

**【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）2016-11    |
| 【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<br>(収益の源泉) |
|-------------|--------|-------------------|
| 単位型投信       | 国内     | 株式<br>債券          |
|             | 海外     | 不動産投信             |
| 追加型投信       | 内外     | その他資産<br>( )      |
|             |        | 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<br>一般  | 年1回        | グローバル<br>(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<br>( )  | (毎月)       | オセアニア           |                  |         |
|   | 日々         |                 |                  |         |
| 不動産投信   |            | 中南米             | ファンド・オブ・<br>ファンズ | なし      |
| その他資産<br>( )  | その他<br>( ) | アフリカ            |                  |         |
|   |            | 中近東<br>(中東)     |                  |         |
| 資産複合<br>(その他資産(投資<br>信託証券(株式、<br>債券、不動産投<br>信、その他資産<br>(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1万口当たり償還価額が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9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。

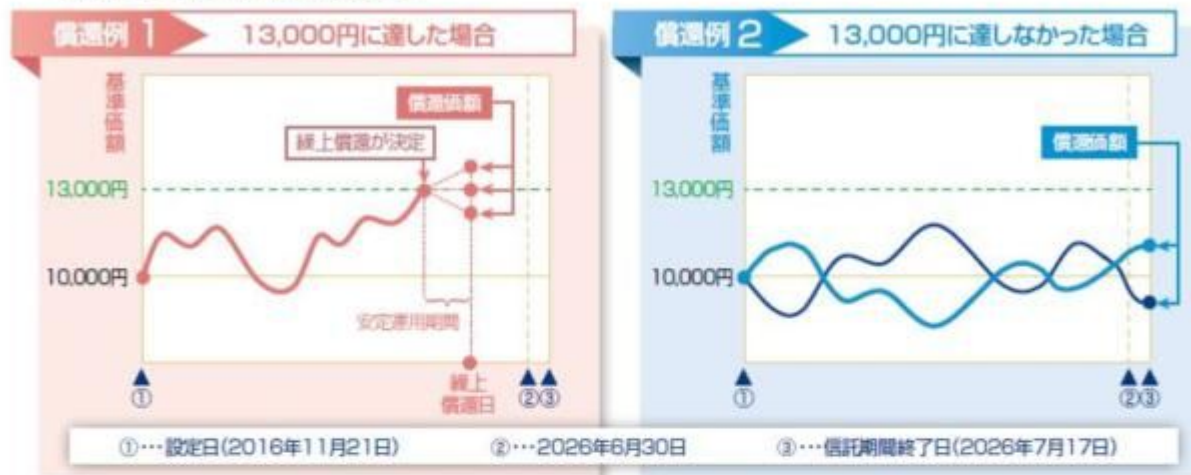
※低リスク資産は、内外のソブリン債を投資対象とし、外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行なうことに伴い、為替ヘッジコストがかかります。

※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。

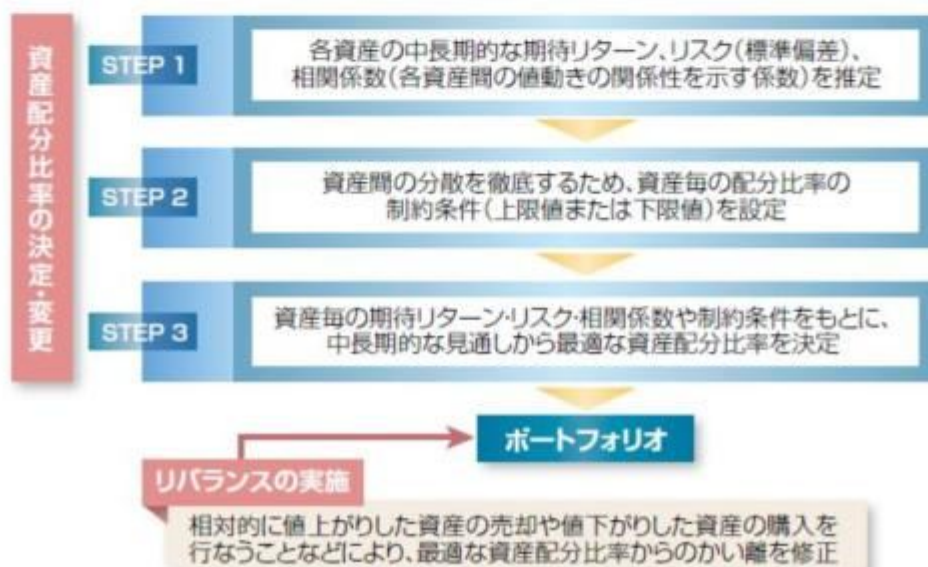


※上記は繰上償還について説明するためのイメージ図です。

- ※ 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1万口当たり償還価額が13,000円を下回る場合があります。

## 資産配分の決定プロセス

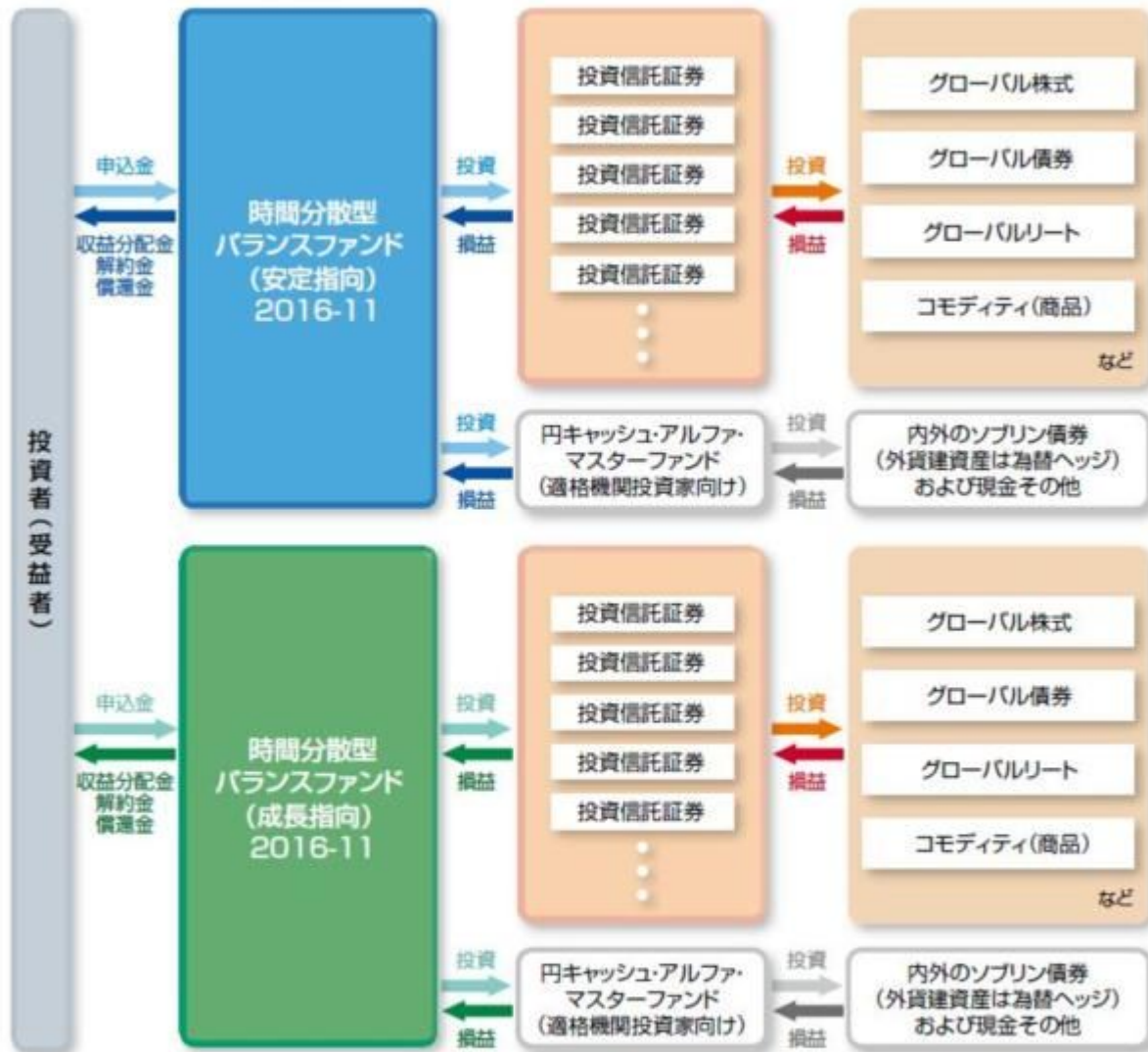
- 当ファンドにおいて、世界の資産への分散投資における資産配分比率の決定および変更は、年金運用などで豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行ないます。



- ※ 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9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<br>(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<br>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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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】

