

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年1月25日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「Aナビ20」、「ステージ4」、「アセット・ナビゲーション・ファンド」、「Aナビ」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%（税抜1%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2019年1月26日から2020年1月28日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的に安定的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

ファンドの仕組み

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



- (主な投資制限) ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
 ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- (分配方針) ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
 ※将来の分配金の支払いおよびその全額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

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

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

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

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

3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式20%、債券など80%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.5%
日本債券インデックスマザーファンド	65%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

信託金限度額

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

(2)【ファンドの沿革】

1999年10月29日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

2001年6月1日

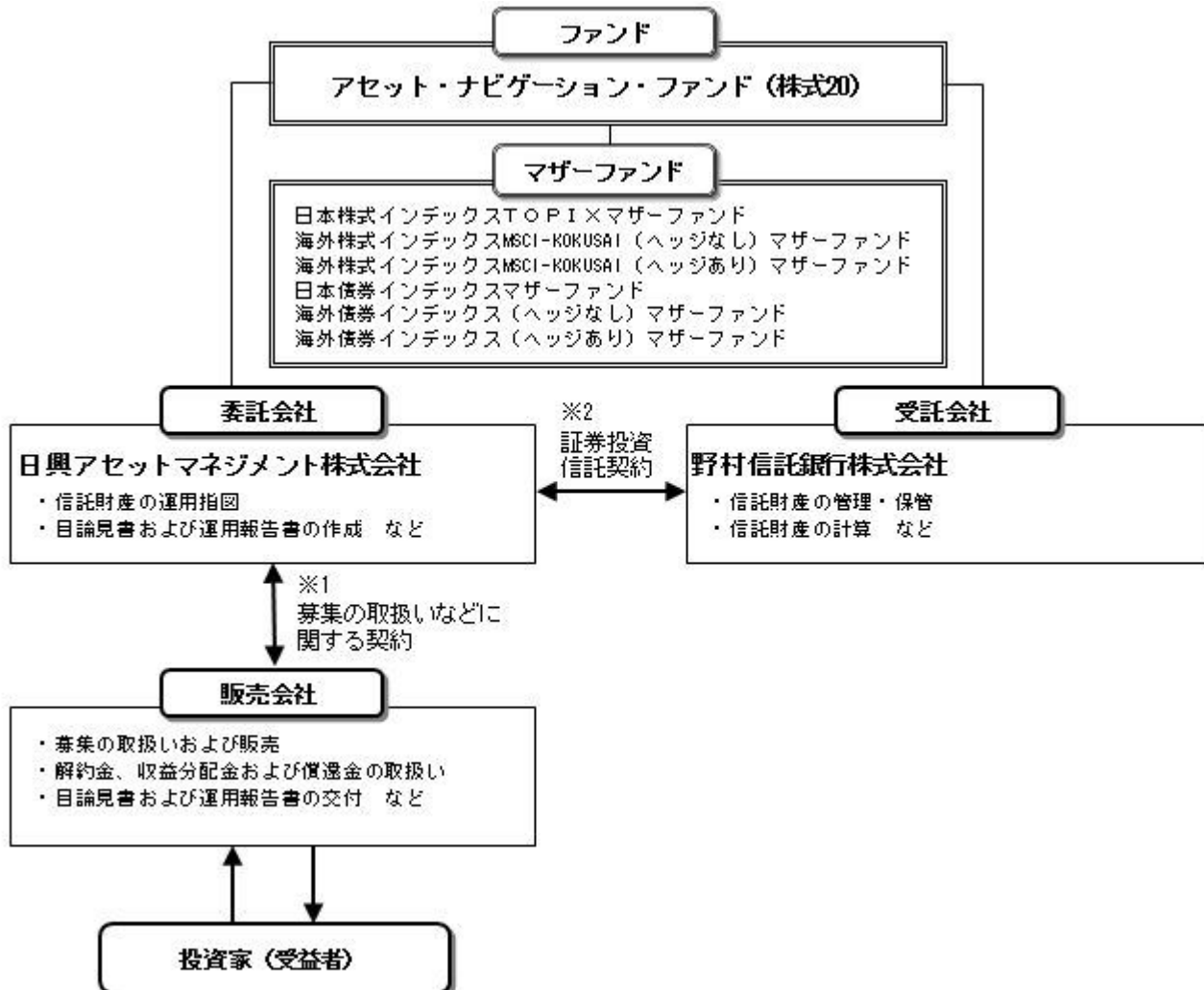
・ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ4）

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

委託会社の概況（2018年10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
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
 - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
 - 株式の標準実質組入比率.....20%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....80%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 5) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 6) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」受益証券
- 7) 株券または新株引受権証書

- 8) 国債証券
 - 9) 地方債証券
 - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 13) コマーシャル・ペーパー
 - 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
 - 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックストップIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に

掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。)には投資しません。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ます。)を除きます。)には投資しません。

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド >
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7) コマーシャル・ペーパー

8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの

10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの

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

13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)

15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

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

1) 預金

2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 信用取引

2) 先物取引等

3) スワップ取引

4) 金利先渡取引

5) 為替先渡取引

6) 有価証券の貸付

7) 公社債の空売

8) 公社債の借入

9) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 公社債の空売
- 6) 公社債の借入

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

5) 為替手形

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

1) 国債証券

2) 地方債証券

3) 特別の法律により法人の発行する債券

4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。

5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

6) コマーシャル・ペーパー

7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの

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

9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。

12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

1) 預金

2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 先物取引等

2) スワップ取引

3) 金利先渡取引

4) 為替先渡取引

5) 有価証券の貸付

6) 公社債の空売

7) 公社債の借入

8) 外国為替予約取引

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限りま。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 為替先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
 - 8) 外国為替予約取引

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）* に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

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

運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンツリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

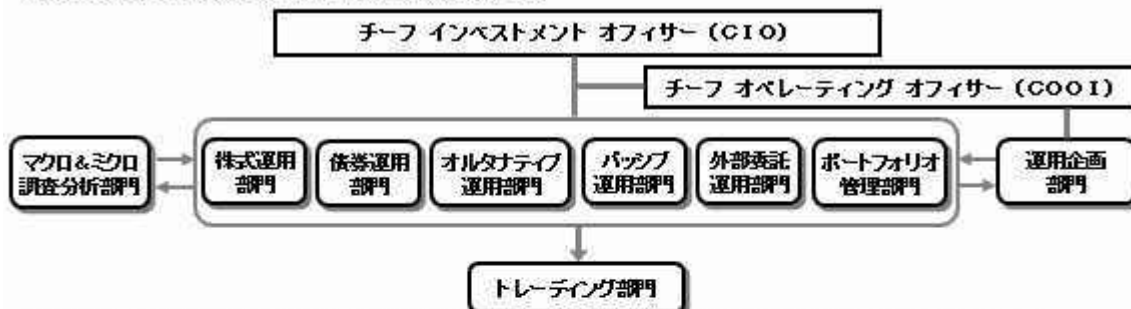
< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

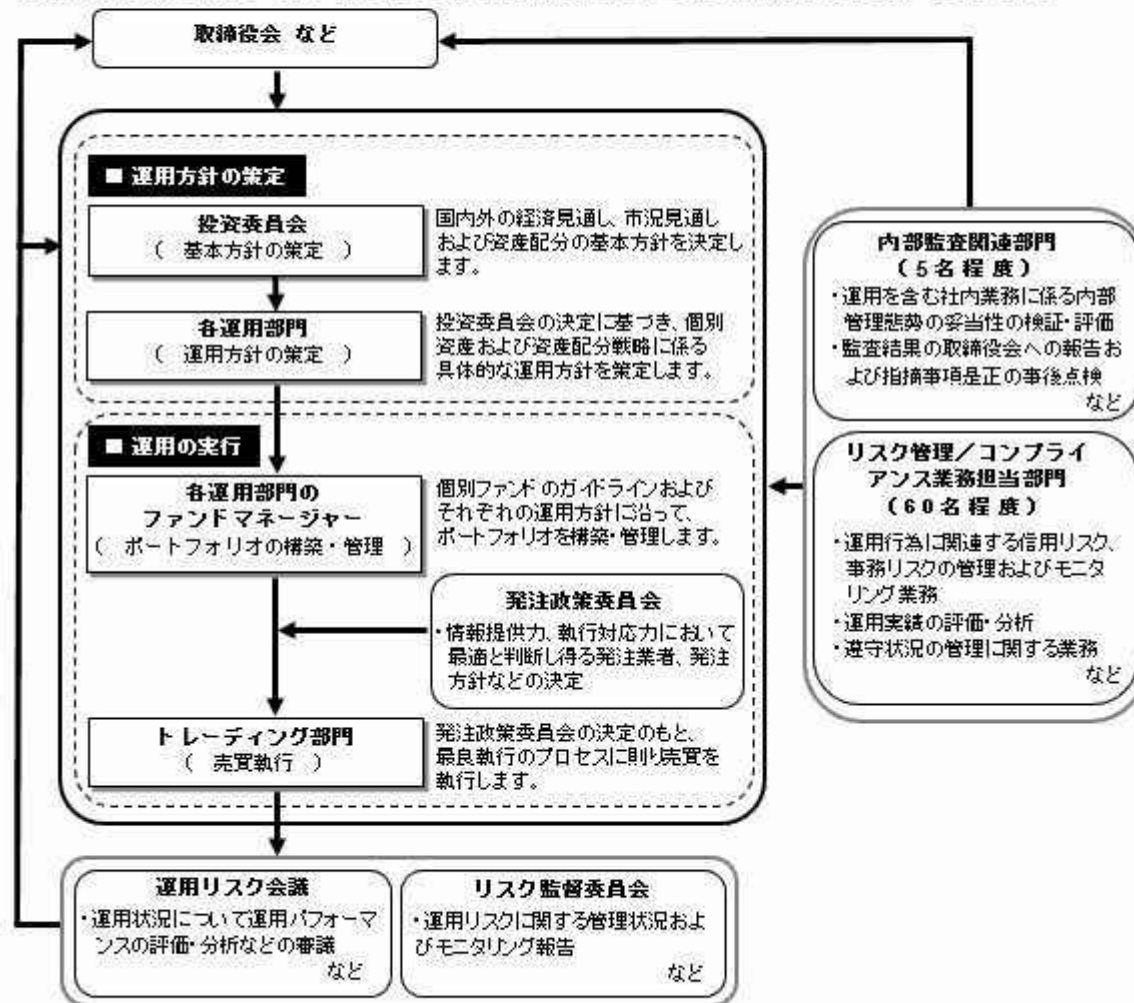
* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、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。

