスト	2,200	991.00	2,180,200	
近畿車輛	300	1,186.00	355,800	
日産自動車	192,900	561.90	108,390,510	
いすゞ自動車	43,400	1,402.00	60,846,800	
トヨタ自動車	165,500	9,740.00	1,611,970,000	代用有価証券 23,000株
日野自動車	20,400	901.00	18,380,400	
三菱自動車工業	60,900	286.00	17,417,400	
エフテック	1,200	774.00	928,800	
レシップホールディングス	800	575.00	460,000	
G M B	400	1,184.00	473,600	
ファルテック	300	711.00	213,300	
武蔵精密工業	3,600	2,270.00	8,172,000	
日産車体	2,400	712.00	1,708,800	
新明和工業	4,600	950.00	4,370,000	
極東開発工業	2,800	1,529.00	4,281,200	

トピー工業	1,400	1,262.00	1,766,800
ティラド	500	2,643.00	1,321,500
タチエス	2,600	1,409.00	3,663,400
N O K	7,900	1,388.00	10,965,200
フタバ産業	4,100	552.00	2,263,200
K Y B	1,900	3,590.00	6,821,000
大同メタル工業	3,500	603.00	2,110,500
プレス工業	8,100	351.00	2,843,100
ミクニ	2,400	312.00	748,800
太平洋工業	3,400	1,170.00	3,978,000
河西工業	2,600	389.00	1,011,400
アイシン	11,900	4,730.00	56,287,000
マツダ	51,300	1,002.00	51,402,600
今仙電機製作所	1,500	695.00	1,042,500
本田技研工業	128,600	3,457.00	444,570,200
スズキ	32,400	4,461.00	144,536,400
S U B A R U	46,800	2,088.50	97,741,800
安永	900	1,142.00	1,027,800
ヤマハ発動機	23,100	2,676.00	61,815,600
T B K	2,100	410.00	861,000
エクセディ	2,200	1,648.00	3,625,600
豊田合成	5,300	2,610.00	13,833,000
愛三工業	2,600	902.00	2,345,200
盟和産業	300	991.00	297,300
日本プラスト	1,500	688.00	1,032,000
ヨロズ	1,500	1,193.00	1,789,500
エフ・シー・シー	2,700	1,539.00	4,155,300
シマノ	6,100	27,880.00	170,068,000
テイ・エス テック	7,600	1,636.00	12,433,600
ジャムコ	1,100	1,021.00	1,123,100
テルモ	50,100	4,181.00	209,468,100
クリエートメディック	500	975.00	487,500
日機装	5,300	1,118.00	5,925,400
日本エム・ディ・エム	1,000	2,264.00	2,264,000
島津製作所	21,000	4,325.00	90,825,000
J M S	1,500	799.00	1,198,500
長野計器	1,200	1,033.00	1,239,600
ブイ・テクノロジー	800	4,985.00	3,988,000
東京計器	1,100	1,034.00	1,137,400
愛知時計電機	200	4,360.00	872,000
インターアクション	800	2,196.00	1,756,800
オーバル	1,600	283.00	452,800

東京精密	2,700	4,580.00	12,366,000
マニー	6,500	2,427.00	15,775,500
ニコン	25,000	972.00	24,300,000
トプコン	8,300	1,560.00	12,948,000
オリンパス	90,400	2,165.00	195,716,000
理研計器	1,400	2,575.00	3,605,000
タムロン	1,400	2,391.00	3,347,400
H O Y A	31,900	14,490.00	462,231,000
シード	800	726.00	580,800
ノーリツ鋼機	1,500	2,390.00	3,585,000
エー・アンド・デイ	1,400	975.00	1,365,000
朝日インテック	17,300	2,775.00	48,007,500
シチズン時計	21,400	410.00	8,774,000
リズム	600	924.00	554,400
大研医器	1,400	544.00	761,600
メニコン	2,500	7,590.00	18,975,000
シンシア	200	582.00	116,400
松風	800	2,021.00	1,616,800
セイコーホールディングス	2,400	2,272.00	5,452,800
ニプロ	12,200	1,331.00	16,238,200
中本パックス	400	1,715.00	686,000
スノーピーク	1,000	3,845.00	3,845,000
パラマウントベッドホールディングス	3,100	1,966.00	6,094,600
トランザクション	900	1,279.00	1,151,100
粧美堂	600	413.00	247,800
ニホンフラッシュ	1,400	1,237.00	1,731,800
前田工織	1,800	3,540.00	6,372,000
永大産業	2,300	298.00	685,400
アートネイチャー	1,500	670.00	1,005,000
バンダイナムコホールディングス	13,500	7,276.00	98,226,000
アイフィスジャパン	400	676.00	270,400
共立印刷	3,500	138.00	483,000
S H O E I	1,500	4,225.00	6,337,500
フランスベッドホールディングス	2,400	906.00	2,174,400
パイロットコーポレーション	2,700	3,720.00	10,044,000
萩原工業	900	1,454.00	1,308,600
トッパン・フォームズ	2,900	1,057.00	3,065,300
フジシールインターナショナル	3,300	2,196.00	7,246,800
タカラトミー	7,500	996.00	7,470,000
廣濟堂	1,200	831.00	997,200
エステールホールディングス	700	642.00	449,400
タカノ	600	655.00	393,000

プロネクサス	1,300	1,025.00	1,332,500
ホクシン	1,500	157.00	235,500
ウッドワン	600	1,180.00	708,000
大建工業	1,100	2,125.00	2,337,500
凸版印刷	24,800	1,839.00	45,607,200
大日本印刷	19,300	2,478.00	47,825,400
共同印刷	500	2,650.00	1,325,000
N I S S H A	3,400	1,518.00	5,161,200
光村印刷	100	1,585.00	158,500
TAKARA & COMPANY	800	1,777.00	1,421,600
アシックス	14,500	2,422.00	35,119,000
ツツミ	500	2,374.00	1,187,000
ローランド	1,300	5,170.00	6,721,000
小松ウオール工業	600	2,085.00	1,251,000
ヤマハ	9,700	6,050.00	58,685,000
河合楽器製作所	500	4,010.00	2,005,000
クリナップ	1,600	529.00	846,400
ピジョン	10,500	3,150.00	33,075,000
オリバー	400	3,780.00	1,512,000
兼松サステック	200	1,799.00	359,800
キングジム	1,500	887.00	1,330,500
リンテック	3,500	2,353.00	8,235,500
イトーキ	3,500	349.00	1,221,500
任天堂	9,400	61,290.00	576,126,000
三菱鉛筆	2,700	1,392.00	3,758,400
タカラスタンダード	3,400	1,595.00	5,423,000
コクヨ	7,900	1,773.00	14,006,700
ナカバヤシ	1,500	585.00	877,500
オカムラ	5,700	1,481.00	8,441,700
美津濃	1,700	2,450.00	4,165,000
東京電力ホールディングス	138,700	330.00	45,771,000
中部電力	49,800	1,323.50	65,910,300
関西電力	61,900	1,051.00	65,056,900
中国電力	23,600	1,020.00	24,072,000
北陸電力	15,000	595.00	8,925,000
東北電力	38,300	865.00	33,129,500
四国電力	13,600	755.00	10,268,000
九州電力	36,200	845.00	30,589,000
北海道電力	15,300	515.00	7,879,500
沖縄電力	3,200	1,412.00	4,518,400
電源開発	13,000	1,635.00	21,255,000
エフオン	1,000	1,067.00	1,067,000

イーレックス	2,400	3,060.00	7,344,000
レノバ	2,800	4,850.00	13,580,000
東京瓦斯	31,400	2,056.00	64,558,400
大阪瓦斯	29,600	2,024.00	59,910,400
東邦瓦斯	8,000	5,470.00	43,760,000
北海道瓦斯	900	1,583.00	1,424,700
広島ガス	3,300	370.00	1,221,000
西部ガスホールディングス	1,900	2,425.00	4,607,500
静岡ガス	4,600	1,073.00	4,935,800
メタウォーター	1,800	2,010.00	3,618,000
SBSホールディングス	1,200	3,285.00	3,942,000
東武鉄道	17,100	2,792.00	47,743,200
相鉄ホールディングス	5,700	2,129.00	12,135,300
東急	41,300	1,482.00	61,206,600
京浜急行電鉄	21,100	1,322.00	27,894,200
小田急電鉄	26,200	2,673.00	70,032,600
京王電鉄	9,100	6,250.00	56,875,000
京成電鉄	12,200	3,380.00	41,236,000
富士急行	2,200	5,030.00	11,066,000
東日本旅客鉄道	28,800	7,627.00	219,657,600
西日本旅客鉄道	14,600	6,018.00	87,862,800
東海旅客鉄道	13,600	16,010.00	217,736,000
西武ホールディングス	19,800	1,251.00	24,769,800
鴻池運輸	2,600	1,216.00	3,161,600
西日本鉄道	4,600	2,609.00	12,001,400
ハマキョウレックス	1,200	3,160.00	3,792,000
サカイ引越センター	700	5,640.00	3,948,000
近鉄グループホールディングス	15,500	3,785.00	58,667,500
阪急阪神ホールディングス	20,600	3,330.00	68,598,000
南海電気鉄道	7,300	2,300.00	16,790,000
京阪ホールディングス	6,900	3,185.00	21,976,500
神戸電鉄	400	3,455.00	1,382,000
名古屋鉄道	12,800	1,958.00	25,062,400
山陽電気鉄道	1,200	1,909.00	2,290,800
アルプス物流	1,100	937.00	1,030,700
日本通運	5,300	8,170.00	43,301,000
ヤマトホールディングス	21,700	3,230.00	70,091,000
山九	3,900	4,810.00	18,759,000
丸運	900	270.00	243,000
丸全昭和運輸	1,200	3,320.00	3,984,000
センコーグループホールディングス	8,500	1,080.00	9,180,000
トナミホールディングス	400	4,930.00	1,972,000

ニッコンホールディングス	5,200	2,389.00	12,422,800
日本石油輸送	200	2,580.00	516,000
福山通運	2,000	4,030.00	8,060,000
セイノーホールディングス	11,600	1,378.00	15,984,800
エスライン	400	896.00	358,400
神奈川中央交通	400	3,465.00	1,386,000
日立物流	3,400	4,315.00	14,671,000
丸和運輸機関	3,300	1,538.00	5,075,400
C & F ロジホールディングス	1,600	1,597.00	2,555,200
九州旅客鉄道	12,000	2,507.00	30,084,000
S Gホールディングス	29,200	2,940.00	85,848,000
日本郵船	12,900	5,310.00	68,499,000
商船三井	9,200	4,940.00	45,448,000
川崎汽船	4,800	3,545.00	17,016,000
N S ユナイテッド海運	800	2,271.00	1,816,800
飯野海運	7,300	430.00	3,139,000
乾汽船	1,100	1,217.00	1,338,700
日本航空	37,700	2,313.00	87,200,100
A N Aホールディングス	41,800	2,538.50	106,109,300
パスコ	300	1,538.00	461,400
トランコム	500	8,170.00	4,085,000
日新	1,300	1,464.00	1,903,200
三菱倉庫	5,300	3,250.00	17,225,000
三井倉庫ホールディングス	1,700	2,515.00	4,275,500
住友倉庫	5,400	1,558.00	8,413,200
澁澤倉庫	900	2,083.00	1,874,700
東陽倉庫	2,700	310.00	837,000
日本トランスシティ	3,400	560.00	1,904,000
ケイヒン	200	1,358.00	271,600
中央倉庫	900	1,000.00	900,000
川西倉庫	300	1,133.00	339,900
安田倉庫	1,300	949.00	1,233,700
ファイズホールディングス	300	807.00	242,100
東洋埠頭	400	1,422.00	568,800
宇徳	1,100	518.00	569,800
上組	8,500	2,290.00	19,465,000
サンリツ	400	759.00	303,600
キムラユニティー	400	1,290.00	516,000
キューソー流通システム	400	1,689.00	675,600
近鉄エクスプレス	2,900	2,564.00	7,435,600
東海運	1,000	305.00	305,000
エーアイティー	1,000	1,088.00	1,088,000