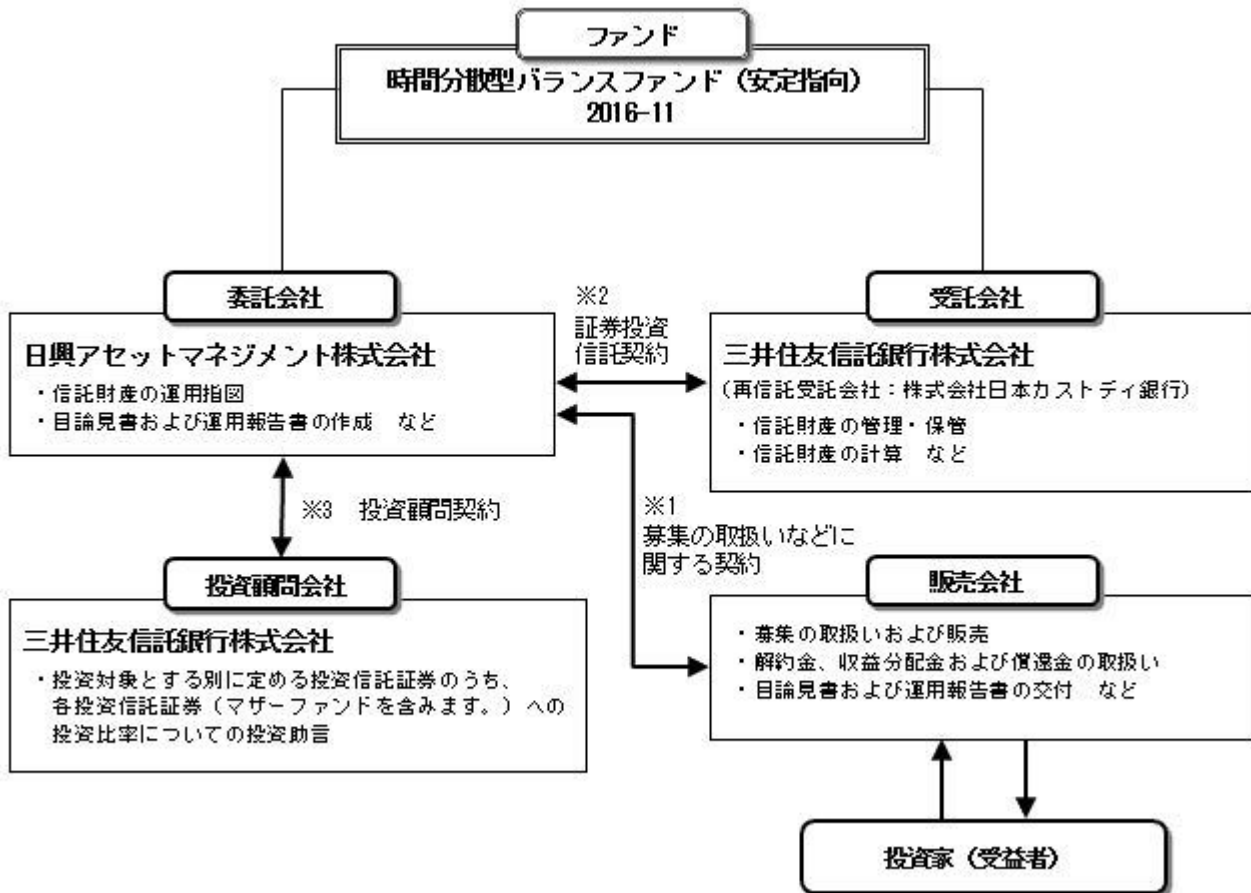
2016年11月21日

- ・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

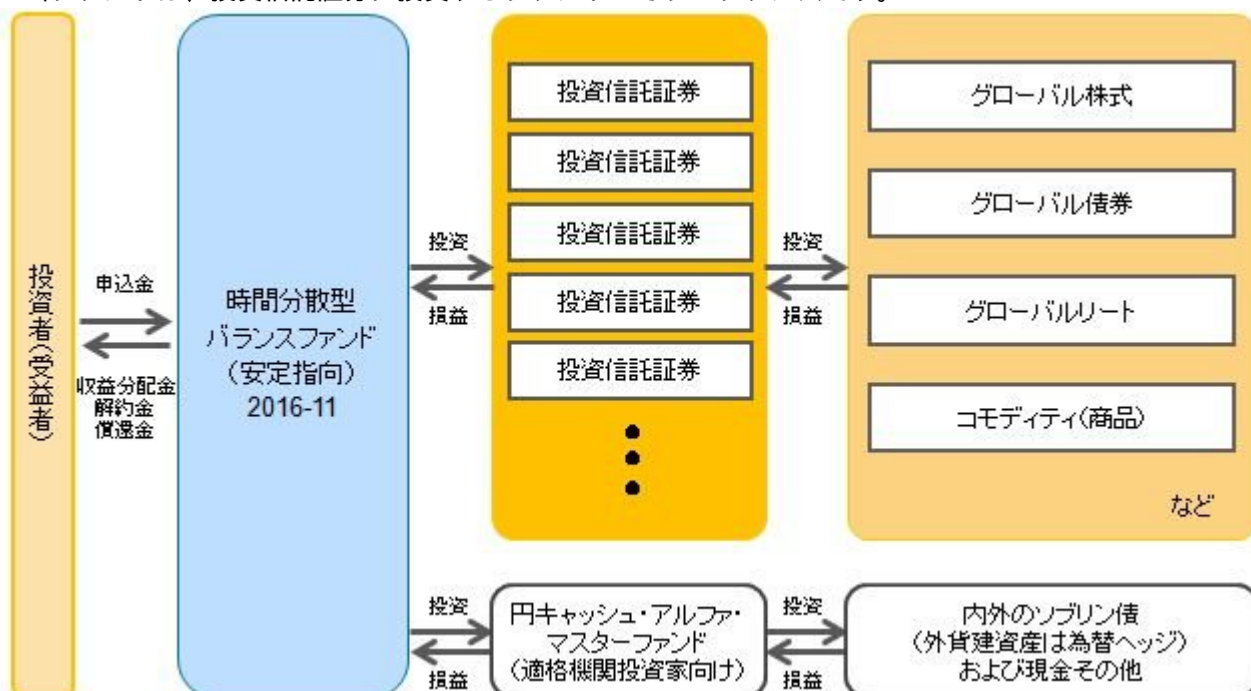




- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、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ないます。
- ・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%

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 … 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5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8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、適宜見直しを行ないます。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） <sup>*</sup> 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。<br>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"> <li>・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、「バークレイ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。<br/>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。<br/>資金の流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。<br/>株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul> |

|                  |  |
|------------------|--|
| 主な投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配             | 収益分配は行ないません。   |
| <b>ファンドに係る費用</b> |  |
| 信託報酬             | ありません。   |
| 申込手数料            | ありません。   |
| 信託財産留保額          | 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。<br>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。  |
| <b>その他</b>       |  |
| 委託会社             | 日興アセットマネジメント株式会社   |
| 受託会社             | 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>

|                |   |
|----------------|---|
| <b>運用の基本方針</b> |   |
| 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>                                    |
| 主な投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配             | 収益分配は行ないません。  |
| <b>ファンドに係る費用</b> |   |
| 信託報酬             | ありません。  |
| 申込手数料            | ありません。  |
| 信託財産留保額          | 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。<br>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。   |
| <b>その他</b>       |   |
| 委託会社             | 日興アセットマネジメント株式会社  |
| 受託会社             | 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul> |
| 主な投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券（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。</li> <li>・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。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>   |
| 収益分配             | 収益分配は行ないません。   |
| <b>ファンドに係る費用</b> |  |
| 信託報酬             | ありません。   |
| 申込手数料            | ありません。   |
| 信託財産留保額          | 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。<br>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。  |
| <b>その他</b>       |  |
| 委託会社             | 日興アセットマネジメント株式会社   |
| 受託会社             | 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） |

## &lt; インデックス マザーファンド 海外先進国債券 &gt;

| 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"> <li>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。</li> <li>運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引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。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul>   |
| 主な投資制限    | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配      | 収益分配は行ないません。   |
| 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。<br>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） |

## &lt;先進国資本エマージング株式マザーファンド&gt;

| 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>ただし、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。</li> </ul>  |
| 主な投資制限    | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券（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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配      | 収益分配は行ないません。   |
| 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。<br>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）        |

## &lt; インデックス マザーファンド コモディティ &gt;

| 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul>  |
| 主な投資制限    | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配      | 収益分配は行ないません。   |
| 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。<br>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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul>  |
| 主な投資制限    | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配      | 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"> <li>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</li> <li>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。）</li> </ul>  |
| 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p> |
| <b>その他</b> |   |
| 委託会社       | 日興アセットマネジメント株式会社  |
| 受託会社       | 野村信託銀行株式会社  |
| 信託期間       | 無期限（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＞

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

|          |  |
|----------|--|
| 信託財産留保額  | 解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）   |
| その他の費用など | 組入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。<br>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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul>   |
| 主な投資制限  | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券（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。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配    | 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"> <li>・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</li> <li>・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。）</li> </ul>                   |
| 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p> |
| <b>その他</b> |  |
| 委託会社       | 日興アセットマネジメント株式会社   |
| 受託会社       | 野村信託銀行株式会社   |
| 信託期間       | 無期限（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＞

|                |  |
|----------------|--|
| <b>運用の基本方針</b> |  |
| 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） <sup>*</sup> 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"> <li>・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 &amp; 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。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul> |

|        |  |
|--------|--|
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配   | 収益分配は行ないません。   |

### ファンドに係る費用

|          |  |
|----------|--|
| 信託報酬     | ありません。   |
| 申込手数料    | ありません。   |
| 信託財産留保額  | 解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）   |
| その他の費用など | 組入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。<br>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）>

|                |   |
|----------------|---|
| <b>運用の基本方針</b> |   |
| 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul> |

|                  |   |
|------------------|---|
| 主な投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配             | 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。   |
| <b>ファンドに係る費用</b> |   |
| 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"> <li>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</li> <li>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。）</li> </ul>  |
| 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>  |
| <b>その他</b>       |   |
| 委託会社             | 日興アセットマネジメント株式会社  |
| 受託会社             | 野村信託銀行株式会社  |
| 信託期間             | 無期限（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＞

|                |  |
|----------------|--|
| <b>運用の基本方針</b> |  |
| 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） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 |
| 主な投資対象         | 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"> <li>・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。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券、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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>   |
| 収益分配   | 収益分配は行ないません。  |