上記体制は2018年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)>

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額

を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - 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。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについ

てはこの限りではありません。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

図をすることができます。

- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
 - 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指

図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様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、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

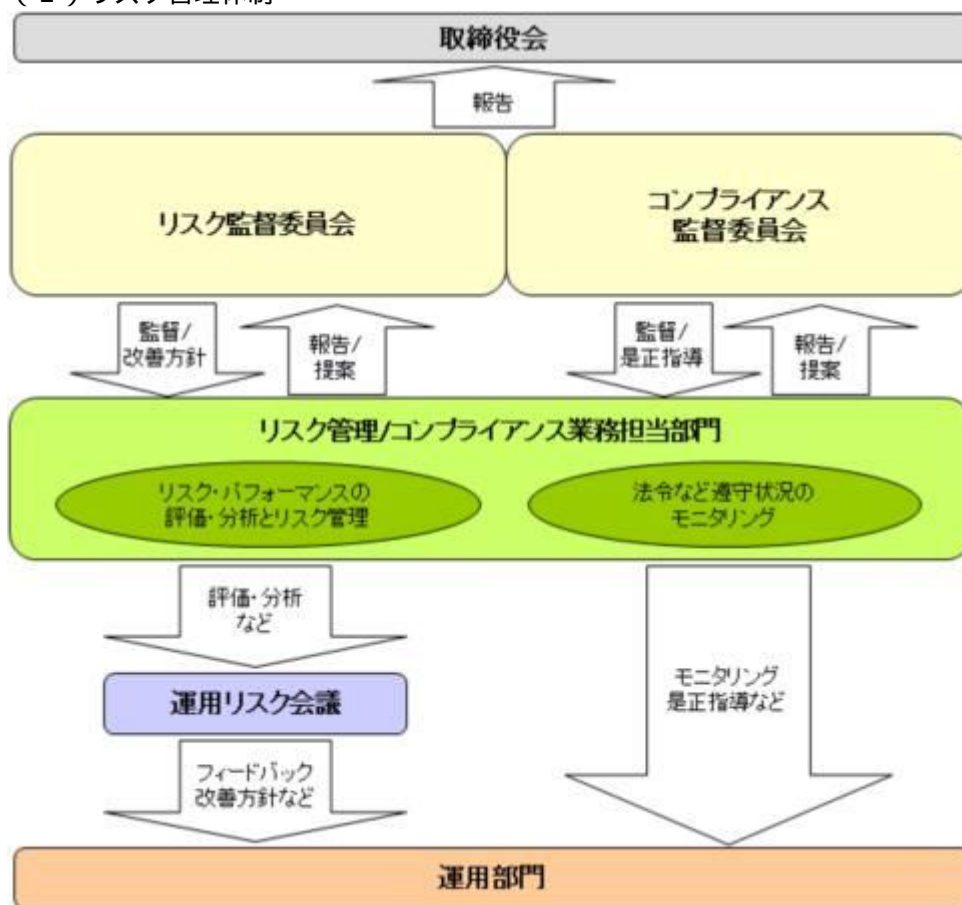
・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量

に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社的リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

などのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2018年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.9%	14.5%	15.4%	9.7%	2.1%	4.8%	2.2%
最大値	12.3%	64.2%	57.1%	37.2%	9.3%	26.6%	19.3%
最小値	-1.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2013年11月から2018年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。な

お、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%(税抜1%)が上限となっております。
- ・申込手数料の額(1口当たり)は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額(1口当たり)が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことです。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.5778%(税抜0.535%)の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.535%	0.200%	0.300%	0.035%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

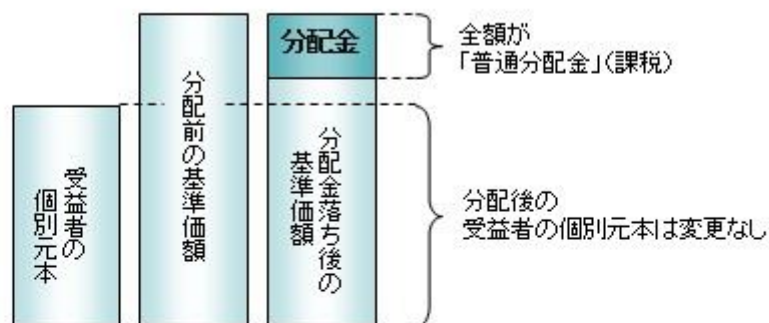
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

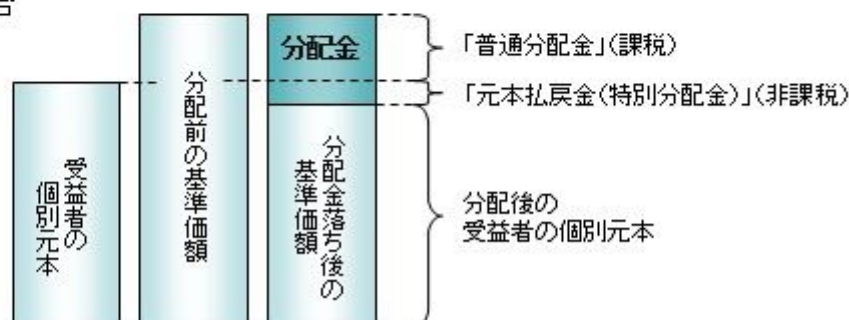
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年1月25日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めし

ます。

5【運用状況】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	600,975,160	95.05
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		31,280,507	4.95
合計（純資産総額）		632,255,667	100.00

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	294,798,301	1.3870	408,885,244	1.3859	408,560,965	64.62
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	65,567,252	1.4419	94,542,967	1.4877	97,544,400	15.43
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	14,155,837	2.2220	31,454,275	2.2372	31,669,438	5.01
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	21,502,199	1.4628	31,453,417	1.4655	31,511,472	4.98
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	6,648,070	2.3875	15,872,787	2.3928	15,907,501	2.52
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	10,074,939	1.5722	15,840,218	1.5664	15,781,384	2.50

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.05
合計	95.05

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第10計算期間末 (2009年10月26日)	1,756	1,757	1.0701	1.0711
第11計算期間末 (2010年10月26日)	1,652	1,653	1.0808	1.0818
第12計算期間末 (2011年10月26日)	1,439	1,441	1.0725	1.0735
第13計算期間末 (2012年10月26日)	1,306	1,307	1.1024	1.1034
第14計算期間末 (2013年10月28日)	1,169	1,170	1.2376	1.2386
第15計算期間末 (2014年10月27日)	904	905	1.2811	1.2821
第16計算期間末 (2015年10月26日)	826	826	1.3568	1.3578
第17計算期間末 (2016年10月26日)	790	790	1.3674	1.3684
第18計算期間末 (2017年10月26日)	685	685	1.4227	1.4237
第19計算期間末 (2018年10月26日)	628	629	1.4004	1.4014
2017年10月末日	679		1.4249	
11月末日	678		1.4306	
12月末日	679		1.4364	
2018年 1月末日	676		1.4358	
2月末日	671		1.4267	
3月末日	664		1.4218	
4月末日	667		1.4306	
5月末日	667		1.4274	
6月末日	672		1.4269	
7月末日	657		1.4301	
8月末日	650		1.4239	
9月末日	647		1.4349	
10月末日	632		1.4068	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	0.0010
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0010
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0010
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0010
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010

第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	7.77
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	1.09
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.68
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	2.88
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	12.35
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	3.60
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	5.99
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.85
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	4.12
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	1.50

(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10期	2008年10月28日～2009年10月26日	162,320,929	451,875,313
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	122,706,122	234,789,317
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	104,192,222	290,787,664
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	88,377,373	245,959,829
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	73,686,839	313,556,535
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	61,382,137	299,877,161
第16期	2014年10月28日～2015年10月26日	63,927,604	161,267,120
第17期	2015年10月27日～2016年10月26日	56,115,106	87,093,703
第18期	2016年10月27日～2017年10月26日	40,721,179	137,136,363
第19期	2017年10月27日～2018年10月26日	44,217,907	76,930,556