内外トランスライン	600	1,922.00	1,153,200
日本コンセプト	500	1,935.00	967,500
NEC ネットズエスアイ	5,300	1,795.00	9,513,500
クロスキャット	400	982.00	392,800
システナ	5,700	2,170.00	12,369,000
デジタルアーツ	900	7,880.00	7,092,000
日鉄ソリューションズ	2,300	3,500.00	8,050,000
キューブシステム	800	1,014.00	811,200
WOW WORLD	300	1,991.00	597,300
コア	700	1,418.00	992,600
ラクーンホールディングス	1,200	2,356.00	2,827,200
ソリトンシステムズ	800	1,562.00	1,249,600
ソフトクリエイイトホールディングス	600	2,826.00	1,695,600
T I S	16,000	2,860.00	45,760,000
J N Sホールディングス	800	624.00	499,200
グリー	9,800	608.00	5,958,400
G M Oペパボ	100	4,520.00	452,000
コーエーテクモホールディングス	4,300	4,905.00	21,091,500
三菱総合研究所	700	4,025.00	2,817,500
ボルテージ	600	469.00	281,400
電算	200	2,273.00	454,600
A G S	800	873.00	698,400
ファインデックス	1,400	1,102.00	1,542,800
ブレインパッド	400	4,545.00	1,818,000
K L a b	3,100	668.00	2,070,800
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,200	1,046.00	2,301,200
イーブックイニシアティブジャパン	300	3,240.00	972,000
ネクソン	40,600	2,302.00	93,461,200
アイスタイル	5,000	483.00	2,415,000
エムアップホールディングス	400	3,325.00	1,330,000
エイチーム	1,100	1,492.00	1,641,200
エニグモ	1,500	1,473.00	2,209,500
テクノスジャパン	1,300	602.00	782,600
コロプラ	5,300	835.00	4,425,500
オルトプラス	1,300	405.00	526,500
ブロードリーフ	7,900	505.00	3,989,500
クロス・マーケティンググループ	800	631.00	504,800
デジタルハーツホールディングス	800	1,491.00	1,192,800
システム情報	1,200	914.00	1,096,800
メディアドゥ	600	4,210.00	2,526,000
じげん	4,100	445.00	1,824,500
バイキューブ	900	2,468.00	2,221,200

エンカレッジ・テクノロジー	400	632.00	252,800
サイバーリンクス	600	1,513.00	907,800
フィックスターズ	1,800	809.00	1,456,200
CARTA HOLDINGS	700	1,866.00	1,306,200
オブティム	1,100	2,097.00	2,306,700
セレス	500	3,170.00	1,585,000
SHIFT	800	19,440.00	15,552,000
ティーガイア	1,700	1,987.00	3,377,900
セック	200	2,626.00	525,200
日本アジアグループ	1,600	968.00	1,548,800
テクマトリックス	2,500	1,851.00	4,627,500
プロシップ	400	1,433.00	573,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	2,057.00	8,022,300
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	13,680.00	42,408,000
ザッパラス	700	510.00	357,000
システムリサーチ	500	2,141.00	1,070,500
インターネットイニシアティブ	4,300	3,565.00	15,329,500
さくらインターネット	1,800	614.00	1,105,200
ヴィンクス	500	929.00	464,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	4,490.00	1,796,000
SRAホールディングス	800	2,662.00	2,129,600
システムインテグレータ	500	632.00	316,000
朝日ネット	1,300	691.00	898,300
eBASE	1,900	840.00	1,596,000
アバント	1,700	1,624.00	2,760,800
アドソル日進	600	2,120.00	1,272,000
ODKソリューションズ	300	783.00	234,900
フリービット	1,000	767.00	767,000
コムチュア	1,500	2,287.00	3,430,500
サイバーコム	300	1,402.00	420,600
アステリア	1,200	808.00	969,600
アイル	900	1,400.00	1,260,000
マークラインズ	700	2,865.00	2,005,500
メディカル・データ・ビジョン	1,800	2,002.00	3,603,600
gumi	2,300	805.00	1,851,500
ショーケース	400	695.00	278,000
モバイルファクトリー	400	1,127.00	450,800
テラスカイ	500	2,146.00	1,073,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,870.00	1,309,000
PCIホールディングス	700	1,108.00	775,600
パイブドHD	400	2,148.00	859,200
アイビーシー	300	965.00	289,500

ネオジャパン	300	1,426.00	427,800
P R T I M E S	400	3,240.00	1,296,000
ラクス	4,800	3,155.00	15,144,000
ランドコンピュータ	200	1,096.00	219,200
ダブルスタンダード	200	5,290.00	1,058,000
オープンドア	1,000	2,206.00	2,206,000
マイネット	600	683.00	409,800
アカツキ	700	3,500.00	2,450,000
ベネフィットジャパン	100	1,991.00	199,100
U b i c o mホールディングス	400	3,380.00	1,352,000
カナミックネットワーク	1,800	614.00	1,105,200
ノムラシステムコーポレーション	800	314.00	251,200
チェンジ	2,900	2,663.00	7,722,700
シンクロ・フード	1,100	366.00	402,600
オークネット	900	1,609.00	1,448,100
キャピタル・アセット・プランニング	300	1,009.00	302,700
セグエグループ	400	1,071.00	428,400
エイトレッド	300	2,358.00	707,400
A O I T Y O H o l d i n g s	1,700	900.00	1,530,000
マクロミル	3,400	810.00	2,754,000
ビーグリー	400	1,593.00	637,200
オロ	500	3,775.00	1,887,500
ユーザーローカル	600	1,892.00	1,135,200
テモナ	400	1,055.00	422,000
ニーズウェル	400	644.00	257,600
サインポスト	500	737.00	368,500
電算システムホールディングス	600	2,950.00	1,770,000
ソルクシーズ	600	952.00	571,200
フェイス	500	710.00	355,000
プロトコーポレーション	1,900	1,348.00	2,561,200
ハイマックス	400	1,082.00	432,800
野村総合研究所	27,800	3,570.00	99,246,000
サイバネットシステム	1,200	694.00	832,800
C Eホールディングス	900	567.00	510,300
日本システム技術	300	1,567.00	470,100
インテージホールディングス	2,000	1,541.00	3,082,000
東邦システムサイエンス	400	942.00	376,800
ソースネクスト	7,800	305.00	2,379,000
インフォコム	1,500	2,847.00	4,270,500
H E R O Z	500	2,102.00	1,051,000
ラクスル	1,800	5,380.00	9,684,000
I P S	400	2,835.00	1,134,000

F I G	1,900	276.00	524,400
システムサポート	500	1,317.00	658,500
イーソル	900	1,076.00	968,400
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,857.00	3,342,600
E d u L a b	200	5,030.00	1,006,000
東海ソフト	300	1,388.00	416,400
ウイングアーク1 s t	900	2,161.00	1,944,900
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	2,103.00	841,200
サーバーワークス	200	4,110.00	822,000
東名	200	1,139.00	227,800
ヴィッツ	100	1,871.00	187,100
トピラシステムズ	200	1,264.00	252,800
S a n s a n	1,400	7,990.00	11,186,000
L i n k - U	300	1,500.00	450,000
ギフトィ	1,000	3,410.00	3,410,000
ベース	200	4,910.00	982,000
フォーカスシステムズ	1,100	1,017.00	1,118,700
クレスコ	1,000	1,919.00	1,919,000
フジ・メディア・ホールディングス	16,600	1,221.00	20,268,600
オービック	5,000	20,280.00	101,400,000
ジャストシステム	2,300	6,140.00	14,122,000
T D C ソフト	1,400	1,044.00	1,461,600
Zホールディングス	220,200	577.70	127,209,540
トレンドマイクロ	8,600	5,820.00	50,052,000
I Dホールディングス	900	940.00	846,000
日本オラクル	3,200	8,070.00	25,824,000
アルファシステムズ	400	3,720.00	1,488,000
フューチャー	1,900	1,895.00	3,600,500
C A C H o l d i n g s	1,000	1,395.00	1,395,000
S Bテクノロジー	600	2,998.00	1,798,800
トーセ	500	802.00	401,000
オービックビジネスコンサルタント	1,500	6,480.00	9,720,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,300	3,405.00	24,856,500
アイティフォー	2,100	759.00	1,593,900
東計電算	200	4,360.00	872,000
エクスネット	200	1,018.00	203,600
大塚商会	8,700	5,820.00	50,634,000
サイボウズ	1,900	2,407.00	4,573,300
電通国際情報サービス	2,000	4,610.00	9,220,000
A C C E S S	2,100	853.00	1,791,300
デジタルガレージ	2,600	4,790.00	12,454,000
E Mシステムズ	2,700	822.00	2,219,400

ウェザーニューズ	500	5,540.00	2,770,000
C I J	1,000	841.00	841,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,235.00	647,000
日本エンタープライズ	1,900	203.00	385,700
WOWOW	800	2,420.00	1,936,000
スカラ	1,500	750.00	1,125,000
インテリジェント ウェイブ	1,000	610.00	610,000
I M A G I C A G R O U P	1,500	432.00	648,000
ネットワンシステムズ	6,500	3,820.00	24,830,000
システムソフト	4,000	267.00	1,068,000
アルゴグラフィックス	1,200	3,385.00	4,062,000
マーベラス	2,600	760.00	1,976,000
エイベックス	2,800	1,693.00	4,740,400
日本ユニシス	5,600	3,445.00	19,292,000
兼松エレクトロニクス	900	3,630.00	3,267,000
都築電気	700	1,594.00	1,115,800
T B S ホールディングス	10,600	1,690.00	17,914,000
日本テレビホールディングス	13,300	1,252.00	16,651,600
朝日放送グループホールディングス	1,600	698.00	1,116,800
テレビ朝日ホールディングス	5,000	1,705.00	8,525,000
スカパーJ S A Tホールディングス	10,600	409.00	4,335,400
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,085.00	2,502,000
日本BS放送	600	1,092.00	655,200
ビジョン	2,000	1,057.00	2,114,000
スマートバリュー	500	692.00	346,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,500	2,432.00	3,648,000
コネクション	1,200	1,546.00	1,855,200
クロップス	400	903.00	361,200
日本電信電話	187,700	2,858.50	536,540,450
K D D I	128,700	3,466.00	446,074,200
ソフトバンク	145,900	1,466.00	213,889,400
光通信	1,900	20,310.00	38,589,000
エムティーアイ	1,600	685.00	1,096,000
G M O インターネット	5,700	3,005.00	17,128,500
ファイバーゲート	600	1,424.00	854,400
アйдママーケティングコミュニケーション	500	391.00	195,500
K A D O K A W A	4,100	4,185.00	17,158,500
学研ホールディングス	2,300	1,308.00	3,008,400
ゼンリン	3,000	1,103.00	3,309,000
昭文社ホールディングス	800	483.00	386,400
インプレスホールディングス	1,500	239.00	358,500
アイネット	800	1,423.00	1,138,400

松竹	1,100	11,850.00	13,035,000
東宝	9,400	4,910.00	46,154,000
東映	500	19,880.00	9,940,000
エヌ・ティ・ティ・データ	42,600	1,736.00	73,953,600
ピー・シー・エー	200	3,880.00	776,000
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,733.00	1,039,800
D T S	3,300	2,700.00	8,910,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,900	5,460.00	37,674,000
シーイーシー	1,700	1,634.00	2,777,800
カプコン	13,700	3,040.00	41,648,000
アイ・エス・ピー	700	1,454.00	1,017,800
ジャステック	1,000	1,199.00	1,199,000
S C S K	3,700	6,750.00	24,975,000
日本システムウエア	500	2,309.00	1,154,500
アイネス	1,600	1,367.00	2,187,200
T K C	2,700	3,210.00	8,667,000
富士ソフト	1,700	5,530.00	9,401,000
N S D	5,100	1,850.00	9,435,000
コナミホールディングス	5,800	6,050.00	35,090,000
福井コンピュータホールディングス	700	3,965.00	2,775,500
J B C Cホールディングス	1,100	1,476.00	1,623,600
ミロク情報サービス	1,600	1,625.00	2,600,000
ソフトバンクグループ	127,300	7,342.00	934,636,600
ハウスイ	200	936.00	187,200
高千穂交易	600	1,150.00	690,000
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,669.00	500,700
伊藤忠食品	400	5,300.00	2,120,000
エレマテック	1,300	1,254.00	1,630,200
J A L U X	500	1,731.00	865,500
あらた	1,300	4,115.00	5,349,500
トーメンデバイス	200	4,140.00	828,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,190.00	2,595,000
フィールズ	1,600	518.00	828,800
双日	89,200	334.00	29,792,800
アルフレッサ ホールディングス	16,700	1,699.00	28,373,300
横浜冷凍	4,600	880.00	4,048,000
神栄	300	1,180.00	354,000
ラサ商事	900	890.00	801,000
アルコニックス	1,800	1,430.00	2,574,000
神戸物産	11,100	3,820.00	42,402,000
ハイパー	400	543.00	217,200
あい ホールディングス	2,300	2,071.00	4,763,300