#### 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。<br>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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul>  |
| 主な投資制限           | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配             | 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。  |
| <b>ファンドに係る費用</b> |  |
| 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"> <li>・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</li> <li>・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。）</li> </ul>   |
| 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>  |
| <b>その他</b>       |  |
| 委託会社             | 日興アセットマネジメント株式会社   |
| 受託会社             | 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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。</li> </ul>  |
| 主な投資制限    | <ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul> |
| 収益分配      | 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"> <li>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</li> <li>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。）</li> </ul>  |
| 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p> |
| <b>その他</b> |   |
| 委託会社       | 日興アセットマネジメント株式会社  |
| 受託会社       | 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＞

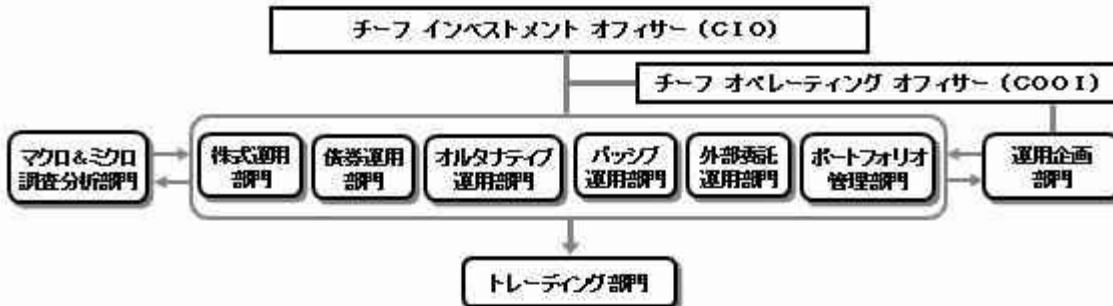
|                  |  |
|------------------|--|
| <b>運用の基本方針</b>   |  |
| 基本方針             | 主に金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。   |
| 主な投資対象           | 金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券を主要投資対象とします。  |
| 投資方針             | <ul style="list-style-type: none"> <li>主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託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

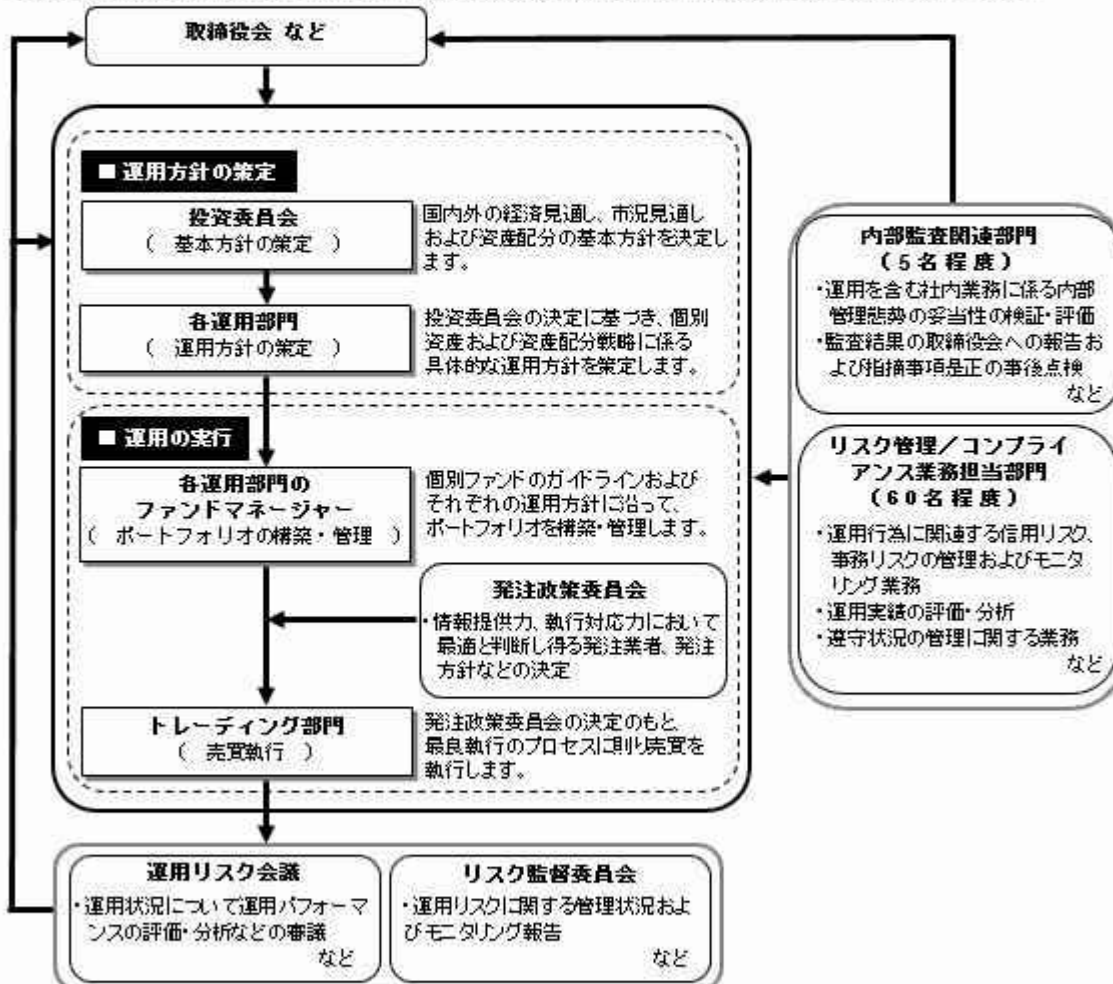
## (3) 【運用体制】

<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

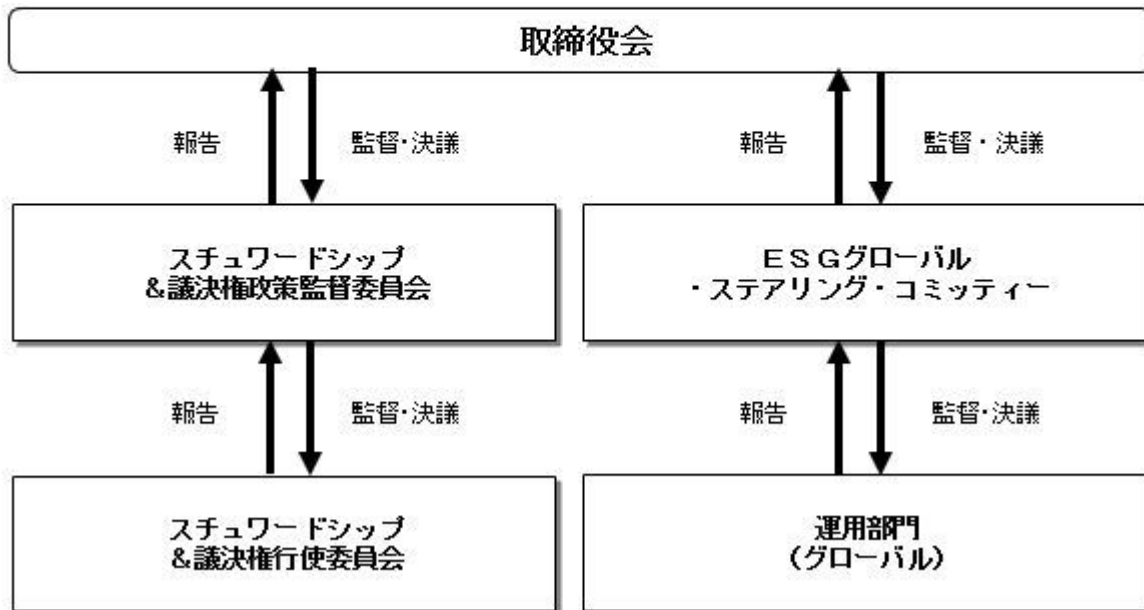
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「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か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

## &lt;分配金再投資コース&gt;

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。

## &lt;分配金受取りコース&gt;

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。

- ・ 投資者の皆様は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）の皆様へ帰属します。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 >

- ・1万円当たり基準価額が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

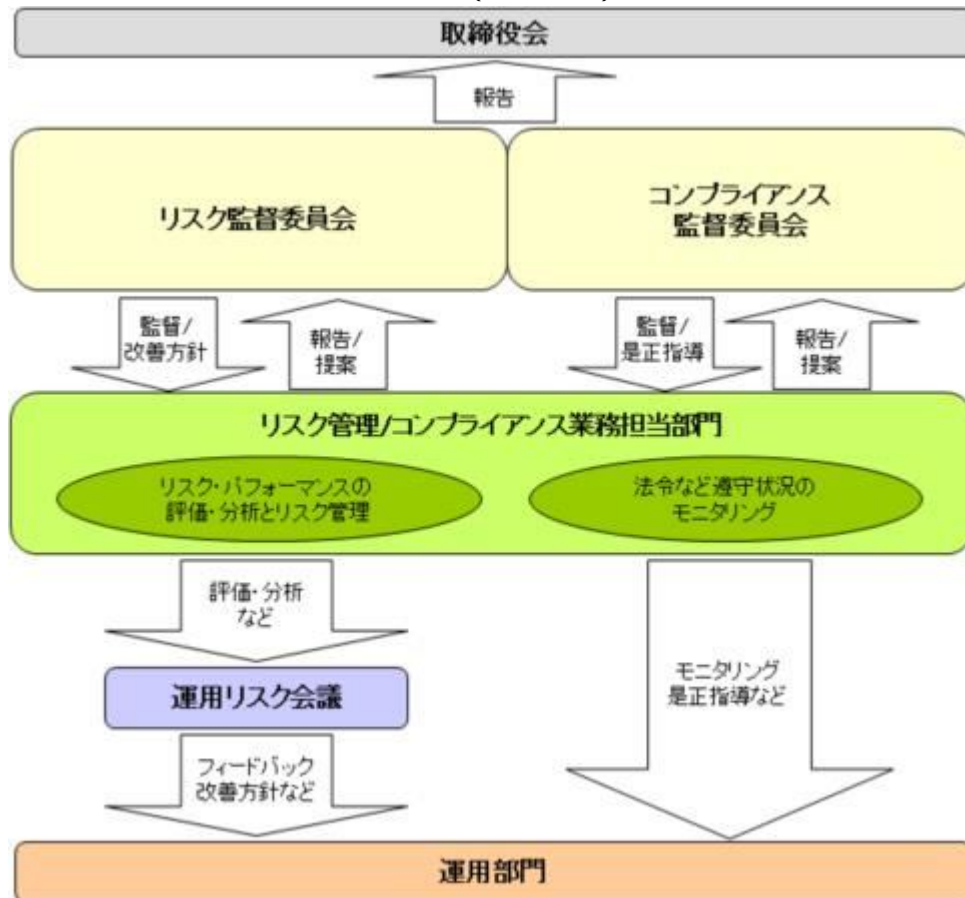
響を及ぼす可能性があります。

- ・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 <sup>*1</sup> |
| 実質的負担               | 1.012%（税抜0.92%）以内 <sup>*2</sup> |