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,614,101,830	98.24
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		512,440,188	1.76
合計（純資産総額）		29,126,542,018	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	410,250,000	1.41

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	136,800	6,533.05	893,721,240	6,615.00	904,932,000	3.11
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	843,100	653.13	550,662,110	684.80	577,354,880	1.98
日本	株式	ソニー	電気機器	82,300	5,833.96	480,135,400	6,140.00	505,322,000	1.73
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	50,300	8,627.09	433,942,627	9,048.00	455,114,400	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	82,400	4,889.41	402,887,384	4,750.00	391,400,000	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	85,300	4,247.76	362,333,928	4,414.00	376,514,200	1.29
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	103,500	2,977.56	308,177,460	3,241.00	335,443,500	1.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,000	51,537.48	309,224,900	55,300.00	331,800,000	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,645,000	188.60	310,252,250	194.00	319,130,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	106,100	2,834.91	300,784,600	2,814.50	298,618,450	1.03
日本	株式	三菱商事	卸売業	84,800	3,157.24	267,734,000	3,180.00	269,664,000	0.93
日本	株式	任天堂	その他製品	7,600	34,814.73	264,592,000	35,160.00	267,216,000	0.92
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	84,000	2,845.20	238,996,800	3,037.00	255,108,000	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	50,700	4,767.28	241,701,600	4,893.00	248,075,100	0.85
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	86,500	2,885.28	249,577,300	2,844.50	246,049,250	0.84
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,000	21,077.23	231,849,600	21,650.00	238,150,000	0.82
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	43,900	5,152.79	226,207,481	5,346.00	234,689,400	0.81

日本	株式	ファナック	電気機器	11,700	17,693.84	207,018,000	19,735.00	230,899,500	0.79
日本	株式	花王	化学	29,800	7,260.82	216,372,436	7,531.00	224,423,800	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,900	15,573.83	200,902,500	17,165.00	221,428,500	0.76
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	48,400	4,372.93	211,650,000	4,570.00	221,188,000	0.76
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,700	12,635.87	211,019,100	13,125.00	219,187,500	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	21,800	9,528.81	207,728,100	9,875.00	215,275,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	14,800	13,719.95	203,055,400	14,490.00	214,452,000	0.74
日本	株式	キヤノン	電気機器	66,100	3,205.96	211,914,500	3,222.00	212,974,200	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	71,100	2,908.08	206,764,600	2,906.50	206,652,150	0.71
日本	株式	信越化学工業	化学	21,200	8,469.54	179,554,400	9,469.00	200,742,800	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	113,200	1,744.13	197,435,516	1,747.00	197,760,400	0.68
日本	株式	日立製作所	電気機器	55,200	3,255.82	179,721,264	3,462.00	191,102,400	0.66
日本	株式	三井物産	卸売業	99,600	1,847.10	183,971,200	1,885.50	187,795,800	0.64

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	0.12
		鉱業	0.33
		建設業	2.88
		食料品	4.22
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.31
		化学	6.99
		医薬品	4.98
		石油・石炭製品	0.88
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.87
		鉄鋼	1.01
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.59
		機械	4.91
		電気機器	12.86
		輸送用機器	7.98
		精密機器	1.79
		その他製品	2.03
		電気・ガス業	1.81
		陸運業	4.36
		海運業	0.17
		空運業	0.57
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.53		
卸売業	5.03		
小売業	5.10		

	銀行業	6.91
	証券、商品先物取引業	0.98
	保険業	2.44
	その他金融業	1.21
	不動産業	2.32
	サービス業	4.66
合 計		98.24

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 2018年12月	買建	25	日本円	401,511,480	410,250,000	1.41

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

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

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
出資金	アメリカ	7,992,268	0.01
株式	アメリカ	57,262,520,375	62.62
	カナダ	3,292,176,824	3.60
	モーリシャス	2,657,200	0.00
	ドイツ	3,022,068,213	3.30
	イタリア	629,211,112	0.69
	フランス	3,315,524,881	3.63
	オランダ	1,494,498,221	1.63
	スペイン	1,008,160,219	1.10
	ベルギー	328,829,425	0.36
	オーストリア	79,457,920	0.09
	ルクセンブルク	108,780,506	0.12
	フィンランド	410,712,368	0.45
	アイルランド	1,328,599,139	1.45
	ポルトガル	50,468,794	0.06
イギリス	5,484,053,638	6.00	

	スイス	3,174,190,743	3.47
	スウェーデン	798,373,904	0.87
	ノルウェー	253,809,792	0.28
	デンマーク	561,432,833	0.61
	ケイマン	202,221,478	0.22
	オーストラリア	2,082,885,796	2.28
	バミューダ	208,651,746	0.23
	ニュージーランド	65,352,533	0.07
	香港	862,909,693	0.94
	シンガポール	388,515,592	0.42
	イスラエル	168,274,245	0.18
	ジャージー	400,058,564	0.44
	英ヴァージン諸島	21,601,910	0.02
	アラブ首長国連邦	10,238,082	0.01
	マン島	14,776,371	0.02
	小計	87,031,012,117	95.17
投資証券	アメリカ	1,770,726,141	1.94
	カナダ	18,326,150	0.02
	フランス	116,630,871	0.13
	イギリス	64,687,443	0.07
	オーストラリア	185,824,416	0.20
	香港	53,617,886	0.06
	シンガポール	34,698,191	0.04
	小計	2,244,511,098	2.45
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,167,153,338	2.37
合計（純資産総額）		91,450,668,821	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,748,788,198	1.91
	買建	ドイツ	426,394,021	0.47

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,967,531,000	2.15

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	111,092	24,894.54	2,765,585,126	24,158.35	2,683,800,307	2.93
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	165,024	12,266.05	2,024,193,955	11,748.45	1,938,777,830	2.12
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	9,325	201,848.57	1,882,237,955	173,335.36	1,616,352,318	1.77
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	60,561	15,683.11	949,784,958	15,941.34	965,423,795	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	76,900	11,876.44	913,298,513	12,084.84	929,324,350	1.02
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	54,280	17,096.59	928,003,285	16,560.87	898,924,414	0.98
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	95,671	8,869.39	848,543,468	8,922.62	853,636,246	0.93
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	7,112	124,084.25	882,487,244	117,361.14	834,672,460	0.91
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,760	124,992.60	844,949,999	118,867.50	803,544,318	0.88
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	70,413	9,465.42	666,488,984	9,496.96	668,709,557	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	28,780	22,876.25	658,378,613	23,031.42	662,844,296	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	217,479	3,011.58	654,956,146	3,033.10	659,636,164	0.72
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	132,030	4,916.61	649,140,889	4,857.72	641,364,956	0.70
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	21,740	29,927.82	650,630,859	29,252.79	635,955,715	0.70
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	104,500	5,873.66	613,797,846	5,967.66	623,621,452	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	93,107	6,391.26	595,071,212	6,589.46	613,525,485	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	40,362	15,915.29	642,373,145	15,036.39	606,899,080	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	56,949	10,080.14	574,053,893	10,101.65	575,279,401	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	105,412	5,018.55	529,015,456	5,409.29	570,204,879	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	163,807	3,395.53	556,212,369	3,451.03	565,303,232	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	43,131	12,637.55	545,070,203	12,554.87	541,504,141	0.59
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	106,140	5,149.93	546,613,804	5,049.13	535,914,743	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	26,090	20,281.46	529,143,505	19,960.94	520,780,987	0.57
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,703	7,923.66	480,990,516	8,253.25	500,997,411	0.55
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	12,502	41,200.59	515,089,779	39,630.80	495,464,344	0.54

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	91,212	5,267.72	480,479,513	5,394.57	492,049,865	0.54
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	49,113	9,611.84	472,066,505	9,796.55	481,138,324	0.53
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	104,174	4,059.23	422,867,101	4,271.03	444,930,758	0.49
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	20,920	23,127.69	483,831,317	21,262.29	444,807,312	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	33,703	12,929.76	435,771,755	12,997.71	438,062,076	0.48

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 (%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	6.63
		素材	4.34
		資本財	6.77
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.99
		自動車・自動車部品	1.23
		耐久消費財・アパレル	1.71
		消費者サービス	1.75
		メディア・娯楽	2.03
		小売	4.73
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	4.97
		家庭用品・パーソナル用品	1.94
		ヘルスケア機器・サービス	4.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.40
		銀行	8.37
		各種金融	4.20
		保険	3.74
		不動産	0.51
		ソフトウェア・サービス	11.22
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.65		
電気通信サービス	2.42		
公益事業	3.19		
半導体・半導体製造装置	2.78		
投資証券			2.45
合計			97.63

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1812	買建	115	米ドル	15,401,050	1,744,322,922	15,440,475	1,748,788,198	1.91
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1812	買建	115	ユーロ	3,313,880	425,601,608	3,320,050	426,394,021	0.47