ディーブイエックス	500	976.00	488,000
ダイワボウホールディングス	7,300	2,142.00	15,636,600
マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	2,631.00	9,997,800
ラクト・ジャパン	700	2,664.00	1,864,800
グリムス	500	1,899.00	949,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,900	751.00	2,177,900
八洲電機	1,200	965.00	1,158,000
メディアスホールディングス	900	1,000.00	900,000
レスターホールディングス	1,700	1,892.00	3,216,400
ジューテックホールディングス	400	1,041.00	416,400
大光	700	674.00	471,800
OCHIホールディングス	500	1,287.00	643,500
TOKAIホールディングス	7,700	899.00	6,922,300
黒谷	500	808.00	404,000
Cominix	400	724.00	289,600
三洋貿易	1,600	1,218.00	1,948,800
ビューティガレージ	300	4,205.00	1,261,500
ウイン・パートナーズ	1,200	988.00	1,185,600
ミタチ産業	400	832.00	332,800
シップヘルスケアホールディングス	5,700	2,692.00	15,344,400
明治電機工業	500	1,415.00	707,500
デリカフーズホールディングス	900	655.00	589,500
スターティアホールディングス	300	2,002.00	600,600
コメダホールディングス	3,600	2,064.00	7,430,400
ピーバンドットコム	300	780.00	234,000
アセンテック	400	1,156.00	462,400
富士興産	500	1,040.00	520,000
協栄産業	200	1,420.00	284,000
小野建	1,400	1,320.00	1,848,000
南陽	300	1,935.00	580,500
佐島電機	1,000	839.00	839,000
エコートレーディング	300	652.00	195,600
伯東	1,000	1,511.00	1,511,000
コンドーテック	1,200	985.00	1,182,000
中山福	1,100	445.00	489,500
ナガイレーベン	2,100	2,519.00	5,289,900
三菱食品	1,700	2,769.00	4,707,300
松田産業	1,200	2,140.00	2,568,000
第一興商	3,100	4,100.00	12,710,000
メディバルホールディングス	16,100	2,133.00	34,341,300
S P K	700	1,371.00	959,700
萩原電気ホールディングス	600	2,258.00	1,354,800

アズワン	1,200	14,750.00	17,700,000
スズデン	600	1,462.00	877,200
シモジマ	1,000	1,072.00	1,072,000
ドウシシャ	1,500	1,697.00	2,545,500
小津産業	400	1,894.00	757,600
高速	800	1,451.00	1,160,800
たけびし	500	1,533.00	766,500
リックス	400	1,510.00	604,000
丸文	1,400	688.00	963,200
ハピネット	1,400	1,464.00	2,049,600
橋本総業ホールディングス	300	2,830.00	849,000
日本ライフライン	5,200	1,350.00	7,020,000
タカショー	1,200	881.00	1,057,200
マルカ	500	2,531.00	1,265,500
I D O M	5,500	923.00	5,076,500
進和	900	2,211.00	1,989,900
エスケイジャパン	500	491.00	245,500
ダイトロン	700	1,930.00	1,351,000
シークス	2,100	1,406.00	2,952,600
田中商事	500	661.00	330,500
オーハシテクニカ	900	1,529.00	1,376,100
白銅	600	2,161.00	1,296,600
ダイコー通産	200	1,262.00	252,400
伊藤忠商事	112,500	3,255.00	366,187,500
丸紅	158,600	946.60	150,130,760
高島	200	1,805.00	361,000
長瀬産業	8,800	1,665.00	14,652,000
蝶理	1,000	1,792.00	1,792,000
豊田通商	16,100	5,170.00	83,237,000
三共生興	2,400	553.00	1,327,200
兼松	6,400	1,471.00	9,414,400
ツカモトコーポレーション	300	1,424.00	427,200
三井物産	128,300	2,523.50	323,765,050
日本紙パルプ商事	800	3,610.00	2,888,000
カメイ	2,000	1,136.00	2,272,000
東都水産	200	5,100.00	1,020,000
O U Gホールディングス	300	2,845.00	853,500
スターゼン	1,200	2,153.00	2,583,600
山善	6,300	1,011.00	6,369,300
椿本興業	300	3,475.00	1,042,500
住友商事	101,600	1,475.00	149,860,000
内田洋行	700	4,725.00	3,307,500

三菱商事	97,900	3,066.00	300,161,400
第一実業	700	4,475.00	3,132,500
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	2,536.00	10,144,000
西華産業	800	1,637.00	1,309,600
佐藤商事	1,300	1,110.00	1,443,000
菱洋エレクトロ	1,200	2,525.00	3,030,000
東京産業	1,400	636.00	890,400
ユアサ商事	1,600	3,055.00	4,888,000
神鋼商事	400	2,289.00	915,600
トルク	1,000	227.00	227,000
阪和興業	3,200	3,055.00	9,776,000
正栄食品工業	1,000	3,855.00	3,855,000
カナデン	1,300	1,060.00	1,378,000
菱電商事	1,100	1,640.00	1,804,000
フルサト工業	800	1,966.00	1,572,800
岩谷産業	3,900	6,330.00	24,687,000
ナイス	700	1,991.00	1,393,700
ニチモウ	300	2,028.00	608,400
極東貿易	500	2,608.00	1,304,000
アステナホールディングス	2,400	583.00	1,399,200
三愛石油	4,000	1,317.00	5,268,000
稲畑産業	3,800	1,672.00	6,353,600
G S Iクレオス	800	961.00	768,800
明和産業	1,500	467.00	700,500
クワザワホールディングス	600	614.00	368,400
ヤマエ久野	1,100	1,110.00	1,221,000
ワキタ	3,200	1,032.00	3,302,400
東邦ホールディングス	5,200	1,882.00	9,786,400
サンゲツ	4,300	1,589.00	6,832,700
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,211.00	2,906,400
シナネンホールディングス	600	3,110.00	1,866,000
伊藤忠エネクス	3,400	1,003.00	3,410,200
サンリオ	4,600	1,935.00	8,901,000
サンワテクノス	1,100	1,279.00	1,406,900
リョーサン	1,800	2,099.00	3,778,200
新光商事	2,200	761.00	1,674,200
トーホー	800	1,523.00	1,218,400
三信電気	900	2,015.00	1,813,500
東陽テクニカ	1,600	1,140.00	1,824,000
モスフードサービス	2,300	3,125.00	7,187,500
加賀電子	1,400	2,867.00	4,013,800
ソーダニッカ	1,500	536.00	804,000

立花エレテック	1,200	1,452.00	1,742,400
フォーバル	600	935.00	561,000
PALTAC	2,600	5,040.00	13,104,000
三谷産業	2,200	377.00	829,400
太平洋興発	700	632.00	442,400
西本Wismettacホールディングス	400	2,602.00	1,040,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,729.00	172,900
コア商事ホールディングス	1,200	637.00	764,400
国際紙パルプ商事	3,600	260.00	936,000
ヤマタネ	700	1,553.00	1,087,100
丸紅建材リース	100	1,912.00	191,200
日鉄物産	1,100	4,470.00	4,917,000
泉州電業	500	3,900.00	1,950,000
トラスコ中山	3,700	2,805.00	10,378,500
オートバックスセブン	5,800	1,543.00	8,949,400
モリト	1,100	602.00	662,200
加藤産業	2,300	3,295.00	7,578,500
北恵	400	970.00	388,000
イノテック	900	1,352.00	1,216,800
イエローハット	3,000	2,035.00	6,105,000
JKホールディングス	1,500	790.00	1,185,000
日伝	1,300	2,198.00	2,857,400
北沢産業	1,400	248.00	347,200
杉本商事	800	2,284.00	1,827,200
因幡電機産業	4,200	2,626.00	11,029,200
東テク	500	2,653.00	1,326,500
ミスミグループ本社	20,200	3,885.00	78,477,000
アルテック	1,300	323.00	419,900
タキヒヨー	600	1,853.00	1,111,800
蔵王産業	300	1,513.00	453,900
スズケン	6,800	3,285.00	22,338,000
ジェコス	1,100	891.00	980,100
グローセル	1,700	436.00	741,200
ローソン	4,100	5,430.00	22,263,000
サンエー	1,200	4,105.00	4,926,000
カワチ薬品	1,100	2,230.00	2,453,000
エービーシー・マート	2,500	6,080.00	15,200,000
ハードオフコーポレーション	700	769.00	538,300
アスクル	2,600	1,722.00	4,477,200
ゲオホールディングス	2,200	1,265.00	2,783,000
アダストリア	2,300	1,884.00	4,333,200
ジーフット	1,300	417.00	542,100

シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	415.00	166,000
くら寿司	2,000	4,005.00	8,010,000
キャンドウ	800	1,853.00	1,482,400
アイケイ	500	679.00	339,500
パルグループホールディングス	1,400	1,783.00	2,496,200
エディオン	6,800	1,105.00	7,514,000
サーラコーポレーション	3,200	594.00	1,900,800
ワッツ	800	877.00	701,600
ハローズ	700	2,785.00	1,949,500
フジオフードグループ本社	1,500	1,311.00	1,966,500
あみやき亭	400	2,850.00	1,140,000
ひらまつ	3,800	187.00	710,600
大黒天物産	500	5,990.00	2,995,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,167.00	1,517,100
ファーマライズホールディングス	400	743.00	297,200
アルペン	1,300	2,995.00	3,893,500
ハブ	700	692.00	484,400
クオールホールディングス	2,200	1,496.00	3,291,200
ジinzホールディングス	1,100	7,250.00	7,975,000
ビックカメラ	9,600	1,116.00	10,713,600
D C Mホールディングス	9,900	1,078.00	10,672,200
Monotaro	22,900	2,592.00	59,356,800
東京一番フーズ	600	595.00	357,000
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,146.00	3,004,400
J.フロント リテイリング	19,300	950.00	18,335,000
ドトール・日レスホールディングス	2,600	1,695.00	4,407,000
マツモトキヨシホールディングス	6,600	5,020.00	33,132,000
ブロンコビリー	900	2,412.00	2,170,800
Z O Z O	9,500	3,390.00	32,205,000
トレジャー・ファクトリー	500	1,017.00	508,500
物語コーポレーション	900	7,170.00	6,453,000
ココカラファイン	1,400	8,440.00	11,816,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,200	776.00	21,883,200
Hamee	400	1,514.00	605,600
マーケットエンタープライズ	100	1,110.00	111,000
ウエルシアホールディングス	8,500	3,455.00	29,367,500
クリエイティブSDホールディングス	2,300	3,485.00	8,015,500
丸善CHIホールディングス	1,900	400.00	760,000
ミサワ	500	677.00	338,500
ティーライフ	300	1,473.00	441,900
シュッピン	1,100	1,042.00	1,146,200
オイシックス・ラ・大地	2,100	4,085.00	8,578,500

ネクステージ	2,800	2,271.00	6,358,800
ジョイフル本田	4,700	1,362.00	6,401,400
鳥貴族ホールディングス	600	1,809.00	1,085,400
ホットランド	1,300	1,287.00	1,673,100
すかいらーくホールディングス	20,600	1,476.00	30,405,600
SFPホールディングス	900	1,468.00	1,321,200
綿半ホールディングス	1,200	1,227.00	1,472,400
ヨシックスホールディングス	300	2,244.00	673,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,600	1,022.00	4,701,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,708.00	1,366,400
B E E N O S	800	3,380.00	2,704,000
あさひ	1,200	1,360.00	1,632,000
日本調剤	1,000	1,683.00	1,683,000
コスモス薬品	1,600	17,890.00	28,624,000
トーエル	800	820.00	656,000
オンリー	400	472.00	188,800
セブン&アイ・ホールディングス	62,900	5,005.00	314,814,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,700	983.00	8,552,100
ツルハホールディングス	3,500	12,720.00	44,520,000
サンマルクホールディングス	1,400	1,574.00	2,203,600
フェリシモ	400	1,525.00	610,000
トリドールホールディングス	4,000	1,890.00	7,560,000
T O K Y O B A S E	1,500	704.00	1,056,000
ウイルプラスホールディングス	300	1,076.00	322,800
J Mホールディングス	1,100	2,063.00	2,269,300
サツドラホールディングス	300	2,002.00	600,600
アレンザホールディングス	1,200	1,297.00	1,556,400
串カツ田中ホールディングス	500	1,736.00	868,000
パロックジャパンリミテッド	1,100	815.00	896,500
クスリのアオキホールディングス	1,600	7,300.00	11,680,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E	9,400	4,300.00	40,420,000
メディカルシステムネットワーク	1,400	752.00	1,052,800
はるやまホールディングス	800	636.00	508,800
ノジマ	2,800	2,815.00	7,882,000
カップ・クリエイト	2,400	1,421.00	3,410,400
ライトオン	1,300	730.00	949,000
良品計画	18,500	2,072.00	38,332,000
三城ホールディングス	2,100	268.00	562,800
アドヴァングループ	1,700	900.00	1,530,000
アルビス	500	2,320.00	1,160,000
コナカ	2,200	343.00	754,600