・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<sup>\*1</sup>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<sup>\*2</sup>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。

組入る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 TOPIX」

「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)<sup>\*</sup>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

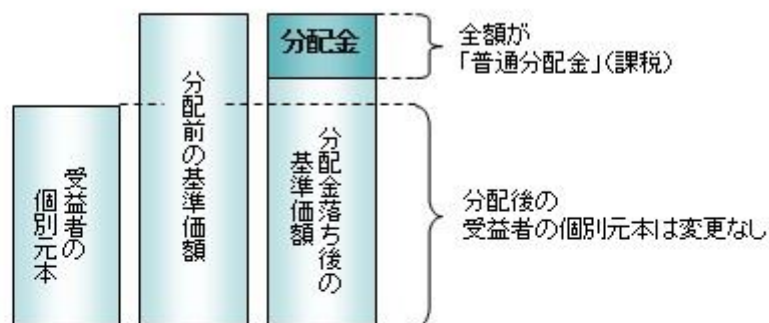
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

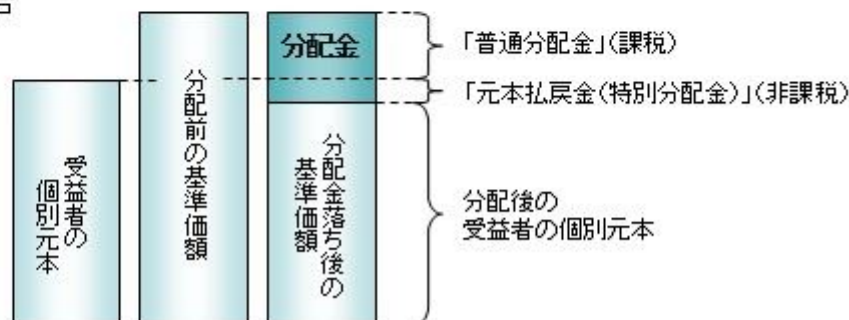
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2021年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 - 11】

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   | 32,592,518  | 26.22   |
| 親投資信託受益証券             | 日本   | 88,315,602  | 71.05   |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) |      | 3,385,808   | 2.72    |
| 合計(純資産総額)             |      | 124,293,928 | 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                     | 26,223,375 | 1.3764 | 36,093,853 | 1.3868 | 36,366,576 | 29.26 |
| 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              | 8,465,321  | 2.4921 | 21,096,426 | 2.4843 | 21,030,396 | 16.92 |
| 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)          | 8,345,013  | 2.1021 | 17,542,051 | 2.143  | 17,883,362 | 14.39 |
| 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                | 14,105,169 | 1.2154 | 17,143,422 | 1.2220 | 17,236,516 | 13.87 |
| 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                  | 6,649,933  | 1.4966 | 9,952,289  | 1.5044 | 10,004,159 | 8.05  |
| 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)         | 5,391,601  | 1.4152 | 7,630,193  | 1.42   | 7,656,073  | 6.16  |
| 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) | 4,016,513  | 1.277  | 5,129,087  | 1.2899 | 5,180,900  | 4.17  |
| 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)          | 1,586,731  | 1.1775 | 1,868,375  | 1.1799 | 1,872,183  | 1.51  |
| 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                  | 1,442,372  | 1.3209 | 1,905,229  | 1.2862 | 1,855,178  | 1.49  |
| 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                 | 1,734,822  | 1.0287 | 1,784,611  | 1.0507 | 1,822,777  | 1.47  |

## ロ.種類別の投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券  | 26.22   |
| 親投資信託受益証券 | 71.05   |
| 合計        | 97.28   |

### 【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) | 1,070      | 1,070 | 1.0159       | 1.0159 |
| 第2計算期間末 (2018年 7月17日) | 242        | 242   | 1.0570       | 1.0570 |
| 第3計算期間末 (2019年 7月17日) | 178        | 178   | 1.0751       | 1.0751 |
| 第4計算期間末 (2020年 7月17日) | 132        | 132   | 1.0873       | 1.0873 |
| 第5計算期間末 (2021年 7月19日) | 123        | 123   | 1.2381       | 1.2381 |
| 2020年 7月末日            | 131        |       | 1.0819       |        |
| 8月末日                  | 135        |       | 1.1137       |        |



|            |     |  |        |
|------------|-----|--|--------|
| 9月末日       | 134 |  | 1.1061 |
| 10月末日      | 126 |  | 1.0873 |
| 11月末日      | 130 |  | 1.1369 |
| 12月末日      | 126 |  | 1.1567 |
| 2021年 1月末日 | 125 |  | 1.1638 |
| 2月末日       | 126 |  | 1.1695 |
| 3月末日       | 129 |  | 1.2004 |
| 4月末日       | 125 |  | 1.2119 |
| 5月末日       | 122 |  | 1.2274 |
| 6月末日       | 123 |  | 1.2361 |
| 7月末日       | 124 |  | 1.2453 |

## 【分配の推移】

| 期   | 期間                      | 1口当たりの分配金（円） |
|-----|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2016年11月21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11月21日～2017年 7月18日 | 1.59   |
| 第2期 | 2017年 7月19日～2018年 7月17日 | 4.05   |
| 第3期 | 2018年 7月18日～2019年 7月17日 | 1.71   |
| 第4期 | 2019年 7月18日～2020年 7月17日 | 1.13   |
| 第5期 | 2020年 7月18日～2021年 7月19日 | 13.87  |

(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11月21日～2017年 7月18日 | 1,371,718,426 | 318,353,054 |
| 第2期 | 2017年 7月19日～2018年 7月17日 | 0             | 823,765,086 |
| 第3期 | 2018年 7月18日～2019年 7月17日 | 0             | 63,196,318  |
| 第4期 | 2019年 7月18日～2020年 7月17日 | 0             | 44,886,784  |

|     |                           |   |            |
|-----|---------------------------|---|------------|
| 第5期 | 2020年 7月18日 ~ 2021年 7月19日 | 0 | 21,709,005 |
|-----|---------------------------|---|------------|

(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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|--|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------------|------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>機器・サー<br>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<br>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<br>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<br>ア・サービ<br>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・<br>パーソナル<br>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・<br>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<br>導体製造装<br>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<br>ア・サービ<br>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<br>ア・サービ<br>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-<br>GENUSSCHEIN | 医薬品・バ<br>イオテクノ<br>ロジー・ラ<br>イフサイエ<br>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・<br>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<br>イオテクノ<br>ロジー・ラ<br>イフサイエ<br>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<br>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<br>ア・サービ<br>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<br>ジー・ハー<br>ドウェアお<br>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<br>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<br>(各通貨) | 契約額等(円)       | 評価額<br>(各通貨) | 評価額(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|-------------------|--------------|----|-----|-----|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 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<br>比率<br>(%) |
|--------|-----|----|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|---------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---------|------|-------------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|----------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額  | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|-------|------|--------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 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<br>額面総額  | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|--------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>比率<br>(%) |
|--------|-----|----|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----------|--------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------|--------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---------|-------|--------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|------------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---------|------|-----------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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.<br>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<br>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.<br>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.<br>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.<br>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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|----|------------------------------|-----------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| ブラジル   | 株式 | TELEFONICA BRASIL-ADR        | 電気通信<br>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<br>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<br>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<br>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<br>額面総額 | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|--------------|----------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| ドイツ  | 投資信託受益<br>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】

## &lt; 解約請求による換金 &gt;

## (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。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (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。