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	14,350,000.00	1,609,929,375	1,620,714,000	1.77
	ユーロ	買建	2,700,000.00	345,353,360	346,817,000	0.38

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	4,167,091,843	61.24
	カナダ	244,478,552	3.59
	ドイツ	216,204,711	3.18
	イタリア	46,339,442	0.68
	フランス	240,190,618	3.53
	オランダ	113,130,275	1.66
	スペイン	75,582,040	1.11
	ベルギー	26,268,261	0.39
	オーストリア	4,316,916	0.06
	ルクセンブルク	3,373,002	0.05
	フィンランド	29,327,720	0.43
	アイルランド	96,981,159	1.43
	ポルトガル	2,492,763	0.04
	イギリス	404,187,646	5.94
	スイス	231,366,180	3.40
スウェーデン	57,659,019	0.85	
ノルウェー	18,164,142	0.27	

	デンマーク	39,765,705	0.58
	ケイマン	13,648,755	0.20
	オーストラリア	150,824,225	2.22
	バミューダ	11,625,266	0.17
	ニュージーランド	2,068,922	0.03
	香港	61,284,526	0.90
	シンガポール	30,126,560	0.44
	イスラエル	12,915,538	0.19
	ジャージー	32,268,759	0.47
	英ヴァージン諸島	1,968,312	0.03
	小計	6,333,650,857	93.08
投資証券	アメリカ	131,157,438	1.93
	フランス	7,842,110	0.12
	イギリス	6,103,492	0.09
	オーストラリア	16,002,885	0.24
	香港	3,713,689	0.05
	小計	164,819,614	2.42
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		305,708,760	4.49
合計（純資産総額）		6,804,179,231	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	288,930,224	4.25
	買建	ドイツ	70,447,707	1.04

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		6,571,579,530	96.58

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,095	24,894.54	201,521,366	24,158.35	195,561,908	2.87

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	12,015	12,266.05	147,376,686	11,748.45	141,157,744	2.07
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	682	201,848.57	137,660,728	173,335.36	118,214,722	1.74
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	4,369	15,683.11	68,519,517	15,941.34	69,647,736	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	5,553	11,876.44	65,949,892	12,084.84	67,107,128	0.99
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	3,984	17,096.59	68,112,843	16,560.87	65,978,535	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	6,894	8,869.39	61,145,579	8,922.62	61,512,562	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	522	124,084.25	64,771,982	117,361.14	61,262,517	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	497	124,992.60	62,121,324	118,867.50	59,077,149	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	5,152	9,465.42	48,765,870	9,496.96	48,928,346	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	2,076	22,876.25	47,491,105	23,031.42	47,813,230	0.70
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	15,664	3,011.58	47,173,442	3,033.10	47,510,522	0.70
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,542	4,916.61	46,914,356	4,857.72	46,352,378	0.68
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,570	29,927.82	46,986,681	29,252.79	45,926,885	0.67
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	7,517	5,873.66	44,152,329	5,967.66	44,858,971	0.66
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	2,936	15,915.29	46,727,306	15,036.39	44,146,863	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	6,686	6,391.26	42,731,976	6,589.46	44,057,175	0.65
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	7,666	5,018.55	38,472,208	5,409.29	41,467,675	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	4,065	10,080.13	40,975,769	10,101.65	41,063,245	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	11,767	3,395.53	39,955,258	3,451.03	40,608,296	0.60
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7,852	5,149.93	40,437,268	5,049.13	39,645,775	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	3,097	12,637.55	39,138,494	12,554.87	38,882,435	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,891	20,281.46	38,352,256	19,960.94	37,746,142	0.55
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	921	41,200.59	37,945,744	39,630.80	36,499,973	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,411	7,923.66	34,951,306	8,253.25	36,405,113	0.54
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,645	9,611.84	35,035,172	9,796.55	35,708,452	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	6,523	5,267.72	34,361,355	5,394.57	35,188,805	0.52

アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	1,540	23,127.69	35,616,646	21,262.30	32,743,942	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	7,614	4,059.23	30,907,041	4,271.03	32,519,657	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,183	26,372.31	31,198,448	27,053.72	32,004,558	0.47

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	6.51
		素材	4.27
		資本財	6.70
		商業・専門サービス	1.04
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	1.20
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	1.75
		メディア・娯楽	1.95
		小売	4.65
		食品・生活必需品小売り	1.55
		食品・飲料・タバコ	4.82
		家庭用品・パーソナル用品	1.90
		ヘルスケア機器・サービス	4.85
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.22
		銀行	8.29
		各種金融	4.23
		保険	3.63
		不動産	0.49
		ソフトウェア・サービス	10.96
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.53		
電気通信サービス	2.35		
公益事業	3.01		
半導体・半導体製造装置	2.77		
投資証券			2.42
合計			95.51

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1812	買建	19	米ドル	2,549,220	288,724,657	2,551,035	288,930,224	4.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1812	買建	19	ユーロ	548,590	70,455,413	548,530	70,447,707	1.04

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	39,892,000.00	4,467,234,462	4,498,828,480	66.12
	加ドル	売建	2,798,000.00	239,748,072	241,067,530	3.54
	ユーロ	売建	6,113,000.00	781,617,186	785,205,800	11.54
	英ポンド	売建	2,987,000.00	429,932,906	428,994,140	6.30
	スイスフラン	売建	1,909,000.00	214,771,263	215,179,890	3.16
	スウェーデンクローナ	売建	5,071,000.00	62,576,180	62,594,410	0.92
	ノルウェークローネ	売建	1,358,000.00	18,247,400	18,234,980	0.27
	デンマーククローネ	売建	2,319,000.00	39,746,169	39,929,540	0.59
	豪ドル	売建	2,111,000.00	167,316,258	168,731,360	2.48
	ニュージーランドドル	売建	30,000.00	2,186,740	2,214,040	0.03
	香港ドル	売建	5,250,000.00	74,990,090	75,492,820	1.11
	シンガポールドル	売建	362,000.00	29,370,510	29,491,850	0.43
	イスラエルシケル	売建	184,000.00	5,591,440	5,614,690	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	30,033,031,825	78.20
地方債証券	日本	2,791,471,000	7.27
特殊債券	日本	3,105,779,000	8.09
社債券	日本	2,255,853,000	5.87
	オーストラリア	100,326,000	0.26
	小計	2,356,179,000	6.14
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		117,635,841	0.31
合計(純資産総額)		38,404,096,666	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,000,000,000	102.32	1,023,250,000	102.24	1,022,490,000	0.300	2025/12/20	2.66
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	100.65	613,965,000	100.56	613,464,800	0.100	2026/12/20	1.60
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.38	562,161,600	100.38	562,150,400	0.100	2020/6/20	1.46
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	450,000,000	118.75	534,379,500	118.50	533,263,500	1.700	2032/9/20	1.39
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.33	506,686,700	100.33	506,676,600	0.100	2020/3/20	1.32
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.28	506,076,900	103.27	506,052,400	0.500	2024/9/20	1.32
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.54	492,660,700	100.50	492,454,900	0.100	2027/3/20	1.28
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	490,000,000	100.27	491,332,800	100.22	491,107,400	0.100	2027/12/20	1.28
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	101.64	480,761,930	101.63	480,709,900	1.300	2019/12/20	1.25
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	480,000,000	100.13	480,667,200	100.09	480,446,400	0.100	2028/3/20	1.25
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	100.04	435,204,450	99.95	434,791,200	0.100	2028/6/20	1.13
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	102.97	432,474,000	102.93	432,310,200	0.400	2025/9/20	1.13
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	102.85	401,118,900	102.81	400,974,600	0.400	2025/3/20	1.04
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	103.42	382,676,200	103.40	382,587,400	1.300	2021/3/20	1.00
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	102.89	380,711,500	102.85	380,570,900	0.400	2025/6/20	0.99
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	132.93	366,897,840	132.68	366,207,840	2.400	2038/9/20	0.95
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.57	352,722,000	117.46	352,395,000	2.300	2026/6/20	0.92
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	120.96	350,795,600	120.81	350,375,100	2.100	2029/9/20	0.91
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	331,000,000	101.34	335,459,857	101.34	335,459,857	1.400	2019/9/20	0.87
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.28	330,937,818	100.28	330,937,818	0.200	2019/9/20	0.86
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.44	326,449,500	100.44	326,443,000	0.100	2020/9/20	0.85
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	106.23	313,405,050	106.22	313,369,650	1.400	2022/12/20	0.82
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.27	300,822,000	100.27	300,816,000	0.100	2019/12/20	0.78
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	118.06	295,152,500	117.94	294,872,500	2.300	2026/9/20	0.77
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	235,000,000	121.08	284,540,350	120.81	283,912,900	1.700	2044/6/20	0.74
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	97.92	279,077,700	97.67	278,359,500	0.500	2038/3/20	0.72

日本	国債証券	第14回利付国債 (30年)	208,000,000	129.84	270,067,200	129.54	269,445,280	2.400	2034/3/20	0.70
日本	国債証券	第34回利付国債 (30年)	200,000,000	130.67	261,354,000	130.41	260,824,000	2.200	2041/3/20	0.68
日本	国債証券	第149回利付国債 (20年)	215,000,000	116.44	250,365,350	116.18	249,795,600	1.500	2034/6/20	0.65
日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	104.87	248,556,120	104.84	248,485,020	1.900	2021/3/22	0.65