ハウス オブ ローゼ	300	1,643.00	492,900
G - 7ホールディングス	800	3,470.00	2,776,000
イオン北海道	2,100	992.00	2,083,200
コジマ	2,800	686.00	1,920,800
ヒマラヤ	700	1,047.00	732,900
コーナン商事	2,300	4,315.00	9,924,500
エコス	600	1,856.00	1,113,600
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	32,200	2,368.00	76,249,600
西松屋チェーン	3,500	1,385.00	4,847,500
ゼンショーホールディングス	8,700	2,752.00	23,942,400
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,496.00	1,645,600
ハークスレイ	400	968.00	387,200
サイゼリヤ	2,400	2,655.00	6,372,000
V Tホールディングス	6,100	480.00	2,928,000
魚力	500	2,118.00	1,059,000
フジ・コーポレーション	900	1,200.00	1,080,000
ユナイテッドアローズ	1,900	1,942.00	3,689,800
ハイデイ日高	2,400	1,813.00	4,351,200
京都きもの友禅	1,400	262.00	366,800
コロワイド	5,400	1,964.00	10,605,600
ピーシーデポコーポレーション	1,900	469.00	891,100
壱番屋	1,100	4,850.00	5,335,000
P L A N T	400	712.00	284,800
スギホールディングス	3,200	7,920.00	25,344,000
薬王堂ホールディングス	700	2,254.00	1,577,800
スクロール	2,300	852.00	1,959,600
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,812.00	2,718,000
木曽路	2,200	2,349.00	5,167,800
S R Sホールディングス	2,400	808.00	1,939,200
千趣会	3,000	368.00	1,104,000
リテールパートナーズ	1,900	1,110.00	2,109,000
ケーヨー	3,000	826.00	2,478,000
上新電機	1,800	2,633.00	4,739,400
日本瓦斯	7,800	1,937.00	15,108,600
ロイヤルホールディングス	2,900	1,971.00	5,715,900
東天紅	200	1,141.00	228,200
いなげや	1,800	1,419.00	2,554,200
チヨダ	1,700	875.00	1,487,500
ライフコーポレーション	1,500	3,385.00	5,077,500
リンガーハット	2,100	2,258.00	4,741,800
Mr M a x H D	2,200	651.00	1,432,200
A O K Iホールディングス	3,200	669.00	2,140,800

オークワ	2,500	1,070.00	2,675,000
コメリ	2,500	2,639.00	6,597,500
青山商事	3,700	716.00	2,649,200
しまむら	1,900	10,350.00	19,665,000
はせがわ	1,200	277.00	332,400
高島屋	11,800	1,181.00	13,935,800
松屋	3,600	979.00	3,524,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,700	883.00	6,799,100
近鉄百貨店	600	3,115.00	1,869,000
丸井グループ	13,600	1,974.00	26,846,400
アクシアル リテイリング	1,300	3,715.00	4,829,500
イオン	61,900	2,914.50	180,407,550
イズミ	3,300	3,850.00	12,705,000
平和堂	2,900	2,032.00	5,892,800
フジ	1,900	1,927.00	3,661,300
ヤオコー	1,800	6,440.00	11,592,000
ゼビオホールディングス	1,900	983.00	1,867,700
ケーズホールディングス	13,600	1,260.00	17,136,000
Olympicグループ	800	769.00	615,200
日産東京販売ホールディングス	2,500	246.00	615,000
シルバーライフ	400	1,956.00	782,400
Genky DrugStores	700	4,180.00	2,926,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,108.00	443,200
ブックオフグループホールディングス	1,000	938.00	938,000
ギフト	200	2,335.00	467,000
アインホールディングス	2,300	6,390.00	14,697,000
元気寿司	500	2,496.00	1,248,000
ヤマダホールディングス	53,800	511.00	27,491,800
アークランドサカモト	2,500	1,462.00	3,655,000
ニトリホールディングス	6,400	20,400.00	130,560,000
愛眼	1,500	227.00	340,500
ケーユーホールディングス	800	992.00	793,600
吉野家ホールディングス	5,300	2,056.00	10,896,800
松屋フーズホールディングス	800	3,540.00	2,832,000
サガミホールディングス	2,400	1,013.00	2,431,200
関西スーパーマーケット	1,200	996.00	1,195,200
王将フードサービス	1,000	5,780.00	5,780,000
プレナス	1,800	2,112.00	3,801,600
ミニストップ	1,300	1,401.00	1,821,300
アークス	3,000	2,187.00	6,561,000
バローホールディングス	3,200	2,228.00	7,129,600
藤久	400	710.00	284,000

ベルク	800	4,940.00	3,952,000	
大庄	1,000	996.00	996,000	
ファーストリテイリング	2,200	76,660.00	168,652,000	
サンドラッグ	6,000	3,550.00	21,300,000	
サクスパー ホールディングス	1,400	594.00	831,600	
ヤマザワ	300	1,699.00	509,700	
やまや	300	2,310.00	693,000	
ペルーナ	3,400	926.00	3,148,400	
島根銀行	700	603.00	422,100	
じもとホールディングス	1,200	633.00	759,600	
めぶきフィナンシャルグループ	83,600	234.00	19,562,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,550.00	3,255,000	
九州フィナンシャルグループ	32,800	387.00	12,693,600	
ゆうちょ銀行	45,400	926.00	42,040,400	
富山第一銀行	3,700	271.00	1,002,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	97,800	395.00	38,631,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,600	618.00	6,550,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,405.00	1,967,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,600	2,399.00	6,237,400	
ひろぎんホールディングス	23,600	577.00	13,617,200	
新生銀行	13,100	1,451.00	19,008,100	
あおぞら銀行	9,600	2,466.00	23,673,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,102,400	579.90	639,281,760	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	186,000	417.10	77,580,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	30,500	3,521.00	107,390,500	
三井住友フィナンシャルグループ	111,500	3,712.00	413,888,000	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	53,700	637.00	34,206,900	
群馬銀行	33,100	345.00	11,419,500	
武蔵野銀行	2,400	1,641.00	3,938,400	
千葉興業銀行	4,400	249.00	1,095,600	
筑波銀行	7,300	167.00	1,219,100	
七十七銀行	5,100	1,147.00	5,849,700	
青森銀行	1,300	2,021.00	2,627,300	
秋田銀行	1,000	1,403.00	1,403,000	
山形銀行	1,900	845.00	1,605,500	
岩手銀行	1,100	1,680.00	1,848,000	
東邦銀行	14,900	208.00	3,099,200	
東北銀行	800	998.00	798,400	
みちのく銀行	1,100	923.00	1,015,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,500	1,860.00	26,970,000	
静岡銀行	39,100	825.00	32,257,500	

十六銀行	2,000	1,929.00	3,858,000
スルガ銀行	14,600	329.00	4,803,400
八十二銀行	36,200	352.00	12,742,400
山梨中央銀行	1,900	821.00	1,559,900
大垣共立銀行	3,200	1,848.00	5,913,600
福井銀行	1,400	1,379.00	1,930,600
北國銀行	1,500	2,078.00	3,117,000
清水銀行	700	1,520.00	1,064,000
富山銀行	300	2,160.00	648,000
滋賀銀行	3,200	1,899.00	6,076,800
南都銀行	2,300	1,842.00	4,236,600
百五銀行	14,400	303.00	4,363,200
京都銀行	5,800	4,820.00	27,956,000
紀陽銀行	5,700	1,459.00	8,316,300
ほくほくフィナンシャルグループ	10,700	793.00	8,485,100
山陰合同銀行	10,100	542.00	5,474,200
中国銀行	13,800	841.00	11,605,800
鳥取銀行	500	1,115.00	557,500
伊予銀行	21,200	536.00	11,363,200
百十四銀行	1,700	1,510.00	2,567,000
四国銀行	2,300	703.00	1,616,900
阿波銀行	2,500	1,974.00	4,935,000
大分銀行	1,000	1,677.00	1,677,000
宮崎銀行	1,000	1,988.00	1,988,000
佐賀銀行	900	1,376.00	1,238,400
沖縄銀行	1,500	2,456.00	3,684,000
琉球銀行	3,600	719.00	2,588,400
セブン銀行	54,100	238.00	12,875,800
みずほフィナンシャルグループ	218,900	1,571.00	343,891,900
高知銀行	600	795.00	477,000
山口フィナンシャルグループ	20,000	616.00	12,320,000
長野銀行	500	1,084.00	542,000
名古屋銀行	1,300	2,428.00	3,156,400
北洋銀行	24,300	236.00	5,734,800
愛知銀行	600	2,815.00	1,689,000
中京銀行	600	1,404.00	842,400
大光銀行	600	1,274.00	764,400
愛媛銀行	2,300	754.00	1,734,200
トマト銀行	600	1,032.00	619,200
京葉銀行	6,800	412.00	2,801,600
栃木銀行	8,200	172.00	1,410,400
北日本銀行	500	1,591.00	795,500

東和銀行	3,000	496.00	1,488,000
福島銀行	2,200	237.00	521,400
大東銀行	800	610.00	488,000
トモニホールディングス	12,400	293.00	3,633,200
フィデアホールディングス	16,300	122.00	1,988,600
池田泉州ホールディングス	19,000	158.00	3,002,000
F P G	5,500	748.00	4,114,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,100	1,521.00	1,673,100
マーキュリアホールディングス	700	724.00	506,800
S B Iホールディングス	19,900	2,591.00	51,560,900
ジャフコ グループ	2,300	6,320.00	14,536,000
大和証券グループ本社	120,600	570.10	68,754,060
野村ホールディングス	246,100	555.00	136,585,500
岡三証券グループ	13,800	412.00	5,685,600
丸三証券	4,800	609.00	2,923,200
東洋証券	5,800	154.00	893,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,200	387.00	6,656,400
光世証券	500	574.00	287,000
水戸証券	4,400	294.00	1,293,600
いちよし証券	3,300	595.00	1,963,500
松井証券	7,900	809.00	6,391,100
マネックスグループ	14,500	665.00	9,642,500
極東証券	2,200	803.00	1,766,600
岩井コスモホールディングス	1,700	1,489.00	2,531,300
藍澤證券	2,900	1,026.00	2,975,400
マネーパートナーズグループ	2,400	221.00	530,400
スパークス・グループ	7,500	248.00	1,860,000
かんぽ生命保険	20,000	1,940.00	38,800,000
S O M P Oホールディングス	28,400	4,459.00	126,635,600
アニコム ホールディングス	4,600	865.00	3,979,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	39,100	3,349.00	130,945,900
第一生命ホールディングス	79,300	1,957.50	155,229,750
東京海上ホールディングス	53,100	5,192.00	275,695,200
T & Dホールディングス	48,100	1,384.00	66,570,400
アドバンスクリエイト	800	990.00	792,000
全国保証	4,200	5,060.00	21,252,000
あんしん保証	600	340.00	204,000
ジェイリース	600	1,593.00	955,800
イントラスト	500	669.00	334,500
日本モーゲージサービス	900	1,014.00	912,600
C a s a	500	993.00	496,500
アルヒ	2,400	1,408.00	3,379,200

プレミアグループ	800	3,485.00	2,788,000
クレディセゾン	9,400	1,318.00	12,389,200
芙蓉総合リース	1,700	7,070.00	12,019,000
みずほリース	2,500	3,570.00	8,925,000
東京センチュリー	3,700	5,940.00	21,978,000
日本証券金融	6,800	810.00	5,508,000
アイフル	27,200	358.00	9,737,600
リコーリース	1,300	3,425.00	4,452,500
イオンフィナンシャルサービス	9,900	1,352.00	13,384,800
アコム	32,400	465.00	15,066,000
ジャックス	1,800	2,575.00	4,635,000
オリエントコーポレーション	44,200	144.00	6,364,800
オリックス	97,800	1,887.00	184,548,600
三菱HCキャピタル	55,700	601.00	33,475,700
九州リースサービス	800	650.00	520,000
日本取引所グループ	43,500	2,542.00	110,577,000
イー・ギャランティ	1,900	2,370.00	4,503,000
アサックス	900	688.00	619,200
NECキャピタルソリューション	600	2,158.00	1,294,800
いちご	18,100	338.00	6,117,800
日本駐車場開発	18,100	165.00	2,986,500
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,200.00	1,080,000
SREホールディングス	200	6,740.00	1,348,000
ADワークスグループ	3,900	155.00	604,500
ヒューリック	34,200	1,266.00	43,297,200
三栄建築設計	700	2,002.00	1,401,400
野村不動産ホールディングス	9,300	2,722.00	25,314,600
三重交通グループホールディングス	3,400	466.00	1,584,400
サムティ	2,300	2,227.00	5,122,100
ディア・ライフ	2,100	469.00	984,900
コーセーアールイー	600	647.00	388,200
日本商業開発	1,100	1,711.00	1,882,100
プレサンスコーポレーション	2,600	1,537.00	3,996,200
THEグローバル社	1,300	212.00	275,600
ハウスコム	300	1,217.00	365,100
日本管理センター	900	1,282.00	1,153,800
サンセイランディック	600	864.00	518,400
エストラスト	300	667.00	200,100
フージャースホールディングス	2,800	724.00	2,027,200
オープンハウス	5,100	5,370.00	27,387,000
東急不動産ホールディングス	44,000	632.00	27,808,000
飯田グループホールディングス	13,400	2,653.00	35,550,200