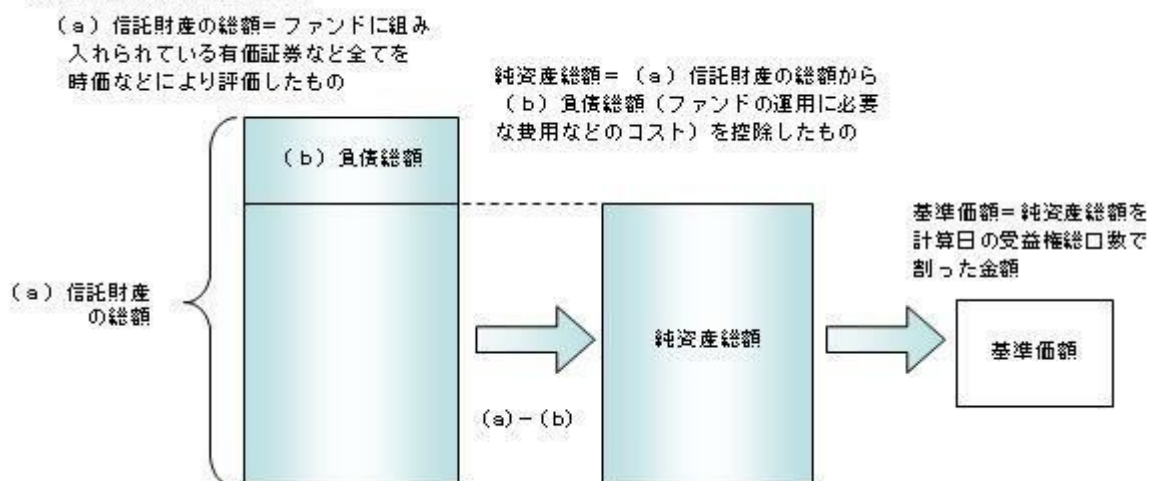
### 3【資産管理等の概要】

#### （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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

**（３）【信託期間】**

2026年7月17日までとします（2016年11月21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。）を行ないます。（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、書面決議を行ないます。（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。

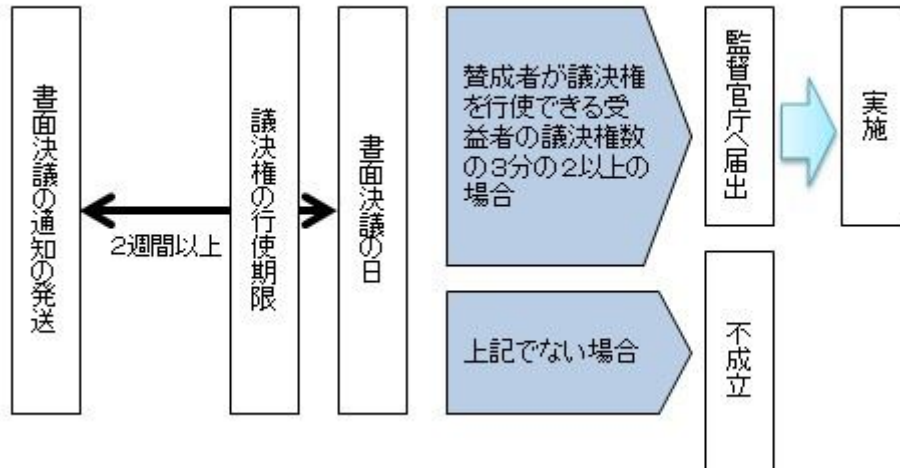
書面決議

- 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ないます。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/](http://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/](http://www.nikkoam.com/)

#### 関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・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)2016-11】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第4期<br>2020年 7月17日現在 | 第5期<br>2021年 7月19日現在 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| <b>資産の部</b>     |                      |                      |
| 流動資産            |                      |                      |
| コール・ローン         | 4,512,844            | 4,059,300            |
| 投資信託受益証券        | 33,284,265           | 32,169,706           |
| 親投資信託受益証券       | 94,996,552           | 87,975,830           |
| 流動資産合計          | 132,793,661          | 124,204,836          |
| 資産合計            | 132,793,661          | 124,204,836          |
| <b>負債の部</b>     |                      |                      |
| 流動負債            |                      |                      |
| 未払受託者報酬         | 21,648               | 20,651               |
| 未払委託者報酬         | 578,954              | 552,360              |
| 未払利息            | 4                    | 3                    |
| その他未払費用         | 65,663               | 62,637               |
| 流動負債合計          | 666,269              | 635,651              |
| 負債合計            | 666,269              | 635,651              |
| <b>純資産の部</b>    |                      |                      |
| 元本等             |                      |                      |
| 元本              | 121,517,184          | 99,808,179           |
| 剰余金             |                      |                      |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 10,610,208           | 23,761,006           |
| (分配準備積立金)       | 10,273,830           | 23,484,719           |
| 元本等合計           | 132,127,392          | 123,569,185          |
| 純資産合計           | 132,127,392          | 123,569,185          |
| 負債純資産合計         | 132,793,661          | 124,204,836          |

## (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<br>至 2020年 7月17日 | 自   | 2020年 7月18日<br>至 2021年 7月19日 |
| 営業収益                                      |     |                              |     |                              |
| 受取利息                                      |     | 4                            |     | -                            |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 3,623,908                    |     | 17,986,071                   |
| 営業収益合計                                    |     | 3,623,912                    |     | 17,986,071                   |
| 営業費用                                      |     |                              |     |                              |
| 支払利息                                      |     | 1,532                        |     | 525                          |
| 受託者報酬                                     |     | 47,638                       |     | 42,550                       |
| 委託者報酬                                     |     | 1,273,660                    |     | 1,138,018                    |
| その他費用                                     |     | 145,178                      |     | 129,073                      |
| 営業費用合計                                    |     | 1,468,008                    |     | 1,310,166                    |
| 営業利益又は営業損失( )                             |     | 2,155,904                    |     | 16,675,905                   |
| 経常利益又は経常損失( )                             |     | 2,155,904                    |     | 16,675,905                   |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |     | 2,155,904                    |     | 16,675,905                   |
| 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( ) |     | 669,859                      |     | 1,629,583                    |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |     | 12,494,481                   |     | 10,610,208                   |
| 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                            |     | 3,370,318                    |     | 1,895,524                    |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 3,370,318                    |     | 1,895,524                    |
| 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( )                           |     | 10,610,208                   |     | 23,761,006                   |

## (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<br>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。<br>親投資信託受益証券<br>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<br>2020年7月17日現在 | 第5期<br>2021年7月19日現在 |
|----|-----------|---------------------|---------------------|
| 1. | 期首元本額     | 166,403,968円        | 121,517,184円        |
|    | 期中追加設定元本額 | - 円                 | - 円                 |
|    | 期中一部解約元本額 | 44,886,784円         | 21,709,005円         |
| 2. | 受益権の総数    | 121,517,184口        | 99,808,179口         |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第4期<br>自 2019年7月18日<br>至 2020年7月17日 |                              | 第5期<br>自 2020年7月18日<br>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<br>配当等収益      | 1,064,043円                          | A 計算期末における費用控除後の<br>配当等収益 1,670,212円       |
| B                                   | 費用控除後、繰越欠損金補填後<br>の有価証券売買等損益 | 422,002円                            | B 費用控除後、繰越欠損金補填後<br>の有価証券売買等損益 13,376,110円 |
| C                                   | 信託約款に定める収益調整金                | 336,378円                            | C 信託約款に定める収益調整金 276,287円                   |
| D                                   | 信託約款に定める分配準備積立<br>金          | 8,787,785円                          | D 信託約款に定める分配準備積立<br>金 8,438,397円           |
| E                                   | 分配対象収益(A+B+C+D)              | 10,610,208円                         | E 分配対象収益(A+B+C+D) 23,761,006円              |
| F                                   | 分配対象収益(1万口当たり)               | 873円                                | F 分配対象収益(1万口当たり) 2,380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<br>自 2019年 7月18日<br>至 2020年 7月17日   | 第5期<br>自 2020年 7月18日<br>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<br>2020年 7月17日現在  | 第5期<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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  | 1,413,280         |
| 親投資信託受益証券 | 2,046,952         |
| 合計        | 3,460,232         |

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  | 7,140,815         |
| 親投資信託受益証券 | 7,668,062         |
| 合計        | 14,808,877        |

（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<br>2020年 7月17日現在 |           | 第5期<br>2021年 7月19日現在 |           |
|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| 1口当たり純資産額            | 1.0873円   | 1口当たり純資産額            | 1.2381円   |
| (1万口当たり純資産額)         | (10,873円) | (1万口当たり純資産額)         | (12,381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） | 4,016,513  | 5,129,087   |    |
|              | 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）         | 8,345,013  | 17,542,051  |    |
|              | 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）        | 5,391,601  | 7,630,193   |    |
|              | 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）         | 1,586,731  | 1,868,375   |    |
| 投資信託受益証券 合計  |                                      | 19,339,858 | 32,169,706  |    |
| 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             | 8,465,321  | 21,096,426  |    |
|              | ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド                    | 26,223,375 | 36,093,853  |    |
|              | インデックス マザーファンド Jリート                  | 6,649,933  | 9,952,289   |    |
|              | 先進国資本エマージング株式マザーファンド                 | 1,442,372  | 1,905,229   |    |
|              | インデックス マザーファンド 海外先進国債券               | 14,105,169 | 17,143,422  |    |
|              | インデックス マザーファンド コモディティ                | 1,734,822  | 1,784,611   |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                                      | 58,620,992 | 87,975,830  |    |
| 合計           |                                      | 77,960,850 | 120,145,536 |    |