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.20
地方債証券	7.27
特殊債券	8.09
社債券	6.14
合計	99.69

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	66,580,945,824	44.94
	カナダ	2,986,383,551	2.02
	メキシコ	1,173,162,758	0.79
	ドイツ	10,257,018,951	6.92
	イタリア	12,839,763,980	8.67
	フランス	15,361,417,281	10.37
	オランダ	3,048,895,083	2.06
	スペイン	8,636,416,395	5.83
	ベルギー	3,638,155,767	2.46
	オーストリア	2,240,366,303	1.51
	フィンランド	909,609,644	0.61
	アイルランド	1,176,505,360	0.79

	イギリス	9,637,726,214	6.51
	スウェーデン	542,057,083	0.37
	ノルウェー	351,986,554	0.24
	デンマーク	897,940,386	0.61
	ポーランド	911,899,399	0.62
	オーストラリア	3,130,398,023	2.11
	シンガポール	607,139,324	0.41
	マレーシア	718,833,837	0.49
	南アフリカ	803,492,207	0.54
	小計	146,450,113,924	98.85
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,703,667,210	1.15
合計（純資産総額）		148,153,781,134	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		113,250,000	0.08
	売建		33,972,000	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	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,250,000	11,086.64	1,358,114,337	11,095.49	1,359,197,923	2.125	2021/8/15	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	13,003.66	1,202,838,896	13,004.98	1,202,961,472	8.000	2021/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,530,000	11,402.75	1,200,710,238	11,402.31	1,200,663,726	3.375	2019/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	10,462.16	1,150,838,258	10,483.18	1,153,150,574	1.250	2023/7/31	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,894.19	1,056,737,036	10,907.02	1,057,981,775	1.875	2022/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,070,000	11,446.11	923,701,257	11,447.22	923,790,830	3.625	2020/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,444.57	896,109,979	11,444.78	896,126,829	3.500	2020/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,739.34	875,256,795	10,760.80	877,006,011	1.750	2023/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,231.32	836,733,784	11,232.86	836,848,539	1.750	2019/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,099.25	671,504,835	11,108.99	672,094,127	2.125	2021/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	10,546.89	643,360,643	10,572.56	644,926,191	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	10,836.68	642,615,292	10,858.36	643,900,795	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,031.78	639,843,501	11,052.13	641,023,965	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,740.23	637,969,698	10,764.12	639,389,231	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,885.79	631,375,956	10,902.82	632,363,946	2.000	2023/2/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	15,588.87	612,642,667	15,601.18	613,126,703	4.250	2023/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	11,865.97	607,538,093	11,846.06	606,518,644	3.625	2043/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,440.71	605,561,443	10,423.01	604,534,696	2.875	2043/5/15	0.41

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,492.00	600,865,218	12,487.35	600,641,858	8.750	2020/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,163.18	599,463,236	11,165.83	599,605,556	2.000	2020/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,127.56	589,761,129	11,135.98	590,207,136	2.250	2021/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,086.43	587,580,919	11,104.79	588,553,970	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	11,281.76	584,395,202	11,283.08	584,463,844	2.625	2020/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,145.93	568,442,901	11,147.70	568,533,011	1.000	2019/10/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	20,801.69	565,806,009	20,843.31	566,938,186	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,093.51	565,769,071	11,096.38	565,915,788	1.500	2020/5/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,178.89	558,944,896	11,180.22	559,011,153	1.500	2019/11/30	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,920,000	14,238.54	558,151,005	14,238.62	558,154,026	3.250	2021/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,960,000	13,994.02	554,163,212	14,018.57	555,135,581	6.125	2027/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	10,588.92	552,741,967	10,611.48	553,919,672	2.000	2025/8/15	0.37

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.85
合計	98.85

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	1,000,000.00	112,510,000	113,250,000	0.08
	米ドル	売建	300,000.00	33,973,500	33,972,000	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。

海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

以下の運用状況は2018年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	10,970,414,871	44.45
	カナダ	469,061,487	1.90
	メキシコ	190,701,354	0.77
	ドイツ	1,675,161,221	6.79
	イタリア	2,122,775,882	8.60
	フランス	2,498,446,695	10.12

	オランダ	489,317,989	1.98
	スペイン	1,384,579,011	5.61
	ベルギー	604,290,201	2.45
	オーストリア	379,270,125	1.54
	フィンランド	133,592,350	0.54
	アイルランド	204,891,572	0.83
	イギリス	1,634,979,509	6.62
	スウェーデン	146,765,976	0.59
	ノルウェー	72,441,432	0.29
	デンマーク	156,776,060	0.64
	ポーランド	112,594,392	0.46
	オーストラリア	511,475,740	2.07
	シンガポール	79,841,979	0.32
	マレーシア	199,974,059	0.81
	南アフリカ	130,029,788	0.53
	小計	24,167,381,693	97.92
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		513,347,848	2.08
合計（純資産総額）		24,680,729,541	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		24,464,418,050	99.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,300,000	10,443.80	449,083,681	10,468.14	450,130,283	2.000	2026/11/15	1.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,015.20	352,486,503	11,021.38	352,684,391	1.375	2020/9/30	1.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	10,546.89	337,500,665	10,572.56	338,321,936	2.250	2027/11/15	1.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,836.68	325,100,485	10,858.36	325,750,824	2.250	2024/11/15	1.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,830,000	10,935.34	309,470,225	10,957.90	310,108,712	2.375	2024/8/15	1.26
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	10,889.99	294,029,846	10,901.04	294,328,309	1.750	2022/3/31	1.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,600,000	11,118.50	289,081,199	11,120.04	289,121,248	1.375	2020/2/29	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,450,000	11,390.15	279,058,687	11,396.11	279,204,922	3.125	2021/5/15	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	11,133.54	278,338,715	11,135.75	278,393,929	1.375	2020/1/31	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,550,000	10,787.13	275,071,855	10,801.73	275,444,135	1.625	2022/8/15	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,420,000	11,086.64	268,296,873	11,095.49	268,510,937	2.125	2021/8/15	1.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,093.51	266,244,269	11,096.38	266,313,312	1.500	2020/5/31	1.08

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	10,870.96	255,467,716	10,883.79	255,769,276	1.750	2022/5/15	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	10,218.62	245,246,952	10,245.82	245,899,873	1.625	2026/5/15	1.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	9,650.32	231,607,911	9,631.97	231,167,284	2.500	2045/2/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,995.73	225,412,543	11,006.78	225,639,154	2.000	2022/2/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,138.41	222,768,376	11,145.48	222,909,724	2.125	2021/1/31	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,050,000	10,739.34	220,156,617	10,760.80	220,596,604	1.750	2023/5/15	0.89
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000	13,402.68	211,762,425	13,424.95	212,114,287	3.750	2021/8/1	0.86
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000	14,094.44	211,416,695	14,101.39	211,520,935	2.250	2022/10/25	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	10,703.95	203,375,115	10,725.18	203,778,604	2.125	2025/5/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	11,213.84	201,849,299	11,214.94	201,869,074	1.875	2019/12/31	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,780,000	11,190.62	199,193,042	11,210.97	199,555,322	2.750	2024/2/15	0.81
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,010,000	18,949.06	191,385,602	18,999.88	191,898,790	4.000	2038/10/25	0.78
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000	15,552.93	186,635,246	15,560.43	186,725,250	4.800	2024/1/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	13,994.02	186,120,473	14,018.57	186,447,051	6.125	2027/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,862.56	184,663,566	10,878.27	184,930,622	1.875	2022/10/31	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,509.37	184,150,068	11,514.91	184,238,683	3.625	2021/2/15	0.75
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,150,000	15,588.87	179,272,027	15,601.18	179,413,666	4.250	2023/10/25	0.73
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,250,000	13,937.76	174,222,037	13,982.12	174,776,534	4.500	2026/3/1	0.71

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.92
合計	97.92

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	97,713,000.00	10,947,354,670	11,021,203,630	44.66
	加ドル	売建	5,503,000.00	472,055,040	474,669,850	1.92
	メキシコペソ	売建	34,901,000.00	199,106,660	194,569,530	0.79
	ユーロ	売建	75,198,000.00	9,616,065,477	9,659,213,090	39.14
	英ポンド	売建	11,471,000.00	1,651,831,291	1,648,251,640	6.68
	スウェーデンクローナ	売建	12,113,000.00	149,474,311	149,490,800	0.61
	ノルウェークローネ	売建	5,455,000.00	73,301,634	73,247,360	0.30
	デンマーククローネ	売建	9,365,000.00	160,499,540	161,246,040	0.65
	ポーランドズロチ	売建	3,928,000.00	116,105,184	116,072,380	0.47
	豪ドル	売建	6,504,000.00	515,885,601	520,179,940	2.11
	シンガポールドル	売建	996,000.00	80,830,294	81,153,570	0.33

マレーシアリングット	売建	8,657,000.00	232,294,470	233,149,420	0.94
南アフリカランド	売建	17,266,000.00	131,284,040	131,970,800	0.53