イーランド	300	1,024.00	307,200
ムゲンエステート	1,200	497.00	596,400
ビーロッド	1,000	572.00	572,000
ファーストブラザーズ	300	1,019.00	305,700
ハウストゥ	900	999.00	899,100
シーアールイー	400	1,577.00	630,800
プロパティエージェント	300	2,720.00	816,000
ケイアイスター不動産	500	5,360.00	2,680,000
アグレ都市デザイン	400	970.00	388,000
グッドコムアセット	800	1,455.00	1,164,000
ジェイ・エス・ビー	300	4,100.00	1,230,000
テンポイノベーション	500	893.00	446,500
グローバル・リンク・マネジメント	300	855.00	256,500
フェイスネットワーク	200	1,367.00	273,400
パーク24	8,700	2,036.00	17,713,200
パラカ	400	1,693.00	677,200
三井不動産	73,500	2,658.50	195,399,750
三菱地所	105,900	1,742.00	184,477,800
平和不動産	2,800	3,855.00	10,794,000
東京建物	15,900	1,654.00	26,298,600
ダイビル	4,100	1,410.00	5,781,000
京阪神ビルディング	2,800	1,405.00	3,934,000
住友不動産	36,300	3,701.00	134,346,300
テーオーシー	3,200	651.00	2,083,200
東京楽天地	300	4,080.00	1,224,000
スターツコーポレーション	1,900	2,808.00	5,335,200
フジ住宅	2,000	640.00	1,280,000
空港施設	1,600	573.00	916,800
明和地所	900	611.00	549,900
ゴールドクレスト	1,500	1,662.00	2,493,000
エスリード	600	1,596.00	957,600
日神グループホールディングス	2,400	471.00	1,130,400
日本エスコン	3,000	763.00	2,289,000
タカラレーベン	7,000	341.00	2,387,000
A V A N T I A	900	909.00	818,100
イオンモール	8,200	1,700.00	13,940,000
毎日コムネット	700	738.00	516,600
ファースト住建	700	1,135.00	794,500
カチタス	4,000	3,250.00	13,000,000
トーセイ	2,300	1,158.00	2,663,400
穴吹興産	300	1,970.00	591,000
サンフロンティア不動産	2,000	1,089.00	2,178,000

エフ・ジェー・ネクスト	1,600	1,036.00	1,657,600
インテリックス	500	691.00	345,500
ランドビジネス	800	322.00	257,600
サンネクスタグループ	600	984.00	590,400
グランディハウス	1,200	431.00	517,200
日本空港ビルデング	5,600	4,825.00	27,020,000
明豊ファシリティワークス	800	931.00	744,800
日本工営	900	2,968.00	2,671,200
L I F U L L	4,800	340.00	1,632,000
ミクシィ	3,900	2,744.00	10,701,600
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,826.00	2,008,600
日本M&Aセンター	25,600	3,075.00	78,720,000
メンバーズ	500	3,305.00	1,652,500
中広	300	364.00	109,200
UTグループ	2,300	3,305.00	7,601,500
アイティメディア	500	2,093.00	1,046,500
タケエイ	1,800	1,779.00	3,202,200
E・Jホールディングス	800	1,301.00	1,040,800
夢真ビーネックスグループ	4,100	1,286.00	5,272,600
コシダカホールディングス	4,200	560.00	2,352,000
アルトナー	400	837.00	334,800
パソナグループ	1,700	2,263.00	3,847,100
C D S	400	1,535.00	614,000
リンクアンドモチベーション	2,900	865.00	2,508,500
G C A	2,100	1,093.00	2,295,300
エス・エム・エス	5,300	3,140.00	16,642,000
サニーサイドアップグループ	700	706.00	494,200
パーソルホールディングス	15,600	2,230.00	34,788,000
リニカル	900	951.00	855,900
クックパッド	5,100	243.00	1,239,300
エスクリ	700	458.00	320,600
アイ・ケイ・ケイ	900	675.00	607,500
学情	600	1,237.00	742,200
スタジオアリス	800	2,503.00	2,002,400
シミックホールディングス	900	1,459.00	1,313,100
エプコ	400	872.00	348,800
N J S	400	1,900.00	760,000
総合警備保障	6,200	5,120.00	31,744,000
カカクコム	11,500	3,105.00	35,707,500
アイロムグループ	600	1,924.00	1,154,400
セントケア・ホールディング	1,100	967.00	1,063,700
サイネックス	300	687.00	206,100

ルネサンス	1,100	1,246.00	1,370,600
ディップ	2,400	3,290.00	7,896,000
デジタルホールディングス	1,100	2,261.00	2,487,100
新日本科学	2,000	1,082.00	2,164,000
キャリアデザインセンター	400	1,034.00	413,600
ベネフィット・ワン	5,700	3,490.00	19,893,000
エムスリー	27,500	7,399.00	203,472,500
ツカダ・グローバルホールディング	1,600	346.00	553,600
プラス	300	490.00	147,000
アウトソーシング	8,900	2,130.00	18,957,000
ウェルネット	1,800	518.00	932,400
ワールドホールディングス	500	3,140.00	1,570,000
ディー・エヌ・エー	6,600	2,165.00	14,289,000
博報堂D Yホールディングス	21,700	1,722.00	37,367,400
ぐるなび	2,900	513.00	1,487,700
タカミヤ	2,000	497.00	994,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	1,010.00	1,111,000
ファンコミュニケーションズ	4,400	393.00	1,729,200
ライク	400	2,438.00	975,200
ビジネス・ブレークスルー	700	414.00	289,800
エスプール	4,000	955.00	3,820,000
WDBホールディングス	700	2,983.00	2,088,100
手間いらず	200	6,130.00	1,226,000
ティア	900	476.00	428,400
C D G	100	1,586.00	158,600
アドウェイズ	2,500	784.00	1,960,000
バリューコマース	1,100	3,315.00	3,646,500
インフォマート	15,800	916.00	14,472,800
J Pホールディングス	4,700	266.00	1,250,200
エコナックホールディングス	4,200	86.00	361,200
E P Sホールディングス	2,400	1,798.00	4,315,200
レッグス	400	2,634.00	1,053,600
プレステージ・インターナショナル	5,900	699.00	4,124,100
アミューズ	900	2,339.00	2,105,100
ドリームインキュベータ	500	928.00	464,000
クイック	1,000	1,168.00	1,168,000
T A C	1,000	231.00	231,000
電通グループ	17,600	3,920.00	68,992,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	967.00	773,600
ぴあ	500	3,290.00	1,645,000
イオンファンタジー	600	2,030.00	1,218,000
シーティーエス	1,800	826.00	1,486,800

ネクシィーズグループ	600	899.00	539,400
H.U.グループホールディングス	4,400	2,817.00	12,394,800
アルプス技研	1,400	1,955.00	2,737,000
日本空調サービス	1,600	721.00	1,153,600
オリエンタルランド	16,600	15,305.00	254,063,000
ダスキン	3,600	2,531.00	9,111,600
明光ネットワークジャパン	2,000	581.00	1,162,000
ファルコホールディングス	800	1,673.00	1,338,400
秀英予備校	500	416.00	208,000
ラウンドワン	5,400	1,150.00	6,210,000
リゾートトラスト	7,200	1,792.00	12,902,400
ビー・エム・エル	2,000	3,840.00	7,680,000
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,350.00	3,240,000
リソー教育	8,000	356.00	2,848,000
早稲田アカデミー	700	914.00	639,800
ユー・エス・エス	17,500	1,942.00	33,985,000
東京個別指導学院	1,400	620.00	868,000
サイバーエージェント	38,500	2,222.00	85,547,000
楽天グループ	73,000	1,312.00	95,776,000
クリーク・アンド・リバー社	800	1,628.00	1,302,400
モーニングスター	2,300	463.00	1,064,900
テー・オー・ダブリュー	2,800	320.00	896,000
山田コンサルティンググループ	900	1,159.00	1,043,100
セントラルスポーツ	600	2,366.00	1,419,600
フルキャストホールディングス	1,300	2,239.00	2,910,700
エン・ジャパン	2,800	3,765.00	10,542,000
リソルホールディングス	200	3,920.00	784,000
テクノプロ・ホールディングス	9,300	2,708.00	25,184,400
アトラグループ	500	327.00	163,500
インターワークス	700	408.00	285,600
アイ・アールジャパンホールディングス	600	14,000.00	8,400,000
Keeper 技研	1,000	3,035.00	3,035,000
ファーストロジック	300	779.00	233,700
三機サービス	400	1,113.00	445,200
Gunosy	1,000	751.00	751,000
デザインワン・ジャパン	600	260.00	156,000
イー・ガーディアン	700	2,842.00	1,989,400
リブセンス	1,100	218.00	239,800
ジャパンマテリアル	4,800	1,310.00	6,288,000
ベクトル	2,000	1,049.00	2,098,000
ウチヤマホールディングス	800	358.00	286,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,178.00	1,413,600

キャリアリンク	500	2,014.00	1,007,000
I B J	1,300	1,072.00	1,393,600
アサンテ	600	1,729.00	1,037,400
バリューHR	600	1,624.00	974,400
M & A キャピタルパートナーズ	1,300	5,590.00	7,267,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,408.00	844,800
E R I ホールディングス	500	953.00	476,500
アビスト	200	2,970.00	594,000
シグマクシス	900	2,431.00	2,187,900
ウィルグループ	1,100	991.00	1,090,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	237.00	592,500
メドピア	1,200	4,405.00	5,286,000
レアジョブ	300	1,667.00	500,100
リクルートホールディングス	111,900	5,552.00	621,268,800
エラン	2,200	1,222.00	2,688,400
土木管理総合試験所	900	397.00	357,300
ネットマーケティング	900	411.00	369,900
日本郵政	117,900	921.60	108,656,640
ベルシステム24ホールディングス	2,600	1,716.00	4,461,600
鎌倉新書	1,600	970.00	1,552,000
S M N	300	791.00	237,300
一蔵	300	405.00	121,500
グローバルキッズCOMPANY	300	912.00	273,600
エアトリ	1,000	2,530.00	2,530,000
アトラエ	1,100	2,200.00	2,420,000
ストライク	600	3,840.00	2,304,000
ソラスト	3,800	1,307.00	4,966,600
セラク	500	1,892.00	946,000
インソース	1,500	2,488.00	3,732,000
ベйкаレント・コンサルティング	1,000	37,700.00	37,700,000
Orchestra Holdings	300	2,816.00	844,800
アイモバイル	400	1,644.00	657,600
キャリアインデックス	600	974.00	584,400
MS - Japan	600	1,145.00	687,000
船場	400	841.00	336,400
グレイステクノロジー	1,600	1,446.00	2,313,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	2,460.00	11,070,000
フルテック	200	1,306.00	261,200
ツナググループ・ホールディングス	500	340.00	170,000
GameWith	500	564.00	282,000
ソウルドアウト	400	1,794.00	717,600
MS & Consulting	300	591.00	177,300

ウェルビー	600	1,308.00	784,800
エル・ティー・エス	100	3,905.00	390,500
ミダック	800	4,465.00	3,572,000
日総工産	1,300	830.00	1,079,000
キュービーネットホールディングス	800	1,633.00	1,306,400
R P Aホールディングス	1,900	701.00	1,331,900
スプリックス	400	1,124.00	449,600
マネジメントソリューションズ	800	2,673.00	2,138,400
プロレド・パートナーズ	300	2,976.00	892,800
and factory	500	663.00	331,500
テノ・ホールディングス	200	1,151.00	230,200
フロンティア・マネジメント	400	1,105.00	442,000
ピアラ	100	1,016.00	101,600
コプロ・ホールディングス	200	1,303.00	260,600
ギークス	300	1,648.00	494,400
カーブスホールディングス	4,300	884.00	3,801,200
フォーラムエンジニアリング	1,100	903.00	993,300
ダイレクトマーケティングミックス	900	3,865.00	3,478,500
ポピンズホールディングス	400	4,100.00	1,640,000
L I T A L I C O	600	5,290.00	3,174,000
アドバンテッジリスクマネジメント	900	1,101.00	990,900
リログループ	8,600	2,415.00	20,769,000
東祥	1,000	1,713.00	1,713,000
エイチ・アイ・エス	2,500	2,414.00	6,035,000
ラックランド	500	2,687.00	1,343,500
共立メンテナンス	2,600	3,595.00	9,347,000
イチネンホールディングス	1,600	1,267.00	2,027,200
建設技術研究所	1,000	2,243.00	2,243,000
スペース	1,100	910.00	1,001,000
長大	600	1,930.00	1,158,000
燦ホールディングス	600	1,237.00	742,200
スバル興業	100	8,030.00	803,000
東京テアトル	700	1,247.00	872,900
タナベ経営	300	1,449.00	434,700
ナガワ	500	8,590.00	4,295,000
東京都競馬	1,000	4,485.00	4,485,000
常磐興産	800	1,408.00	1,126,400
カナモト	2,800	2,573.00	7,204,400
西尾レントオール	1,400	3,010.00	4,214,000
アゴーラ ホスピタリティグループ	12,800	25.00	320,000
トランス・コスモス	1,500	3,105.00	4,657,500
乃村工藝社	6,700	843.00	5,648,100