(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 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 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   |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 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       |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 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<br>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br><br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br><br>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<br>(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       |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |                 |                 |
| <b>流動負債</b>  |                 |                 |
| 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      |
| <b>純資産の部</b> |                 |                 |
| <b>元本等</b>   |                 |                 |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>「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<br>至 2020年 7月17日 | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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 |
|------|-------------------|
| 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          |       | 時価            | 評価損益       |
|-----------|----------|---------------|-------|---------------|------------|
|           |          |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引   |               |       |               |            |
|           | 買建       | 1,159,038,800 | -     | 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          |       | 時価            | 評価損益       |
|-----------|--------|---------------|-------|---------------|------------|
|           |        |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 |               |       |               |            |
|           | 買建     | 3,353,771,580 | -     | 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   |
| FREEPORT-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                          |  |
| SOLAREDDGE 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<br>(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   |
| CANOPIY 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<br>(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<br>(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                       |  |
|       | ASHTREAD 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<br>(7,295,919,534) |  |
| スウェーデンク<br>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 |                |                 |
|              |                             | 215,753   |              | 111,447,011.00 |                 |



| デンマーククローネ小計               |                                 |         |            | (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<br>(2,192,461,188) |  |
| シンガポールド<br>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<br>(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 HAPOALIM 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<br>(246,590,203)        |  |
| 合 計         |                              | 43,318,587 |        | 229,180,032,954<br>(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<br>INVST | 2,800   | 172,452.00    |                 |
|       |      |   | 2,800   | 172,452.00    |                 |

|            |      |                              |         |                                  |
|------------|------|------------------------------|---------|----------------------------------|
| 加ドル小計      |      |                              |         | (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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(98,503,812)     |
| 合計         |      |                              |         | 5,507,243,160<br>(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<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>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 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 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    |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 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        |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 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<br>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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 | 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  |
|--------------|-----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                 |                |
| 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 | 76,752,410,128 |
| <b>負債の部</b>  |                 |                |
| 流動負債         |                 |                |
| 未払利息         | 11              | 16             |
| 流動負債合計       | 11              | 16             |
| 負債合計         | 11              | 16             |
| <b>純資産の部</b> |                 |                |
| 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 | 76,752,410,112 |
| 負債純資産合計     | 124,328,008,076 | 76,752,410,128 |

## 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>「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                         | 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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品 | (1)有価証券<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品 |

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

（有価証券に関する注記）

（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) |  |
| ユーロ小計 |      |                              |           |                 |  |
| 英ポンド  | 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 PROPERTIE | 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   |  |
|     |       |                              |            | (4,287,210,705) |  |
|     | 英債券小計 |                              |            |                 |  |
| 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    |                 |
|                   |      | HOMECO 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<br>ジーラン<br>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<br>ポールド<br>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 & COMMERCIAL | 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   |                 |
|           |      | シンガポールドドル小計                    | 23,403,642 | 32,144,197.08  | (2,600,465,543) |
| 韓国ウォ<br>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)    |
| イスラエルシュケル   | 投資証券 | REIT 1 LTD                | 87,544  | 1,518,888.40     |                  |
| イスラエルシュケル小計 |      |                           | 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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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%           |
| 英ポンド       | 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%           |
| イスラエルシュケル  | 投資証券 1銘柄   | 100.0%         | 0.1%           |

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 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 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 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    |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 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         |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 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<br>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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 | 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     | 1.1121円   | 1口当たり純資産額     | 1.1775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 |
|-------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b> |               |               |
| 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 |
| <b>負債の部</b> |               |               |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>「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                            | 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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>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%-<br>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%-<br>24/12/05 | 9,010,000.00   | 10,040,518.75                   |    |
|                                       |              | MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-<br>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%-<br>31/05/29 | 7,450,000.00   | 7,880,703.12                    |    |
|                                       |              | MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-<br>34/11/23 | 3,000,000.00   | 3,177,187.50                    |    |
|                                       |              | MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-<br>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%-<br>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<br>(625,368,252) |    |
| ブラジル<br>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%-<br>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        |               |
| ブラジルリアル小計 |      |   | 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      | 国債証券 | BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12        | 310,000.00        | 340,099.14        |               |

|                                       |              |   |               |                               |
|---------------------------------------|--------------|---|---------------|-------------------------------|
| エボソル                                  |              | 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<br>(148,162,949) |
| ウルグアイ<br>イペソ                          | 国債証券         | REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%-<br>28/03/15  | 1,300,000.00  | 1,353,288.82                  |
|                                       |              | REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.25%-<br>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<br>(14,885,295)  |
| ドミニカ<br>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<br>(16,207,078)  |
| トルコリ<br>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                                |               |                               |
|                                       |              |   | 11,870,000.00 | 9,952,445.00                  |

|                                       |               |  |               |                                |
|---------------------------------------|---------------|--|---------------|--------------------------------|
| トルコリラ小計                               |               |  |               | (128,278,058)                  |
| チェココ<br>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                   |
| チェココルナ小計                              |               |  | 53,060,000.00 | 53,862,130.85<br>(273,538,831) |
| ハンガ<br>リーフォ<br>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%-<br>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%-<br>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%-<br>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%-<br>31/10/22 | 60,000,000.00 | 63,717,300.00                  |
|                                       |               | HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%-<br>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                              |               |                                |

|                                       |               |                                       |                |                                 |  |
|---------------------------------------|---------------|---------------------------------------|----------------|---------------------------------|--|
| ハンガリーフォロント小計                          |               |                                       | 692,400,000.00 | 725,124,282.00<br>(261,625,566) |  |
| ポーランド<br>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<br>(563,582,273)  |  |
| ロシア<br>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<br>(489,464,776) |  |
| ルーマニア<br>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%-<br>23/04/26 | 480,000.00     | 508,432.80                      |  |
|  |            | ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.25%-<br>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%-<br>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%-<br>25/02/24 | 550,000.00     | 586,940.75                      |  |
|  |            | ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%-<br>25/07/28 | 320,000.00     | 329,352.00                      |  |
|  |            | ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%-<br>26/04/22 | 450,000.00     | 485,925.75                      |  |
|  |            | ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%-<br>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%-<br>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%-<br>31/09/24 | 470,000.00 | 466,647.72                                 |                |                                 |  |
| ルーマニアアレイ小計                                 |            |  | 7,370,000.00   | 7,715,468.27<br>(203,092,728)   |  |
| マレーシ<br>アリン<br>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%-<br>22/03/31 | 350,000.00 | 354,690.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.948%-<br>22/04/14 | 530,000.00 | 538,453.50   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.151%-<br>23/05/15 | 300,000.00 | 306,558.75   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.094%-<br>23/11/30 | 500,000.00 | 524,025.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.655%-<br>24/10/15 | 170,000.00 | 177,284.50   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.128%-<br>25/08/15 | 700,000.00 | 742,560.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.726%-<br>26/03/31 | 550,000.00 | 577,500.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%-<br>27/07/26 | 580,000.00 | 620,890.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.422%-<br>27/09/30 | 570,000.00 | 584,820.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.369%-<br>28/10/31 | 730,000.00 | 792,415.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.13%-<br>29/07/09  | 570,000.00 | 607,050.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.465%-<br>30/10/15 | 750,000.00 | 761,625.00   |  |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.447%-<br>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<br>(501,370,362) |  |
| タイバー<br>ツ                                  | 国債証券         | THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-<br>22/06/17 | 6,000,000.00  | 6,077,354.40                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-<br>22/12/17   | 9,000,000.00  | 9,192,353.40                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-<br>23/06/16 | 7,100,000.00  | 7,520,915.69                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-2.4%-<br>23/12/17   | 8,700,000.00  | 9,088,700.34                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-0.75%-<br>24/06/17  | 5,500,000.00  | 5,531,661.85                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-1.45%-<br>24/12/17  | 9,700,000.00  | 9,979,319.26                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-0.95%-<br>25/06/17  | 9,800,000.00  | 9,908,541.86                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-<br>25/12/12  | 7,370,000.00  | 8,364,571.91                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-<br>26/12/17 | 10,300,000.00 | 10,992,728.56                  |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%-<br>28/12/17 | 8,200,000.00  | 9,146,125.84                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-<br>29/06/22 | 10,680,000.00 | 13,417,351.28                  |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%-<br>29/12/17   | 6,300,000.00  | 6,370,560.00                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-<br>31/06/20  | 8,300,000.00  | 9,808,940.00                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-<br>31/12/17   | 3,000,000.00  | 3,096,592.20                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%-<br>32/06/25 | 10,500,000.00 | 12,543,408.15                  |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%-<br>35/06/17   | 4,500,000.00  | 4,282,235.10                   |  |
|  |              | THAILAND GOVERNMENT BOND-1.585%-<br>35/12/17 | 4,700,000.00  | 4,428,340.00                   |  |
| THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-<br>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                    |  |
| タイバーツ小計                             |                  |  | 158,000,000.00   | 171,142,020.62<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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%-<br>35/02/28 | 5,800,000.00  | 5,222,672.64                     |  |
|            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-<br>36/03/31  | 4,190,000.00  | 2,938,864.53                     |  |
|            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%-<br>37/01/31   | 7,510,000.00  | 6,376,887.44                     |  |
|            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%-<br>40/01/31   | 4,770,000.00  | 4,149,577.78                     |  |
|            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-<br>41/02/28   | 3,090,000.00  | 2,044,940.83                     |  |
|            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-<br>44/01/31  | 5,680,000.00  | 4,744,026.31                     |  |
|            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-<br>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<br>(529,647,326)   |  |
|            | 合計   |               | 6,691,362,111<br>(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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|----------------|
| メキシコペソ     | 国債証券 14銘柄 | 100.0%       | 9.3%           |
| ブラジルレアル    | 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%  |
| タイパーツ      | 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。

### 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）

#### 貸借対照表

（単位：円）

|              | 2020年 7月17日現在 | 2021年 7月19日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 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       |
| 負債合計         | 24,251,736    | 153,819       |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 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<br>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<br>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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          | 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     | 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          | 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     | 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   |
|--------------|-----------------|-----------------|
| <b>資産の部</b>  |                 |                 |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |                 |                 |
| 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     |
| <b>純資産の部</b> |                 |                 |
| 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 | <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<br/>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<br/>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<br/>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      | 為替予約取引<br>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。                      |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>「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                             | 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  |
|    | 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) | 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<br>至 2020年 7月17日                                       | 自 2020年 7月18日<br>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<br/>           売買目的有価証券<br/>           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<br/>           該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品<br/>           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<br/>           同左</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>           「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<br/>           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 |
|----------|-------------------|
| 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<br>(149,260,981,781) |    |
|       |          | 合計                             |            | 149,260,981,781<br>(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<br>受益証券時価比率 | 合計金額に<br>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  |
|--------------|----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                |                |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |                |                |
| 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     |
| <b>純資産の部</b> |                |                |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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                        | 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T S P              | 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T O P I X（日本株式）    | 7,981,577,436円  | 7,780,221,313円  |
|    | T O P I X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<br>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。<br>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品 | (1)有価証券<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品 |