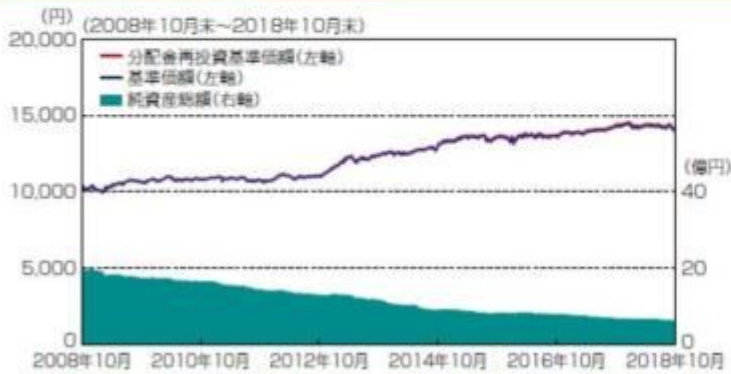
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2018年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額..... 14,068円

純資産総額.....6.32億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2008年10月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年10月	2015年10月	2016年10月	2017年10月	2018年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	150円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15.43%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.52%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.50%
日本債券インデックスマザーファンド	64.62%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.01%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.98%
現金その他	4.95%

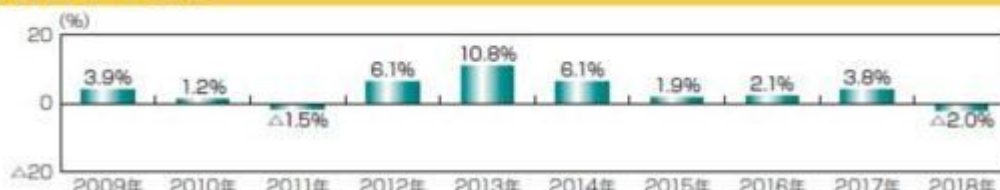
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.11%
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.98%
	3 ソニー	電気機器	1.73%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.93%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.12%
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.77%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.87%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.07%
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.74%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	2.66%
	2 第345回利付国債(10年)	国債証券	1.60%
	3 第124回利付国債(5年)	国債証券	1.46%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.125%)	国債証券	0.92%
	2 US TREASURY N/B(クーポン8.000%)	国債証券	0.81%
	3 US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	国債証券	0.81%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	1.82%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.375%)	国債証券	1.43%
	3 US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	1.37%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2018年は、2018年10月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（３）取扱時間

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

（４）申込金額

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

（５）申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（６）申込代金の支払い

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

（７）受付の中止および取消

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

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

（８）償還乗換

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

（９）乗換優遇

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

２【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

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

（３）解約制限

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

（４）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前９時～午後５時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。
 税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
 詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

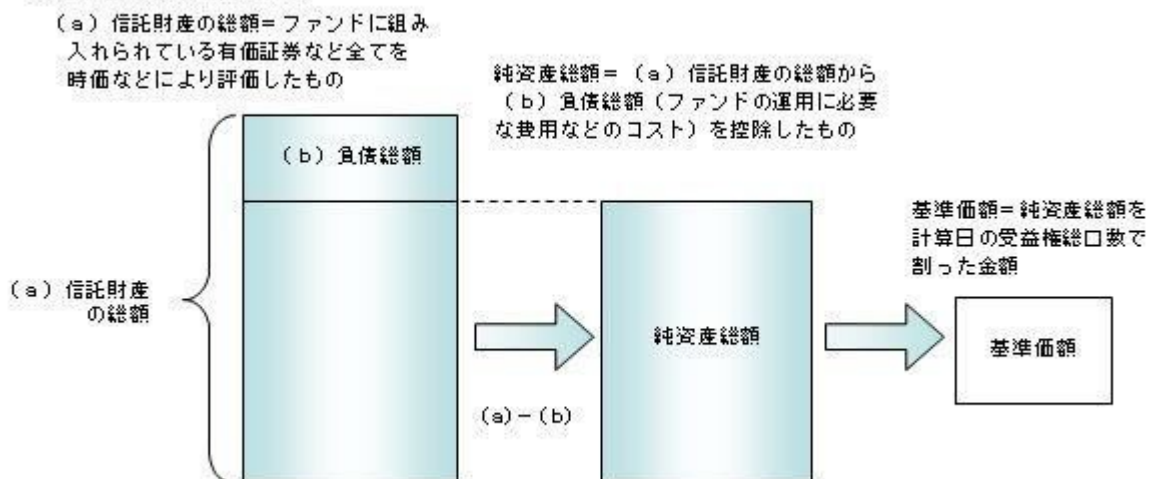
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

す。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

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

（4）【計算期間】

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

（5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

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

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

償還金について

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

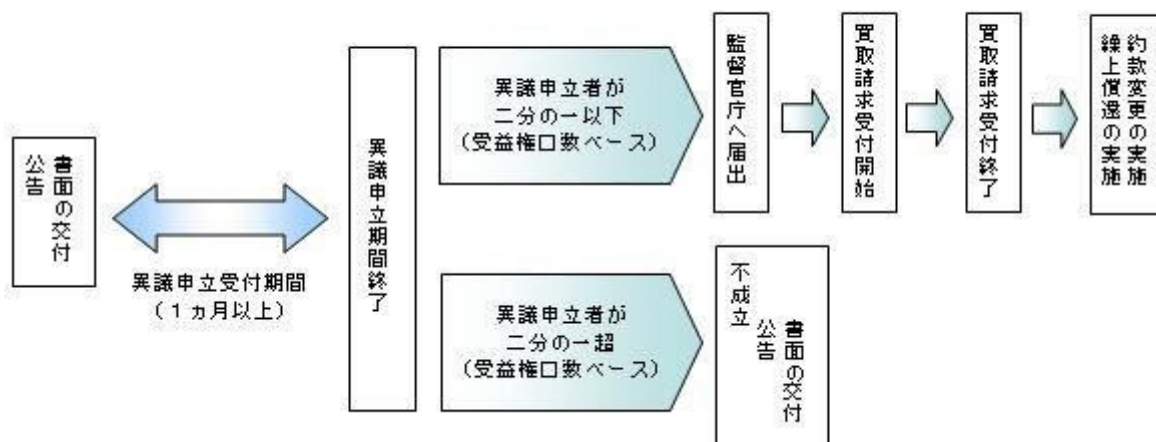
信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・ 委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・ 交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・ 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満

了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間（平成29年10月27日から平成30年10月26日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 平成29年10月26日現在	第19期 平成30年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	6,535,296
コール・ローン	35,806,501	26,840,969
親投資信託受益証券	652,792,773	598,361,290
未収入金	2,548,612	362,099
流動資産合計	691,147,886	632,099,654
資産合計	691,147,886	632,099,654
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	481,613	448,900
未払解約金	3,355,915	1,071,957
未払受託者報酬	135,998	124,657
未払委託者報酬	1,943,701	1,781,631
未払利息	46	42
その他未払費用	18,980	17,392
流動負債合計	5,936,253	3,444,579
負債合計	5,936,253	3,444,579
純資産の部		
元本等		
元本	481,613,210	448,900,561
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	203,598,423	179,754,514
（分配準備積立金）	134,087,258	113,394,227
元本等合計	685,211,633	628,655,075
純資産合計	685,211,633	628,655,075
負債純資産合計	691,147,886	632,099,654

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自	平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
営業収益				
受取利息		9		12
有価証券売買等損益		34,024,059		5,619,801
営業収益合計		34,024,068		5,619,789
営業費用				
支払利息		16,980		15,882
受託者報酬		282,319		251,673
委託者報酬		4,034,856		3,597,017
その他費用		39,410		37,524
営業費用合計		4,373,565		3,902,096
営業利益又は営業損失（ ）		29,650,503		9,521,885
経常利益又は経常損失（ ）		29,650,503		9,521,885
当期純利益又は当期純損失（ ）		29,650,503		9,521,885
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（ ）		3,639,428		432,449
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		212,366,041		203,598,423
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,968,802		18,966,662
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		15,968,802		18,966,662
剰余金減少額又は欠損金増加額		50,265,882		32,407,337
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		50,265,882		32,407,337
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		481,613		448,900
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		203,598,423		179,754,514

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第18期 平成29年10月26日現在	第19期 平成30年10月26日現在
1.	期首元本額	578,028,394円	481,613,210円
	期中追加設定元本額	40,721,179円	44,217,907円
	期中一部解約元本額	137,136,363円	76,930,556円
2.	受益権の総数	481,613,210口	448,900,561口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日		第19期 自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	26,023,845円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	70,734,512円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	108,545,026円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	205,303,383円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,262円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	481,613円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第18期 自 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	第19期 自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第18期 平成29年10月26日現在	第19期 平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第18期（平成29年10月26日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

親投資信託受益証券	26,246,965
合計	26,246,965

第19期(平成30年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,760,184
合計	6,760,184

(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18期 平成29年10月26日現在		第19期 平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4227円	1口当たり純資産額	1.4004円
(1万口当たり純資産額)	(14,227円)	(1万口当たり純資産額)	(14,004円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	6,309,667	15,078,211	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり)マザーファンド	9,640,630	15,166,639	