藤田観光	800	2,250.00	1,800,000
KNT-CTホールディングス	900	1,269.00	1,142,100
日本管財	1,600	2,549.00	4,078,400
トーカイ	1,500	2,420.00	3,630,000
セコム	15,400	8,399.00	129,344,600
セントラル警備保障	800	3,035.00	2,428,000
丹青社	3,000	857.00	2,571,000
メイテック	1,900	6,200.00	11,780,000
応用地質	1,800	1,283.00	2,309,400
船井総研ホールディングス	3,200	2,426.00	7,763,200
進学会ホールディングス	600	424.00	254,400
オオバ	1,100	807.00	887,700
いであ	400	1,816.00	726,400
学究社	500	1,353.00	676,500
ベネッセホールディングス	5,700	2,668.00	15,207,600
イオンディライト	1,900	3,605.00	6,849,500
ナック	800	910.00	728,000
ダイセキ	2,600	4,960.00	12,896,000
ステップ	500	1,708.00	854,000
合計	17,190,400		42,776,833,300

(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。

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	9,952,462	2,562,900
コール・ローン	2,473,405,910	1,200,045,994
国債証券	53,849,096,709	29,893,169,504
地方債証券	7,049,448,214	8,278,828,896
特殊債券	56,909,075,798	32,116,828,429
派生商品評価勘定	124,799,827	1,705,824,840

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
未収入金	762,947,158	-
未収利息	453,131,298	228,669,563
前払費用	37,450,253	8,612,020
差入委託証拠金	26,679	27,326
流動資産合計	121,669,334,308	73,434,569,472
資産合計	121,669,334,308	73,434,569,472
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,898,524,115	-
未払解約金	1,001,724,171	203,203,310
未払利息	2,278	914
流動負債合計	2,900,250,564	203,204,224
負債合計	2,900,250,564	203,204,224
純資産の部		
元本等		
元本	85,327,381,496	53,203,722,162
剰余金		
剰余金又は欠損金()	33,441,702,248	20,027,643,086
元本等合計	118,769,083,744	73,231,365,248
純資産合計	118,769,083,744	73,231,365,248
負債純資産合計	121,669,334,308	73,434,569,472

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、地方債証券及び特殊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>
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)

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	78,784,276,148円	85,327,381,496円
	期首からの追加設定元本額	31,150,536,522円	3,384,048,241円
	期首からの一部解約元本額	24,607,431,174円	35,507,707,575円
	元本の内訳		
	円サポート	1,269,670,118円	996,103,939円
	高格付債券ファンド(為替ヘッジ70)毎月分配型	1,134,974,114円	1,426,724,931円
	高格付債券ファンド(為替ヘッジ70)資産成長型	103,055,445円	84,177,587円
	スマート・ラップ・ジャパン(毎月分配型)	346,000,872円	34,061,417円
	スマート・ラップ・ジャパン(1年決算型)	447,085,019円	38,643,024円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム(毎月分配型)	15,688,565円	9,233,698円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム(1年決算型)	23,156,781円	14,424,644円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	74,244,533円	76,702,036円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	14,477,660円	-円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	27,973,645円	26,223,375円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	21,863,186円	-円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	24,413,812円	26,026,264円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	14,391,574円	15,713,078円
	高格付先進国ソブリン債券(円ヘッジ)ファンド(適格機関投資家向け)	24,448,840,443円	21,884,209,956円
	高格付先進国ソブリン債券(円ヘッジ)ファンド(年2回決算型・適格機関投資家向け)	1,148,763,698円	1,145,306,112円
	高格付先進国ソブリンオープン・為替ヘッジあり(適格機関投資家向け)	7,982,462,334円	8,669,673,403円
	P F 先進国ソブリンオープン・為替ヘッジ70(適格機関投資家向け)	1,563,992,200円	1,559,919,406円
	高格付先進国ソブリンファンド 2013-05M(適格機関投資家向け)	2,252,033,279円	2,218,823,560円
	高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2013-07Q(適格機関投資家転売制限付)	76,821,649円	75,532,014円
	高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-09Q(適格機関投資家転売制限付)	2,579,471,734円	779,036,621円
	高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-10Q(適格機関投資家転売制限付)	792,320,288円	426,721,101円
	P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2013-11M(適格機関投資家転売制限付)	1,946,594,372円	1,929,533,941円

		2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在	
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 14-05M(適格機関投資家転売制限付)	20	1,561,918,838円	1,268,197,807円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 14-07(適格機関投資家転売制限付)	20	1,242,367,758円	1,234,101,442円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 14-09Q(適格機関投資家転売制限付)	20	739,416,804円	735,170,594円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 14-09Q-2(適格機関投資家向け)	20	2,515,226,259円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 14-10(適格機関投資家転売制限付)	20	1,046,050,418円	550,631,827円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 14-11Q(適格機関投資家転売制限付)	20	584,328,069円	484,541,228円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 15-02Q(適格機関投資家転売制限付)	20	1,651,327,267円	1,643,645,693円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 15-03Q(適格機関投資家転売制限付)	20	713,651,406円	620,938,268円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 15-04Q(適格機関投資家転売制限付)	20	1,744,729,892円	1,513,531,273円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ80 15-06Q(適格機関投資家向け)	20	2,884,151,990円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 15-09Q(適格機関投資家転売制限付)	20	1,230,412,970円	1,227,337,378円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ90 15-12Q(適格機関投資家向け)	20	3,255,268,907円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ90 16-01Q(適格機関投資家向け)	20	3,252,508,680円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 16-04Q(適格機関投資家転売制限付)	20	2,502,916,926円	2,488,836,545円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ80 16-07Q(適格機関投資家向け)	20	2,838,933,893円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 16-10Q(適格機関投資家向け)	20	2,511,904,273円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ80 17-06Q(適格機関投資家向け)	20	2,904,855,976円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 17-07Q(適格機関投資家向け)	20	2,545,351,930円	-円
P F	先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ90 17-09Q(適格機関投資家向け)	20	3,293,763,919円	-円
	計		85,327,381,496円	53,203,722,162円
2.	受益権の総数		85,327,381,496口	53,203,722,162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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	378,640,500
地方債証券	337,351,535
特殊債証券	557,219,020
合計	1,273,211,055

(2021年 7月19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	141,951,796
地方債証券	91,711,377
特殊債証券	668,656,007
合計	902,319,180

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	116,065,027,072	-	117,838,751,360	1,773,724,288
	米ドル	16,129,714,790	-	16,078,955,000	50,759,790
	加ドル	16,375,268,984	-	16,375,619,520	350,536
	ユーロ	45,587,700,710	-	45,900,329,200	312,628,490
	スウェーデンクローナ	19,042,950,300	-	19,916,700,000	873,749,700
	豪ドル	18,929,392,288	-	19,567,147,640	637,755,352
合計		116,065,027,072	-	117,838,751,360	1,773,724,288

(2021年 7月19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	71,585,615,386	-	69,879,790,546	1,705,824,840
	米ドル	9,891,376,863	-	9,827,014,715	64,362,148
	加ドル	9,509,442,967	-	9,236,685,231	272,757,736
	ユーロ	29,961,331,946	-	29,397,011,460	564,320,486
	スウェーデンクローナ	8,349,879,467	-	8,120,235,250	229,644,217
	豪ドル	13,873,584,143	-	13,298,843,890	574,740,253
	合計	71,585,615,386	-	69,879,790,546	1,705,824,840

(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)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.3919円	1口当たり純資産額	1.3764円
(1万口当たり純資産額)	(13,919円)	(1万口当たり純資産額)	(13,764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	地方債証券	PROVINCE OF ALBERTA-3.3%-28/03/15	35,000,000.00	39,512,424.00	
		PROVINCE OF QUEBEC-2.75%-27/04/12	5,000,000.00	5,469,079.50	
		PROVINCE OF QUEBEC-1.35%-30/05/28	6,000,000.00	5,961,820.50	
	地方債証券小計		46,000,000.00	50,943,324.00 (5,597,652,441)	
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-0.75%- 30/09/23	10,000,000.00	9,509,326.10	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK-2.25%- 29/06/18	18,000,000.00	19,386,603.00	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK-4.375%- 44/01/24	1,300,000.00	1,825,814.64	
		KFW-0.75%-30/09/30	9,600,000.00	9,154,236.09	
	特殊債券小計		38,900,000.00	39,875,979.83 (4,381,572,663)	
	米ドル小計			84,900,000.00	90,819,303.83 (9,979,225,104)
加ドル	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST-2.65%-28/12/15	2,740,000.00	2,960,408.34	
		CANADA HOUSING TRUST-2.1%-29/09/15	8,000,000.00	8,325,432.00	
		CANADA HOUSING TRUST-1.75%-30/06/15	72,500,000.00	73,145,757.50	
		CANADA HOUSING TRUST-1.1%-31/03/15	23,400,000.00	22,142,343.60	
加ドル小計			106,640,000.00	106,573,941.44 (9,267,669,947)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	56,900,000.00	62,296,396.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	15,800,000.00	16,223,103.46	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	90,500,000.00	100,669,485.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	19,900,000.00	22,828,424.30	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	18,600,000.00	25,566,797.40	
ユーロ小計			201,700,000.00	227,584,206.16 (29,515,395,696)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	30,000,000.00	29,839,953.30	
	国債証券小計		30,000,000.00	29,839,953.30 (377,773,808)	
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-3.75%- 32/06/01	305,000,000.00	392,179,705.50	
		NORDIC INVESTMENT BANK-2.94%-31/10/17	132,500,000.00	160,829,083.00	

		OEKB OEST. KONTROLLBANK-1.37%- 28/11/13	60,000,000.00	62,220,978.00	
	特殊債券小計		497,500,000.00	615,229,766.50 (7,788,808,843)	
	スウェーデンコロナ小計		527,500,000.00	645,069,719.80 (8,166,582,651)	
豪ドル	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP-3.0%- 30/02/20	1,000,000.00	1,130,143.90	
		QUEENSLAND TREASURY CORP-1.75%- 31/08/21	1,000,000.00	1,019,754.60	
		TREASURY CORP VICTORIA-1.5%-30/11/20	7,000,000.00	7,007,738.50	
		TREASURY CORP VICTORIA-1.5%-31/09/10	13,800,000.00	13,715,461.89	
		WESTERN AUST TREAS CORP-1.75%- 31/10/22	10,000,000.00	10,227,845.00	
	地方債証券小計		32,800,000.00	33,100,943.89 (2,681,176,455)	
	特殊債券	BNG BANK NV-3.3%-29/04/26	12,000,000.00	13,578,583.20	
		EUROFIMA-3.35%-29/05/21	58,560,000.00	66,079,859.42	
		KOMMUNALBANKEN AS-2.4%-29/11/21	27,990,000.00	29,805,260.66	
		LANDWIRTSCH. RENTENBANK-1.9%-30/01/30	10,000,000.00	10,216,856.00	
		NEDER WATERSCHAPSBANK-3.3%-29/05/02	10,750,000.00	12,156,193.52	
特殊債券小計		119,300,000.00	131,836,752.80 (10,678,776,976)		
豪ドル小計		152,100,000.00	164,937,696.69 (13,359,953,431)		
	合計			70,288,826,829 (70,288,826,829)	

(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	地方債証券 3銘柄	56.1%	8.0%
	特殊債券 4銘柄	43.9%	6.2%
加ドル	特殊債券 4銘柄	100.0%	13.2%
ユーロ	国債証券 5銘柄	100.0%	42.0%

スウェーデンクローナ	国債証券	1銘柄	4.6%	0.5%
	特殊債券	3銘柄	95.4%	11.1%
豪ドル	地方債証券	5銘柄	20.1%	3.8%
	特殊債券	5銘柄	79.9%	15.2%