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

(有価証券に関する注記)

(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<br>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 |
| ピ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 |
| 飛島建設             | 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  |
| ダイド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     |
| ピッ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   |
| クラウドシ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   |  |
| 高圧ガス工業       | 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  |
| KH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   |
| ADEKA          | 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ＳＣ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   |
| ピーピー・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  |
| 日本軽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 |
| D O W A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  |
| U A C J         | 2,500  | 2,798.00 | 6,995,000  |
| C K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Ｃｏ           | 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    |
| フリーー         | 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   |
| 日本エアージェット      | 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   |

|                 |         |           |               |                   |
|-----------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| SCREENホールディングス  | 2,800   | 9,420.00  | 26,376,000    |                   |
| キヤノン電子          | 1,600   | 1,653.00  | 2,644,800     |                   |
| キヤノン            | 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     |                   |
| MUTOH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<br>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       |                   |
| GMB             | 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   |
| NOK        | 7,900   | 1,388.00  | 10,965,200  |
| フタバ産業      | 4,100   | 552.00    | 2,263,200   |
| KYB        | 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 |
| SUBARU     | 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  |
| TBK        | 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  |
| JMS        | 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   |  |
| HOYA              | 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   |  |
| 廣済堂                         | 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     |  |
| T A K A R A & C O M P A N Y | 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     |
| 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     |
| エーアイテイー        | 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     |
| N E C 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  |
| ソフトクリエイティブホールディングス     | 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  |
| ポルトウウィン・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نز              | 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  |
| P C Iホールディングス               | 700   | 1,108.00 | 775,600    |
| パイプドHD                      | 400   | 2,148.00 | 859,200    |
| アイピーシー                      | 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  |
| ピーグリー                       | 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   |
| HEROZ                  | 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  |  |
| ID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   |  |
| CAC Holdings     | 1,000   | 1,395.00 | 1,395,000   |  |
| SB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   |  |
| ACCESS           | 2,100   | 853.00   | 1,791,300   |  |
| デジタルガレージ         | 2,600   | 4,790.00 | 12,454,000  |  |
| EM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   |  |
| CIJ              | 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     |  |
| IMAGICA GROUP    | 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   |  |

|                      |         |           |             |
|----------------------|---------|-----------|-------------|
| TBS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     |
| USEN-NEXT HOLDINGS   | 1,500   | 2,432.00  | 3,648,000   |
| コネクシオ                | 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 |
| KDDI                 | 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   |
| GMO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     |
| KADOKAWA             | 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   |
| DTS                  | 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   |
| カブコン                 | 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     |
| オルパ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   |  |
| OUG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  |
| トーヨー                | 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  |
| J K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・バイエリア  | 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  |
| ジーンズホールディングス              | 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 |
| M o n o t a R O           | 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 |
| ブロンコピリー                   | 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 |
| H a m e e                 | 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 |
| クリエイトSDホールディングス           | 2,300  | 3,485.00 | 8,015,500  |
| 丸善C H I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 |
| S F P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     |  |
| バ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   |  |
| カッパ・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<br>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    |  |
| コロナイド                           | 5,400  | 1,964.00 | 10,605,600 |  |
| ピーシーデボコーポレーション                  | 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   |
| MrMaxHD           | 2,200  | 651.00    | 1,432,200   |
| AOKI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   |                    |
| パ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  |                    |
| サックスパー 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     |                    |
| ベルーナ                | 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<br>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<br>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     |
| ビーロット            | 1,000   | 572.00   | 572,000     |
| ファーストブラザーズ       | 300     | 1,019.00 | 305,700     |
| ハウスドゥ            | 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   |
| W D B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  |
| K e e P e r 技研      | 1,000  | 3,035.00  | 3,035,000  |
| ファーストロジック           | 300    | 779.00    | 233,700    |
| 三機サーピス              | 400    | 1,113.00  | 445,200    |
| G u n o s y         | 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    |
| アピスト                | 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・エージェンツ・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 MN                   | 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  |  |
| アゴラ ホスピタリティィー 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  |
|--------------|-----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                 |                |
| 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  |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |                 |                |
| 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    |
| <b>純資産の部</b> |                 |                |
| 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<br/>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<br/>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      | 為替予約取引<br>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。   |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br>「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                                    | 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  |
| P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-05M(適格機関投資家転売制限付) | 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 2014-07(適格機関投資家転売制限付)  | 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 2014-09Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2014-09Q-2(適格機関投資家向け)  | 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 2014-10(適格機関投資家転売制限付)  | 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 2014-11Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2015-02Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2015-03Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2015-04Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2015-06Q(適格機関投資家向け)    | 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 2015-09Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2015-12Q(適格機関投資家向け)    | 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 2016-01Q(適格機関投資家向け)    | 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 2016-04Q(適格機関投資家転売制限付) | 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 2016-07Q(適格機関投資家向け)    | 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 2016-10Q(適格機関投資家向け)    | 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 2017-06Q(適格機関投資家向け)    | 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 2017-07Q(適格機関投資家向け)    | 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 2017-09Q(適格機関投資家向け)    | 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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>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<br>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<br>(5,597,652,441) |                                  |
|     | 特殊債券  | EUROPEAN INVESTMENT BANK-0.75%-<br>30/09/23 | 10,000,000.00 | 9,509,326.10                     |                                  |
|     |       | INTER-AMERICAN DEVEL BK-2.25%-<br>29/06/18  | 18,000,000.00 | 19,386,603.00                    |                                  |
|     |       | INTER-AMERICAN DEVEL BK-4.375%-<br>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<br>(4,381,572,663) |                                  |
|     | 米ドル小計 |   |               | 84,900,000.00                    | 90,819,303.83<br>(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<br>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) |                  |
| スウェーデンクローナ小計                        |         |   | 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<br>(10,678,776,976) |  |
| 豪ドル小計 |        | 152,100,000.00 | 164,937,696.69<br>(13,359,953,431) |  |
|       | 合計     |                | 70,288,826,829<br>(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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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



|              | 2020年 7月17日現在  | 2021年 7月19日現在  |
|--------------|----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                |                |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |                |                |
| 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     |
| <b>純資産の部</b> |                |                |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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        | うち1年超 | 時価          | 評価損益       |
|------|----------------|-------------|-------|-------------|------------|
|      |                |             |       |             |            |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>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        | うち1年超 | 時価          | 評価損益      |
|------|----------------|-------------|-------|-------------|-----------|
|      |                |             |       |             |           |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>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   |  |
| アクティブア・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

|              | 2020年 7月17日現在 | 2021年 7月19日現在 |
|--------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b>  |               |               |
| 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   |
| <b>負債の部</b>  |               |               |
| 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       | -             |
| <b>純資産の部</b> |               |               |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>「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                        | 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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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 | 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<br>取引 | 為替予約取引<br>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<br>(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<br>(1,926,569)   |    |
| メキシコ<br>ペソ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-<br>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   |              |
| 英ポンド小計                |      |                                       | 32,000.00  | 44,422.00  | (6,713,496)  |
| スウェーデン<br>デンク<br>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<br>ウェー<br>クロー<br>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<br>ーク<br>クロー<br>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<br>ラン              | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23 | 2,000.00   | 2,135.20   |              |

|              |      |                                      |           |             |               |
|--------------|------|--------------------------------------|-----------|-------------|---------------|
| ドズロチ         |      | 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    |               |
| シンガポールドル小計   |      |                                      | 5,000.00  | 5,529.60    | (447,344)     |
| マレーシアリングット   | 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)     |
| イスラエルシェケル    | 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28     | 10,000.00 | 10,984.84   |               |
| イスラエルシェケル小計  |      |                                      | 10,000.00 | 10,984.84   | (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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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  |
|--------------|----------------|----------------|
| <b>資産の部</b>  |                |                |
| 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     |
| 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 |
| <b>負債の部</b>  |                |                |
| 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     |
| <b>純資産の部</b> |                |                |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>「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 |
| 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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br>同左<br>(2)デリバティブ取引<br>同左<br>(3)上記以外の金融商品<br>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 |
|----|-------------------|
| 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<br>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                     |    |
| 米ドル小計    |                              | 2,440,916 |        | 18,953,970.82<br>(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<br>(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) |
| マレーシアリングット   | 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) |
| タイバーツ        | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 290,500   | 170.50    | 49,530,250.00     |               |
|              | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR    | 272,000   | 64.50     | 17,544,000.00     |               |
| タイバーツ小計      |                              | 562,500   |           | 67,074,250.00     | (224,027,995) |
| インドネシアル      | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA  | 1,593,000 | 10,700.00 | 17,045,100,000.00 |               |

|                  |                              |            |                |                   |                 |
|------------------|------------------------------|------------|----------------|-------------------|-----------------|
| ピア               | 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      |                 |

|                 |                              |            |        |                |                  |
|-----------------|------------------------------|------------|--------|----------------|------------------|
|                 | ABS 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<br>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<br>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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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 |
|-------------|---------------|---------------|
| <b>資産の部</b> |               |               |
| 流動資産        |               |               |
| 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    |
| <b>負債の部</b> |               |               |
| 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>「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<br>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<br>至 2020年 7月17日  | 自 2020年 7月18日<br>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<br>売買目的有価証券<br>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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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<br><br>同左<br><br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br><br>(3)上記以外の金融商品<br><br>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<br>(11,046,925)  |    |
| 合計    |          |                            |       | 11,046,925<br>(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<br>受益証券時価比率 | 合計金額に<br>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)2016-11】