日本債券インデックスマザーファンド	300,427,344	416,692,726	
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	14,261,162	31,688,301	
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	21,827,881	31,929,824	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60,878,867	87,805,589	
合計	413,345,551	598,361,290	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	40,005,132
コール・ローン	89,667,058	164,304,178
株式	28,617,380,790	27,555,913,710
派生商品評価勘定	9,719,200	-
未収入金	357,201,740	-
未収配当金	222,175,677	255,425,884
前払金	-	33,700,000
流動資産合計	29,296,144,465	28,049,348,904
資産合計	29,296,144,465	28,049,348,904
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	-	34,185,260
前受金	9,030,000	-
未払金	-	149,211,710
未払解約金	258,384,877	428,164
未払利息	117	258
流動負債合計	267,414,994	183,825,392
負債合計	267,414,994	183,825,392
純資産の部		
元本等		
元本	18,714,990,799	19,319,878,842
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,313,738,672	8,545,644,670
元本等合計	29,028,729,471	27,865,523,512
純資産合計	29,028,729,471	27,865,523,512
負債純資産合計	29,296,144,465	28,049,348,904

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
1.	期首	平成28年10月27日	平成29年10月27日
	期首元本額	21,796,501,197円	18,714,990,799円
	期首からの追加設定元本額	1,882,658,720円	2,763,601,529円
	期首からの一部解約元本額	4,964,169,118円	2,158,713,486円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	269,635,550円	391,285,298円
	DCインデックスバランス（株式40）	842,883,256円	1,131,807,591円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,627,372,416円	2,170,432,401円

DCインデックスバランス(株式80)	1,775,199,628円	2,306,839,231円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,238,704,438円	1,494,214,984円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,788,191,495円	3,335,407,317円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	4,709,549円	3,366,097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)	495,308,762円	685,436,046円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	53,522,987円	50,736,936円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	39,926,725円	41,072,726円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	62,121,297円	69,780,983円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	66,909,909円	60,878,867円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	5,209,678,545円	4,374,639,542円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	11,452,612円	1,164,137円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	32,020,517円	1,959,662円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	255,204,494円	259,173,263円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	758,709,319円	743,842,894円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,077,915,630円	1,101,842,051円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,105,523,670円	1,095,998,816円
計	18,714,990,799円	19,319,878,842円
2. 受益権の総数	18,714,990,799口	19,319,878,842口
3. 担保資産		
デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
株式	473,350,000円	412,220,000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 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,910,199,532
合計	5,910,199,532

(平成30年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,675,957,690
合計	2,675,957,690

(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)

(平成29年10月26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	341,670,000	-	351,400,000	9,730,000
合計		341,670,000	-	351,400,000	9,730,000

(平成30年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	338,270,000	-	304,095,000	34,175,000
合計		338,270,000	-	304,095,000	34,175,000

(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）

平成29年10月26日現在		平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5511円	1口当たり純資産額	1.4423円
(1万口当たり純資産額)	(15,511円)	(1万口当たり純資産額)	(14,423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	500	3,070.00	1,535,000	
日本水産	15,400	720.00	11,088,000	
マルハニチロ	2,600	3,910.00	10,166,000	
カネコ種苗	500	1,420.00	710,000	
サカタのタネ	2,000	3,445.00	6,890,000	
ホクト	1,400	1,911.00	2,675,400	
ホクリヨウ	200	736.00	147,200	
住石ホールディングス	3,800	117.00	444,600	
日鉄鉱業	400	4,505.00	1,802,000	
三井松島ホールディングス	700	1,749.00	1,224,300	
国際石油開発帝石	65,800	1,320.50	86,888,900	
石油資源開発	2,200	2,359.00	5,189,800	
K&Oエナジーグループ	800	1,539.00	1,231,200	
ヒノキヤグループ	400	2,567.00	1,026,800	

ショーボンドホールディングス	1,300	7,990.00	10,387,000
ミライト・ホールディングス	4,600	1,804.00	8,298,400
サンヨーホームズ	300	889.00	266,700
日本アクア	400	341.00	136,400
ファーストコーポレーション	500	1,025.00	512,500
ベステラ	300	1,338.00	401,400
T A T E R U	2,000	448.00	896,000
スペースバリューホールディングス	2,000	1,004.00	2,008,000
ダイセキ環境ソリューション	300	834.00	250,200
第一カッター興業	200	2,086.00	417,200
安藤・間	11,100	740.00	8,214,000
東急建設	5,200	989.00	5,142,800
コムシスホールディングス	5,300	3,030.00	16,059,000
ミサワホーム	1,300	823.00	1,069,900
高松コンストラクショングループ	1,000	2,886.00	2,886,000
東建コーポレーション	500	7,290.00	3,645,000
ソネック	200	709.00	141,800
ヤマウラ	700	867.00	606,900
大成建設	13,500	4,585.00	61,897,500
大林組	40,600	969.00	39,341,400
清水建設	41,400	892.00	36,928,800
飛鳥建設	1,300	1,620.00	2,106,000
長谷工コーポレーション	16,100	1,363.00	21,944,300
松井建設	1,500	797.00	1,195,500
銭高組	200	4,995.00	999,000
鹿島建設	30,100	1,418.00	42,681,800
不動テトラ	1,000	1,780.00	1,780,000
大末建設	500	1,167.00	583,500
鉄建建設	800	2,547.00	2,037,600
西松建設	3,100	2,420.00	7,502,000
三井住友建設	9,800	699.00	6,850,200
大豊建設	1,000	3,060.00	3,060,000
前田建設工業	9,700	1,252.00	12,144,400
ナカノフドー建設	1,100	619.00	680,900
奥村組	2,200	3,395.00	7,469,000
東鉄工業	1,600	2,689.00	4,302,400

イチケン	300	2,182.00	654,600	
富士ピー・エス	400	481.00	192,400	
浅沼組	500	3,185.00	1,592,500	
戸田建設	15,700	737.00	11,570,900	
熊谷組	2,100	2,786.00	5,850,600	
青木あすなる建設	900	944.00	849,600	
北野建設	300	3,600.00	1,080,000	
植木組	200	2,335.00	467,000	
矢作建設工業	1,900	792.00	1,504,800	
ピーエス三菱	1,600	591.00	945,600	
日本ハウスホールディングス	2,700	595.00	1,606,500	
大東建託	4,800	14,700.00	70,560,000	
新日本建設	1,600	1,002.00	1,603,200	
N I P P O	3,300	1,804.00	5,953,200	
東亜道路工業	300	3,465.00	1,039,500	
前田道路	4,200	1,997.00	8,387,400	
日本道路	400	6,070.00	2,428,000	
東亜建設工業	1,200	1,996.00	2,395,200	
若築建設	800	1,448.00	1,158,400	
東洋建設	4,700	432.00	2,030,400	
五洋建設	16,100	641.00	10,320,100	
福田組	400	4,330.00	1,732,000	
住友林業	8,800	1,631.00	14,352,800	
日本基礎技術	1,600	353.00	564,800	
巴コーポレーション	1,800	420.00	756,000	
大和ハウス工業	40,000	3,268.00	130,720,000	
ライト工業	2,600	1,488.00	3,868,800	
積水ハウス	44,000	1,606.00	70,664,000	
日特建設	1,200	714.00	856,800	
北陸電気工事	800	976.00	780,800	
ユアテック	2,200	821.00	1,806,200	
四電工	200	2,503.00	500,600	
中電工	1,700	2,324.00	3,950,800	
関電工	5,600	1,052.00	5,891,200	
きんでん	9,000	1,707.00	15,363,000	
東京エネシス	1,500	950.00	1,425,000	

トーエネック	400	3,030.00	1,212,000	
住友電設	1,100	1,609.00	1,769,900	
日本電設工業	2,100	2,154.00	4,523,400	
協和エクシオ	5,300	2,970.00	15,741,000	
新日本空調	1,100	1,767.00	1,943,700	
九電工	2,700	3,755.00	10,138,500	
三機工業	3,100	1,059.00	3,282,900	
日揮	11,700	2,222.00	25,997,400	
中外炉工業	400	2,145.00	858,000	
ヤマト	1,200	620.00	744,000	
太平電業	900	2,571.00	2,313,900	
高砂熱学工業	3,700	1,846.00	6,830,200	
三晃金属工業	200	2,963.00	592,600	
朝日工業社	300	3,190.00	957,000	
明星工業	2,500	793.00	1,982,500	
大気社	1,800	3,100.00	5,580,000	
ダイダン	900	2,526.00	2,273,400	
日比谷総合設備	1,500	1,793.00	2,689,500	
東芝プラントシステム	2,900	2,212.00	6,414,800	
OSJBホールディングス	6,100	283.00	1,726,300	
東洋エンジニアリング	1,600	850.00	1,360,000	
千代田化工建設	9,200	710.00	6,532,000	
新興プランテック	2,600	1,010.00	2,626,000	
日本製粉	4,000	1,806.00	7,224,000	
日清製粉グループ本社	14,800	2,259.00	33,433,200	
日東富士製粉	100	5,140.00	514,000	
昭和産業	1,100	2,755.00	3,030,500	
鳥越製粉	1,100	938.00	1,031,800	
中部飼料	1,500	1,333.00	1,999,500	
フィード・ワン	8,100	183.00	1,482,300	
東洋精糖	200	1,132.00	226,400	
日本甜菜製糖	700	1,884.00	1,318,800	
三井製糖	1,000	3,000.00	3,000,000	
塩水港精糖	1,600	245.00	392,000	
日新製糖	600	2,160.00	1,296,000	
森永製菓	2,900	4,330.00	12,557,000	