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。

インデックス マザーファンド リート

貸借対照表

	（単位：円）	
	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	835,518,438	242,953,781
投資証券	19,994,230,260	26,726,552,060
派生商品評価勘定	-	6,297,810
未収配当金	181,631,233	170,747,555
前払金	16,501,760	-
差入委託証拠金	41,846,000	22,572,000
流動資産合計	21,069,727,691	27,169,123,206
資産合計	21,069,727,691	27,169,123,206
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,956,880	-
前受金	-	10,796,370
未払解約金	714,863,189	35,920
未払利息	769	185
流動負債合計	730,820,838	10,832,475
負債合計	730,820,838	10,832,475
純資産の部		
元本等		
元本	18,331,250,932	18,147,264,346
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,007,655,921	9,011,026,385
元本等合計	20,338,906,853	27,158,290,731
純資産合計	20,338,906,853	27,158,290,731
負債純資産合計	21,069,727,691	27,169,123,206

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>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	3,257,212,494円	18,331,250,932円
	期首からの追加設定元本額	30,337,348,567円	14,599,590,736円
	期首からの一部解約元本額	15,263,310,129円	14,783,577,322円
	元本の内訳		
	上場インデックスファンドJリート（東証REIT指数）隔月分配型（ミニ）	7,815,691,493円	9,649,955,563円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	26,934,288円	18,691,609円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	10,874,830円	- 円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	10,117,200円	6,649,933円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	16,129,180円	- 円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	8,856,795円	6,534,241円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	10,919,733円	8,157,751円
	インデックス・Jリート・オープン（適格機関投資家向け）	2,615,966,838円	1,934,888,989円

インデックスファンドJリート 2015-03(適格機関投資家向け)	589,701,397円	163,249,424円
インデックスファンドJリート 2020-01(適格機関投資家向け)	2,114,857,944円	1,412,244,188円
インデックスファンドJリート・分配抑制コース 2020-02(適格機関投資家向け)	2,149,208,732円	1,456,161,749円
インデックスファンドJリート・分配抑制コース 2020-03(適格機関投資家向け)	844,026,432円	166,543,170円
インデックスファンドJリート 2021-05(適格機関投資家向け)	-円	2,290,548,963円
Nikkoam バランスファンド1-B私募 1905(適格機関投資家向け)	1,082,870,600円	-円
Nikkoam バランスファンド3-B私募 2002(適格機関投資家向け)	1,035,095,470円	542,857,703円
Nikkoam バランス・プラス・米国株式モメンタム戦略ファンド1-B私募 2103(適格機関投資家向け)	-円	490,781,063円
計	18,331,250,932円	18,147,264,346円
2. 受益権の総数	18,331,250,932口	18,147,264,346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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	322,310,363
合計	322,310,363

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	46,950,272
合計	46,950,272

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	338,333,760	-	322,420,000	15,913,760
合計		338,333,760	-	322,420,000	15,913,760

(2021年 7月19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	416,784,630	-	423,126,000	6,341,370
合計		416,784,630	-	423,126,000	6,341,370

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.1095円	1口当たり純資産額	1.4966円
(1万口当たり純資産額)	(11,095円)	(1万口当たり純資産額)	(14,966円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	374	57,035,000	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	561	74,613,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	603	99,977,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	790	541,150,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	2,692	445,526,000	
	産業ファンド投資法人 投資証券	3,240	702,108,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,177	830,525,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	1,562	377,535,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,148	567,112,000	
	G L P 投資法人 投資証券	7,396	1,410,417,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,031	381,470,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,623	1,287,976,500	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	349	238,716,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	357	120,666,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	2,325	384,090,000	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,899	356,822,100	
	日本リート投資法人 投資証券	744	333,312,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	14,562	328,809,960	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	6,741	657,921,600	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	507	72,196,800	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	912	271,867,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	489	76,284,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	441	57,594,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	7,411	1,289,514,000	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	401	37,293,000	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,772	543,866,400	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	2,354	150,891,400	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	215	28,724,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	800	475,200,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	370	31,598,000	
投資法人みらい 投資証券	2,475	139,837,500		
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	496	68,844,800		

三菱地所物流リート投資法人 投資証券	576	282,240,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	733	147,992,700	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	351	44,015,400	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	689	88,467,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	889	144,818,100	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,579	1,802,721,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,292	1,574,604,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	11,416	1,307,132,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	4,567	964,550,400	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,427	606,475,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	2,070	326,853,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,537	314,623,900	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	1,591	201,261,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4,901	809,645,200	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	1,638	259,459,200	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	9,583	417,818,800	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	803	406,318,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	1,481	257,990,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,497	510,477,000	
福岡リート投資法人 投資証券	1,185	215,551,500	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	709	549,475,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	1,878	183,856,200	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	485	375,875,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,035	172,741,500	
スターツプロシード投資法人 投資証券	357	89,999,700	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	3,270	1,069,290,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	7,383	479,895,000	
大和証券リビング投資法人 投資証券	2,992	361,732,800	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	2,127	321,177,000	
合計	143,858	26,726,552,060	

(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

「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。

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	241,859	728,817
コール・ローン	722,396	212,124
国債証券	135,497,843	102,703,522
未収入金	615,477	-
未収利息	864,464	733,913
前払費用	103,361	51,086
流動資産合計	138,045,400	104,429,462
資産合計	138,045,400	104,429,462
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	994	-
未払解約金	835,490	-
流動負債合計	836,484	-
負債合計	836,484	-
純資産の部		
元本等		
元本	116,602,050	85,918,557
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,606,866	18,510,905
元本等合計	137,208,916	104,429,462
純資産合計	137,208,916	104,429,462
負債純資産合計	138,045,400	104,429,462

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	167,030,141円	116,602,050円
	期首からの追加設定元本額	13,535,246円	4,693,800円
	期首からの一部解約元本額	63,963,337円	35,377,293円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	41,795,130円	41,044,359円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	11,538,055円	- 円
	インデックスファンド海外先進国債券（適格機関投資家向け）	4,941,299円	4,931,469円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	15,844,535円	14,105,169円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	17,226,544円	- 円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	13,744,480円	13,903,120円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	11,512,007円	11,934,440円
	計	116,602,050円	85,918,557円
2.	受益権の総数	116,602,050口	85,918,557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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日
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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,459,862
合計	5,459,862

(2021年 7月19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	3,053,401
合計	3,053,401

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	597,277	-	598,271	994
	米ドル	353,034	-	353,991	957
	ユーロ	244,243	-	244,280	37
	合計	597,277	-	598,271	994

(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。

(2021年 7月19日現在)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.1767円	1口当たり純資産額	1.2154円
(1万口当たり純資産額)	(11,767円)	(1万口当たり純資産額)	(12,154円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	42,000.00	42,890.85	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	76,000.00	77,925.23	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	84,000.00	88,979.29	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	85,000.00	92,117.08	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	49,000.00	68,777.98	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	4,000.00	4,614.06	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	7,000.00	7,786.95	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	26,000.00	31,308.16	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	13,000.00	11,327.01	
米ドル小計			386,000.00	425,726.61 (46,778,839)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,000.00	2,039.58	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	11,000.00	11,638.88	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	3,000.00	4,418.37	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	3,000.00	4,057.83	
加ドル小計			19,000.00	22,154.66 (1,926,569)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	50,000.00	55,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	60,000.00	66,037.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	20,000.00	22,068.75	
メキシコペソ小計			130,000.00	143,825.00 (792,605)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	8,000.00	11,266.67	

	BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	4,000.00	6,852.42	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,000.00	1,091.86	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	11,000.00	11,853.54	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	12,000.00	16,541.73	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	10,000.00	17,118.14	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	6,000.00	6,343.62	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	9,000.00	9,404.74	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	9,000.00	12,939.98	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	6,000.00	9,491.53	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	5,000.00	8,300.12	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	6,000.00	11,614.48	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	1,000.00	1,307.79	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	7,000.00	7,535.57	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	19,000.00	20,715.43	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	22,000.00	30,611.46	
	BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	10,000.00	16,343.14	
	FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	2,000.00	2,374.33	
	FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	2,000.00	2,284.43	
	FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	22,000.00	22,942.78	
	FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	13,000.00	18,942.78	
	FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	11,000.00	17,930.46	
	FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	9,000.00	15,968.25	
	FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	2,000.00	3,927.65	
	IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	3,000.00	3,322.33	
	IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	3,000.00	3,636.90	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	7,000.00	7,258.66	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	2,000.00	2,627.82	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	3,000.00	5,265.97	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,000.00	1,055.05	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	7,000.00	11,373.61	
ユーロ小計		233,000.00	318,243.24 (41,272,965)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.75%-22/09/07	5,000.00	5,094.06

		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	6,000.00	8,250.34
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	5,000.00	7,819.56
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	2,000.00	2,992.82
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	2,000.00	3,535.76
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	3,000.00	5,728.89
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	6,000.00	6,427.82
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	3,000.00	4,572.75
英ボンド小計			32,000.00	44,422.00 (6,713,496)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	20,000.00	21,216.40
スウェーデンクローナ小計			20,000.00	21,216.40 (268,599)
ノルウェーク ローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	9,000.00	9,223.07
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	15,000.00	15,858.00
ノルウェークローネ小計			24,000.00	25,081.07 (310,252)
デンマークク ローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	10,000.00	10,982.91
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,000.00	17,947.54
デンマーククローネ小計			20,000.00	28,930.45 (504,547)
ポーランドズ ロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,000.00	2,135.20
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	18,000.00	19,154.16
ポーランドズロチ小計			20,000.00	21,289.36 (602,133)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	3,000.00	3,089.83
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	8,000.00	8,944.50
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	11,000.00	14,777.85
豪ドル小計			22,000.00	26,812.18 (2,171,786)
シンガポールド ドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	3,000.00	3,225.60
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	2,000.00	2,304.00
シンガポールドドル小計			5,000.00	5,529.60 (447,344)
マレーシアリン ギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	11,000.00	11,857.21
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	9,000.00	9,122.07
マレーシアリングット小計			20,000.00	20,979.28 (547,443)
イスラエルシ ュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	10,000.00	10,984.84
			10,000.00	10,984.84

イスラエルシェケル小計		(366,944)	
合計		102,703,522	(102,703,522)

(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 9銘柄	100.0%	45.5%
加ドル	国債証券 4銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 31銘柄	100.0%	40.2%
英ポンド	国債証券 8銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 3銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 2銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 2銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 1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

該当事項はありません。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,649,190	9,320,578
コール・ローン	94,070,893	88,487,353
株式	11,404,452,695	11,725,891,735
派生商品評価勘定	52,175	-
未収入金	67,444,649	15,224,117
未収配当金	53,563,109	45,330,842

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
流動資産合計	11,624,232,711	11,884,254,625
資産合計	11,624,232,711	11,884,254,625
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,631
未払解約金	96,534,035	31,264,071
未払利息	86	67
流動負債合計	96,534,121	31,266,769
負債合計	96,534,121	31,266,769
純資産の部		
元本等		
元本	10,799,135,623	8,973,539,554
剰余金		
剰余金又は欠損金()	728,562,967	2,879,448,302
元本等合計	11,527,698,590	11,852,987,856
純資産合計	11,527,698,590	11,852,987,856
負債純資産合計	11,624,232,711	11,884,254,625

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>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)

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1. 期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
期首元本額	13,495,667,757円	10,799,135,623円

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
期首からの追加設定元本額	223,950,030円	650,136,539円
期首からの一部解約元本額	2,920,482,164円	2,475,732,608円
元本の内訳		
スマート・ラップ・グローバル・インカム(毎月分配型)	30,134,499円	20,582,861円
スマート・ラップ・グローバル・インカム(1年決算型)	44,721,390円	32,914,391円
先進国資本エマージング株式ファンド(1年決算型)	8,738,703,155円	7,195,916,822円
先進国資本エマージング株式ファンド(年2回決算型)	27,755,013円	17,583,243円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	5,286,414円	4,009,959円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	2,877,660円	-円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	2,004,232円	1,442,372円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	4,273,150円	-円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	1,738,588円	1,386,712円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	2,769,818円	2,352,845円
グローバル・メガピース	1,938,871,704円	1,697,350,349円
計	10,799,135,623円	8,973,539,554円
2. 受益権の総数	10,799,135,623口	8,973,539,554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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日
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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	378,101,505
合計	378,101,505

(2021年 7月19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	89,490,592
合計	89,490,592

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	30,421,375	-	30,369,200	52,175
	南アフリカランド	8,188,960	-	8,140,700	48,260
	香港・オフショア 人民元	22,232,415	-	22,228,500	3,915
	合計	30,421,375	-	30,369,200	52,175

(2021年 7月19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	5,060,061	-	5,062,692	2,631
	ポーランドズロチ	5,060,061	-	5,062,692	2,631
	合計	5,060,061	-	5,062,692	2,631