## 【純資産額計算書】

|                |              |
|----------------|--------------|
| 資産総額           | 124,391,691円 |
| 負債総額           | 97,763円      |
| 純資産総額( - )     | 124,293,928円 |
| 発行済口数          | 99,808,179口  |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.2453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<br>(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<br>(2020年3月31日) |        | 第62期<br>(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<br>(2020年3月31日) | 第62期<br>(2021年3月31日) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| <b>負債の部</b>     |                      |                      |
| <b>流動負債</b>     |                      |                      |
| 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               |
| <b>固定負債</b>     |                      |                      |
| 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               |
| <b>純資産の部</b>    |                      |                      |
| <b>株主資本</b>     |                      |                      |
| 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               |
| <b>評価・換算差額等</b> |                      |                      |
| 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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>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<br>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<br>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<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・<br>換算差額<br>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<br>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<br>合計 |
|                         |        | 資本準備金 | 資本剰余金<br>合計 | その他利益<br>剰余金<br>繰越利益<br>剰余金 | 利益剰余金<br>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<br>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<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・<br>換算差額<br>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<br>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<br>(自 2020年4月1日<br>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<br/>総平均法による原価法<br/>その他有価証券<br/>時価のあるもの<br/>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)<br/>時価のないもの<br/>総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ<br/>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。<br/>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="528 797 1031 869"> <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<br>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<br>(2020年3月31日)  | 第62期<br>(2021年3月31日)   |
|---|--|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額<br>建物 1,311百万円<br>器具備品 707百万円  | 1 有形固定資産の減価償却累計額<br>建物 1,349百万円<br>器具備品 764百万円                                       |
| 2 信託資産<br>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客<br>分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に<br>信託しております。  | 2 信託資産<br>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客<br>分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に<br>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<br>あります。<br>(流動資産)<br>未収収益 151百万円<br>(流動負債)<br>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<br>あります。<br>(流動資産)<br>未収収益 257百万円<br>(流動負債)<br>未払費用 1,247百万円 |
| 4 消費税等の取扱い<br>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、<br>「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<br>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、<br>「未払消費税等」として表示しております。                          |
| 5 保証債務<br>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が<br>ロンドン ウォール リミテッド パートナーシップ<br>に支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対<br>して保証を行っております。 |  |

## (損益計算書関係)

| 第61期<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日)                     | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>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、<br>次のとおりであります。<br>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、<br>次のとおりであります。<br>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<br>目的となる<br>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<br>度末残高<br>(百万円) |
|------------------------|--------------------------|--------------------|-------------|-------------|------------|-----------------------|
|                        |                          | 当事業年度<br>期首        | 当事業年度<br>増加 | 当事業年度<br>減少 | 当事業<br>年度末 |                       |
| 2009年度<br>ストックオプション(1) | 普通株式                     | 1,171,500          | -           | 1,171,500   | -          | -                     |
| 2009年度<br>ストックオプション(2) | 普通株式                     | 75,900             | -           | 75,900      | -          | -                     |
| 2011年度<br>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<br>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<br>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<br>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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2019年5月28日<br>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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 2020年6月12日<br>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<br>目的となる<br>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<br>度末残高<br>(百万円) |
|------------------------|--------------------------|--------------------|-------------|-------------|------------|-----------------------|
|                        |                          | 当事業年度<br>期首        | 当事業年度<br>増加 | 当事業年度<br>減少 | 当事業<br>年度末 |                       |
| 2011年度<br>ストックオプション(1) | 普通株式                     | 1,184,700          | -           | 752,400     | 432,300    | -                     |
| 2016年度<br>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<br>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<br>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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|-----------|
| 2020年6月12日<br>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<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|--------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 2021年5月25日<br>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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |          | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |          |
|---------------------------------------|----------|---------------------------------------|----------|
| オペレーティング・リース取引<br>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<br>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<br>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<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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



週次ベ - 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<br>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<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>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<br>が取得原価を超え<br>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<br>が取得原価を超え<br>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<br>が取得原価を超え<br>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<br>が取得原価を超え<br>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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|--------|--------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外 | 為替予約取引<br>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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) |
|-------------|--------------|---------|---------------|-------------------------|-------------|
| 原則的処理<br>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<br>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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---------------|-----------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外<br>の取引 | 為替予約取引    |               |                         |             |               |
|               | 売建<br>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<br>(百万円) | 契約額等<br>のうち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) |
|----------|--------------|---------|---------------|-------------------------|-------------|
|----------|--------------|---------|---------------|-------------------------|-------------|

| 原則的処理<br>方法 | 為替予約取引<br>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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>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<br>(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<br>(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<br>取締役・従業員 271名 | 当社及び関係会社の<br>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<br>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<br>取締役・従業員 186名   | 当社及び関係会社の<br>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<br>2021年10月6日まで  | 2018年7月15日から<br>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<br>取締役・従業員 31名 | 当社及び関係会社の<br>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<br>2027年4月30日まで  | 2020年4月27日から<br>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<br>取締役・従業員 186名   | 当社及び関係会社の<br>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<br>2021年10月6日まで  | 2018年7月15日から<br>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<br>取締役・従業員 31名  | 当社及び関係会社の<br>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<br>2027年4月30日まで  | 2020年4月27日から<br>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<br>(2020年3月31日) | 第62期<br>(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<br>(米国ドル貸建)<br>(注1) | -                  | 関係会社<br>短期貸付金 | 1,793 (USD)<br>16,500 (千) |
|     |                                      |        |                |            |                   |           | 貸付金利息<br>(米国ドル貸建)<br>(注1) | 86 (USD)<br>798(千) | 未収収益          | 13 (USD)<br>122 (千)       |

|     | Limited                                      | 国  |                             | ト業                  |              |   | 資金の貸付<br>(円貨建)<br>(注1) |                            | 関係会社<br>短期<br>貸付金 |   |
|-----|--|----|-----------------------------|---------------------|--------------|---|------------------------|----------------------------|-------------------|---|
|     |  |    |                             |                     |              |   | -                      |                            | 577               |   |
|     |  |    |                             |                     |              |   | 貸付金利息<br>(円貨建)<br>(注1) | 12                         | 未収収益              | 3 |
| 子会社 | Nikko AM<br>Americas<br>Holding Co.,<br>Inc. | 米国 | 131,079<br>(USD 千)<br>(注 2) | アセット<br>マネジメン<br>ト業 | 直接<br>100.00 | - | 配当の受取                  | 1,526<br>(USD<br>14,000 千) | -                 | - |
| 子会社 | Nikko AM<br>Global<br>Holdings<br>Limited    | 英国 | 1,550<br>(百万円)              | アセット<br>マネジメン<br>ト業 | 直接<br>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<br>名称又は<br>氏名 | 所在地 | 資本金<br>又は<br>出資金 | 事業<br>の内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有<br>割合(%)) | 関連<br>当事者<br>との<br>関係 | 取引の内容                         | 取引金額<br>(百万円) | 科目                | 期末残高<br>(百万円)              |
|----|--------------------|-----|------------------|-----------|-------------------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------|-------------------|----------------------------|
|    |                    |     |                  |           |                               |                       | 資金の貸付<br>(米国ドル<br>貨建)<br>(注1) | -             | 関係会社<br>短期<br>貸付金 | 1,825<br>(USD<br>16,500 千) |

|     |  |         |                           |             |              |   |                               |                           |                   |                   |
|-----|--|---------|---------------------------|-------------|--------------|---|-------------------------------|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 子会社 | Nikko Asset Management International Limited | シンガポール国 | 342,369<br>(SGD千)         | アセットマネジメント業 | 直接<br>100.00 | - | 貸付金利息<br>(米国ドル<br>貨建)<br>(注1) | 63<br>(USD<br>596千)       | 未収収益              | 7<br>(USD<br>71千) |
|     |  |         |                           |             |              |   | 資金の貸付<br>(円貨建)<br>(注1)        | -                         | 関係会社<br>短期<br>貸付金 | 577               |
|     |  |         |                           |             |              |   | 貸付金利息<br>(円貨建)<br>(注1)        | 12                        | 未収収益              | 3                 |
| 子会社 | Nikko AM Americas Holding Co., Inc.          | 米国      | 131,079<br>(USD千)<br>(注2) | アセットマネジメント業 | 直接<br>100.00 | - | 配当の受取                         | 1,783<br>(USD<br>17,000千) | -                 | -                 |
| 子会社 | Nikko Asset Management Luxembourg S.A.       | ルクセンブルグ | 2,828<br>(EUR千)           | アセットマネジメント業 | 直接<br>100.00 | - | 増資の引受<br>(注3)                 | 217<br>(EUR<br>1,750千)    | -                 | -                 |

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- Nikko Asset Management Luxembourg S.A.の行った70,000株の新株発行増資を、1株につき25ユーロで当社が引き受けたものであります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2020年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

|       |           |
|-------|-----------|
| 資産合計  | 30,151百万円 |
| 負債合計  | 5,919百万円  |
| 純資産合計 | 24,231百万円 |

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

## 関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(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せん。

(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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日)   | 第62期<br>(自 2020年4月1日<br>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<br>(2020年3月31日) | 第62期<br>(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<br>(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<br>(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。                                   |
| 日興アセットマネジメント株式会社 | 17,363百万円             | 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。 |

## (3) 投資顧問会社

| 名 称          | 資本金の額<br>(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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起す

ること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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）2016-11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）2016-11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。