(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)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.0675円	1口当たり純資産額	1.3209円
(1万口当たり純資産額)	(10,675円)	(1万口当たり純資産額)	(13,209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	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	3,000	208.40	625,200.00	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	91,581	7.51	687,773.31	
	VALE SA-SP ADR	41,100	22.07	907,077.00	
	51JOB INC-ADR	19,100	78.03	1,490,373.00	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	11,900	32.45	386,155.00	
	JD.COM INC-ADR	19,900	75.59	1,504,241.00	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	26,000	30.22	785,720.00	
	AMBEV SA-ADR	754,100	3.39	2,556,399.00	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	63,335	17.83	1,129,263.05	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	195,000	3.75	731,250.00	
	TELEFONICA BRASIL-ADR	345,600	8.10	2,799,360.00	
	TIM SA-ADR	236,946	11.62	2,753,312.52	
	ENEL AMERICAS SA-ADR	198,354	7.11	1,410,296.94	
	ENEL CHILE SA-ADR	435,000	2.73	1,187,550.00	
		2,440,916		18,953,970.82	

米ドル小計				(2,082,662,313)
メキシコペソ	WALMART DE MEXICO -SER V	748,900	65.88	49,337,532.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	938,500	33.20	31,158,200.00
メキシコペソ小計		1,687,400		80,495,732.00 (443,603,929)
ブラジルリアル	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	664,000	20.65	13,711,600.00
	BANCO BRADESCO S.A.	206,300	21.07	4,346,741.00
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	256,750	39.68	10,187,840.00
ブラジルリアル小計		1,127,050		28,246,181.00 (606,759,038)
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	74,900	14.66	1,098,034.00
ユーロ小計		74,900		1,098,034.00 (142,404,029)
トルコリラ	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	42,684	171.80	7,333,111.20
	TURKIYE GARANTI BANKASI	1,091,050	8.35	9,110,267.50
トルコリラ小計		1,133,734		16,443,378.70 (211,940,352)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	69,900	773.00	54,032,700.00
チェココルナ小計		69,900		54,032,700.00 (274,405,066)
ポーランドズロチ	SANTANDER BANK POLSKA SA	25,875	240.00	6,210,000.00
	ORANGE POLSKA SA	763,000	7.43	5,669,090.00
ポーランドズロチ小計		788,875		11,879,090.00 (335,979,866)
香港ドル	BYD CO LTD-H	33,000	212.40	7,009,200.00
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	32,000	209.40	6,700,800.00
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	83,000	76.30	6,332,900.00
	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	580,000	20.55	11,919,000.00
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	89,000	68.60	6,105,400.00
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,531,500	4.80	7,351,200.00
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,155,000	4.66	10,042,300.00
	CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	755,000	2.89	2,181,950.00
香港ドル小計		5,258,500		57,642,750.00 (815,644,912)
マレーシアリンギット	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	43,100	133.40	5,749,540.00
	IHH HEALTHCARE BHD	1,063,000	5.69	6,048,470.00

マレーシアリングット小計		1,106,100		11,798,010.00 (307,863,171)	
タイパーツ	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	290,500	170.50	49,530,250.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	272,000	64.50	17,544,000.00	
タイパーツ小計		562,500		67,074,250.00 (224,027,995)	
インドネシアルピア	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,593,000	10,700.00	17,045,100,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	7,175,000	4,880.00	35,014,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	7,120,000	5,150.00	36,668,000,000.00	
インドネシアルピア小計		15,888,000		88,727,100,000.00 (674,325,960)	
韓国ウォン	POSCO	3,700	341,000.00	1,261,700,000.00	
	S1 CORPORATION	10,987	82,800.00	909,723,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	29,616	38,750.00	1,147,620,000.00	
韓国ウォン小計		44,303		3,319,043,600.00 (318,628,185)	
台湾ドル	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	13,000	605.00	7,865,000.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	150,840	221.00	33,335,640.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	22,000	485.00	10,670,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	291,000	112.50	32,737,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	94,000	390.00	36,660,000.00	
台湾ドル小計		570,840		121,268,140.00 (476,219,985)	
インドルピー	ACC LTD	56,400	2,129.35	120,095,340.00	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	397,192	383.05	152,144,395.60	
	JSW STEEL LTD	41,298	703.60	29,057,272.80	
	SIEMENS LTD	73,700	2,013.30	148,380,210.00	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	25,578	7,303.55	186,810,201.90	
	ITC LTD	274,706	207.90	57,111,377.40	
	NESTLE INDIA LIMITED	10,968	17,654.20	193,631,265.60	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	60,500	1,745.60	105,608,800.00	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	82,215	2,417.40	198,746,541.00	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	35,200	1,749.50	61,582,400.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	95,000	698.00	66,310,000.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	198,000	627.05	124,155,900.00	
BHARTI AIRTEL LTD	171,136	541.15	92,610,246.40		

	INDUS TOWERS LTD	499,000	240.90	120,209,100.00	
インドルピー小計		2,020,893		1,656,453,050.70 (2,451,550,515)	
南アフリカランド	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	16,700	1,682.83	28,103,261.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	41,607	703.64	29,276,349.48	
	MULTICHOICE GROUP LTD	28,000	116.00	3,248,000.00	
	ABSA GROUP LTD	40,000	131.74	5,269,600.00	
	VODACOM GROUP LTD	181,662	129.47	23,519,779.14	
南アフリカランド小計		307,969		89,416,989.62 (680,463,291)	
香港・オフショア 人民元	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	201,000	16.79	3,374,790.00	
	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	232,524	58.40	13,579,401.60	
	CHONGQING BREWERY CO-A	76,000	199.10	15,131,600.00	
	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	474,531	29.88	14,178,986.28	
	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	113,290	145.88	16,526,745.20	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	222,934	80.60	17,968,480.40	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	569,714	4.55	2,592,198.70	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	244,892	13.25	3,244,819.00	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	285,421	10.22	2,917,002.62	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	105,272	37.05	3,900,327.60	
香港・オフショア人民元小計		2,525,578		93,414,351.40 (1,583,242,476)	
サウジアラビア リアル	SAUDI BRITISH BANK	108,000	30.35	3,277,800.00	
サウジアラビアリアル小計		108,000		3,277,800.00 (96,170,652)	
合 計		35,715,458		11,725,891,735 (11,725,891,735)	

(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

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 14銘柄	100.0%	17.8%
メキシコペソ	株式 2銘柄	100.0%	3.8%
ブラジルリアル	株式 3銘柄	100.0%	5.2%
ユーロ	株式 1銘柄	100.0%	1.2%
トルコリラ	株式 2銘柄	100.0%	1.8%
チェココルナ	株式 1銘柄	100.0%	2.3%
ポーランドズロチ	株式 2銘柄	100.0%	2.9%
香港ドル	株式 8銘柄	100.0%	7.0%
マレーシアリングット	株式 2銘柄	100.0%	2.6%
タイバーツ	株式 2銘柄	100.0%	1.9%
インドネシアルピア	株式 3銘柄	100.0%	5.8%
韓国ウォン	株式 3銘柄	100.0%	2.7%
台湾ドル	株式 5銘柄	100.0%	4.1%
インドルピー	株式 14銘柄	100.0%	20.8%
南アフリカランド	株式 5銘柄	100.0%	5.8%
香港・オフショア人民元	株式 10銘柄	100.0%	13.5%
サウジアラビアリアル	株式 1銘柄	100.0%	0.8%

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。

インデックス マザーファンド コモディティ

貸借対照表

（単位：円）

2020年 7月17日現在

2021年 7月19日現在

資産の部
流動資産

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19日現在
預金	344	15,089
コール・ローン	155,488	46,631
投資信託受益証券	11,322,729	11,046,925
未収入金	45,255	-
流動資産合計	11,523,816	11,108,645
資産合計	11,523,816	11,108,645
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6	-
未払解約金	113,240	-
流動負債合計	113,246	-
負債合計	113,246	-
純資産の部		
元本等		
元本	15,522,060	10,798,976
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,111,490	309,669
元本等合計	11,410,570	11,108,645
純資産合計	11,410,570	11,108,645
負債純資産合計	11,523,816	11,108,645

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>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
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 7月17日現在	2021年 7月19日現在
1.	期首	2019年 7月18日	2020年 7月18日
	期首元本額	14,940,087円	15,522,060円
	期首からの追加設定元本額	3,525,993円	6,807,885円
	期首からの一部解約元本額	2,944,020円	11,530,969円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	4,714,971円	5,055,727円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	2,149,327円	- 円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	1,787,514円	1,734,822円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	3,201,512円	- 円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	1,550,595円	1,732,107円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	2,118,141円	2,276,320円
	計	15,522,060円	10,798,976円
2.	受益権の総数	15,522,060口	10,798,976口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	4,111,490円	- 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 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19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

	自 2019年 7月18日 至 2020年 7月17日	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日
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

	2020年 7月17日現在	2021年 7月19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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年 7月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,148,042
合計	2,148,042

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,815,456
合計	2,815,456

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2020年 7月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	45,185	-	45,191	6
	ユーロ	45,185	-	45,191	6
	合計	45,185	-	45,191	6

(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。

(2021年 7月19日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年 7月17日現在		2021年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	0.7351円	1口当たり純資産額	1.0287円
(1万口当たり純資産額)	(7,351円)	(1万口当たり純資産額)	(10,287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
ユーロ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	4,195	85,179.47	
ユーロ小計			4,195	85,179.47 (11,046,925)	
合計				11,046,925 (11,046,925)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	100.0%	100.0%

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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 7月30日現在です。

【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08】

【純資産額計算書】

資産総額	357,436,501円
負債総額	108,869円
純資産総額(-)	357,327,632円
発行済口数	288,892,359口
1口当たり純資産額(/)	1.2369円

(参考)

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)

純資産額計算書

資産総額	116,615,772円
負債総額	126,507円
純資産総額(-)	116,489,265円
発行済口数	54,358,794口
1口当たり純資産額(/)	2.1430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	245,544,160,633円
負債総額	242,125,594円
純資産総額(-)	245,302,035,039円
発行済口数	63,679,003,752口
1口当たり純資産額(/)	3.8522円

インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)

純資産額計算書

資産総額	45,448,942円
負債総額	39,646円
純資産総額（ - ）	45,409,296円
発行済口数	31,977,299口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4200円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	77,022,978,808円
負債総額	17円
純資産総額（ - ）	77,022,978,791円
発行済口数	29,567,193,114口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6050円

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	10,729,624円
負債総額	9,706円
純資産総額（ - ）	10,719,918円
発行済口数	9,085,632口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1799円

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	6,864,627,809円
負債総額	27円
純資産総額（ - ）	6,864,627,782円
発行済口数	5,024,811,575口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3661円

FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

純資産額計算書

資産総額	3,058,307,146円
負債総額	5,309,353円
純資産総額(-)	3,052,997,793円
発行済口数	2,366,911,334口
1口当たり純資産額(/)	1.2899円

ゴールド・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	150,986,583,332円
負債総額	85,494,651円
純資産総額(-)	150,901,088,681円
発行済口数	118,945,920,764口
1口当たり純資産額(/)	1.2687円

インデックス マザーファンド TOPIX

純資産額計算書

資産総額	42,911,866,825円
負債総額	187,089,718円
純資産総額(-)	42,724,777,107円
発行済口数	17,197,713,034口
1口当たり純資産額(/)	2.4843円

ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	73,364,360,727円
負債総額	211,345,707円
純資産総額(-)	73,153,015,020円
発行済口数	52,748,547,897口
1口当たり純資産額(/)	1.3868円

インデックス マザーファンド Jリート

純資産額計算書

資産総額	30,381,672,626円
負債総額	323,214,417円
純資産総額（ - ）	30,058,458,209円
発行済口数	19,980,781,342口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5044円

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

純資産額計算書

資産総額	104,887,886円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	104,887,886円
発行済口数	85,834,984口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2220円

先進国資本エマージング株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	11,495,013,609円
負債総額	30,128,964円
純資産総額（ - ）	11,464,884,645円
発行済口数	8,913,555,724口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2862円

インデックス マザーファンド コモディティ

純資産額計算書

資産総額	11,333,543円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	11,333,543円
発行済口数	10,786,952口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0507円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券

から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年7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7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7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7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	861	259,519
株式投資信託	792	224,510
単位型	285	11,138
追加型	507	213,371
公社債投資信託	69	35,008
単位型	56	2,188
追加型	13	32,820

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				
			4,620	-	273
			862	-	57
			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 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ス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
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。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2021年3月末現在)

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

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
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。

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
-----	-----------------------	-------

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。
--------------	------------	---

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) 投資顧問会社

投資対象とする別に定める投資信託証券のうち、各投資信託証券（マザーファンドを含みます。）への投資比率についての投資助言を行いません。

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。

(3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年10月16日	有価証券報告書
2021年 4月16日	半期報告書

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

2021年8月25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」に掲げられている時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08の2020年7月18日から2021年7月19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、時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08の2021年7月19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、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、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。