中村屋	300	4,430.00	1,329,000	
江崎グリコ	3,400	5,720.00	19,448,000	
名糖産業	600	1,479.00	887,400	
井村屋グループ	500	2,972.00	1,486,000	
不二家	700	2,355.00	1,648,500	
山崎製パン	9,900	1,993.00	19,730,700	
第一屋製パン	300	1,076.00	322,800	
モロゾフ	200	5,400.00	1,080,000	
亀田製菓	700	4,790.00	3,353,000	
寿スピリッツ	1,200	4,155.00	4,986,000	
カルビー	5,500	3,460.00	19,030,000	
森永乳業	2,400	2,846.00	6,830,400	
六甲バター	900	2,313.00	2,081,700	
ヤクルト本社	7,300	7,990.00	58,327,000	
明治ホールディングス	8,300	7,360.00	61,088,000	
雪印メグミルク	2,900	2,589.00	7,508,100	
プリマハム	1,700	2,196.00	3,733,200	
日本ハム	5,200	4,020.00	20,904,000	
林兼産業	500	657.00	328,500	
丸大食品	1,300	1,862.00	2,420,600	
S Foods	900	4,430.00	3,987,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	7,800	699.00	5,452,200	
サッポロホールディングス	4,400	2,131.00	9,376,400	
アサヒグループホールディングス	25,400	4,784.00	121,513,600	
キリンホールディングス	54,800	2,616.50	143,384,200	
宝ホールディングス	9,100	1,568.00	14,268,800	
オエノンホールディングス	3,500	395.00	1,382,500	
養命酒製造	400	2,308.00	923,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,300	2,851.00	26,514,300	
サントリー食品インターナショナル	8,100	4,385.00	35,518,500	
ダイドーグループホールディングス	600	5,450.00	3,270,000	
伊藤園	4,000	4,805.00	19,220,000	
キーコーヒー	1,200	2,006.00	2,407,200	
ユニカフェ	400	1,197.00	478,800	
ジャパンフーズ	200	1,229.00	245,800	

日清オイリオグループ	1,400	3,380.00	4,732,000	
不二製油グループ本社	3,300	3,280.00	10,824,000	
かどや製油	100	5,860.00	586,000	
J - オイルミルズ	600	3,830.00	2,298,000	
キッコーマン	8,700	6,270.00	54,549,000	
味の素	27,900	1,807.00	50,415,300	
キュービー	6,700	2,555.00	17,118,500	
ハウス食品グループ本社	4,600	3,145.00	14,467,000	
カゴメ	4,900	2,977.00	14,587,300	
焼津水産化学工業	600	996.00	597,600	
アリアケジャパン	1,100	9,730.00	10,703,000	
ピエトロ	200	1,634.00	326,800	
エバラ食品工業	300	2,080.00	624,000	
ニチレイ	5,800	2,700.00	15,660,000	
東洋水産	6,600	4,075.00	26,895,000	
イトアンド	400	1,621.00	648,400	
大冷	100	1,870.00	187,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	679.00	203,700	
日清食品ホールディングス	4,800	7,060.00	33,888,000	
永谷園ホールディングス	700	2,778.00	1,944,600	
一正蒲鉾	500	951.00	475,500	
フジッコ	1,300	2,167.00	2,817,100	
ロック・フィールド	1,300	1,619.00	2,104,700	
日本たばこ産業	70,000	2,908.00	203,560,000	
ケンコーマヨネーズ	800	2,306.00	1,844,800	
わらべや日洋ホールディングス	800	1,804.00	1,443,200	
なとり	700	1,733.00	1,213,100	
イフジ産業	200	741.00	148,200	
ピックルスコーポレーション	300	2,133.00	639,900	
北の達人コーポレーション	3,800	556.00	2,112,800	
ユーグレナ	4,800	620.00	2,976,000	
ミヨシ油脂	500	1,204.00	602,000	
理研ビタミン	500	3,760.00	1,880,000	
片倉工業	1,500	1,164.00	1,746,000	
ゲンゼ	900	4,705.00	4,234,500	
東洋紡	4,700	1,589.00	7,468,300	

ユニチカ	3,700	547.00	2,023,900	
富士紡ホールディングス	700	3,200.00	2,240,000	
倉敷紡績	1,300	2,448.00	3,182,400	
シキボウ	600	1,132.00	679,200	
日本毛織	3,900	852.00	3,322,800	
ダイトウボウ	2,800	90.00	252,000	
トーア紡コーポレーション	500	530.00	265,000	
ダイドーリミテッド	1,400	358.00	501,200	
帝国繊維	1,300	2,352.00	3,057,600	
帝人	10,400	1,931.00	20,082,400	
東レ	91,700	787.00	72,167,900	
サカイオーベックス	300	2,094.00	628,200	
住江織物	300	2,579.00	773,700	
日本フェルト	600	472.00	283,200	
イチカワ	200	1,501.00	300,200	
日東製網	100	1,496.00	149,600	
アツギ	900	1,059.00	953,100	
ダイニック	500	820.00	410,000	
セーレン	2,900	1,595.00	4,625,500	
ソトー	500	979.00	489,500	
東海染工	200	1,135.00	227,000	
小松マテーレ	1,900	910.00	1,729,000	
ワコールホールディングス	3,400	3,030.00	10,302,000	
ホギメディカル	1,600	3,320.00	5,312,000	
レナウン	3,500	113.00	395,500	
クラウディアホールディングス	300	501.00	150,300	
T S Iホールディングス	4,400	736.00	3,238,400	
マツオカコーポレーション	300	3,080.00	924,000	
三陽商会	700	1,871.00	1,309,700	
ナイガイ	500	490.00	245,000	
オンワードホールディングス	7,300	646.00	4,715,800	
ルックホールディングス	400	1,093.00	437,200	
キムラタン	6,300	31.00	195,300	
ゴールドウイン	700	8,230.00	5,761,000	
デサント	2,900	2,554.00	7,406,600	
キング	600	447.00	268,200	

ヤマトインターナショナル	800	446.00	356,800	
特種東海製紙	700	4,205.00	2,943,500	
王子ホールディングス	53,200	751.00	39,953,200	
日本製紙	5,700	1,926.00	10,978,200	
三菱製紙	1,800	564.00	1,015,200	
北越コーポレーション	7,000	524.00	3,668,000	
中越パルプ工業	500	1,469.00	734,500	
巴川製紙所	400	1,194.00	477,600	
大王製紙	5,200	1,440.00	7,488,000	
阿波製紙	300	556.00	166,800	
レンゴー	12,200	933.00	11,382,600	
トモク	700	1,900.00	1,330,000	
ザ・バック	900	3,110.00	2,799,000	
クラレ	20,000	1,511.00	30,220,000	
旭化成	80,600	1,315.50	106,029,300	
共和レザー	700	871.00	609,700	
昭和電工	7,900	4,515.00	35,668,500	
住友化学	93,100	540.00	50,274,000	
住友精化	500	5,330.00	2,665,000	
日産化学	7,300	5,390.00	39,347,000	
ラサ工業	400	1,754.00	701,600	
クレハ	1,100	7,210.00	7,931,000	
多木化学	200	10,340.00	2,068,000	
テイカ	1,000	2,240.00	2,240,000	
石原産業	2,300	1,272.00	2,925,600	
片倉コープアグリ	300	1,178.00	353,400	
日東エフシー	700	760.00	532,000	
日本曹達	1,800	2,849.00	5,128,200	
東ソー	18,300	1,450.00	26,535,000	
トクヤマ	3,700	2,472.00	9,146,400	
セントラル硝子	2,600	2,369.00	6,159,400	
東亜合成	7,400	1,078.00	7,977,200	
大阪ソーダ	1,300	2,545.00	3,308,500	
関東電化工業	3,000	972.00	2,916,000	
デンカ	4,600	3,565.00	16,399,000	
信越化学工業	20,800	8,453.00	175,822,400	

日本カーバイド工業	400	1,624.00	649,600
堺化学工業	900	2,383.00	2,144,700
第一稀元素化学工業	1,000	1,071.00	1,071,000
エア・ウォーター	10,400	1,770.00	18,408,000
大陽日酸	9,700	1,704.00	16,528,800
日本化学工業	500	2,868.00	1,434,000
東邦アセチレン	200	1,478.00	295,600
日本パーカラライジング	6,500	1,264.00	8,216,000
高圧ガス工業	1,900	767.00	1,457,300
四国化成工業	1,800	1,234.00	2,221,200
戸田工業	200	2,554.00	510,800
ステラ ケミファ	600	3,330.00	1,998,000
保土谷化学工業	400	2,540.00	1,016,000
日本触媒	2,000	7,240.00	14,480,000
大日精化工業	1,000	3,275.00	3,275,000
カネカ	3,400	4,595.00	15,623,000
三菱瓦斯化学	10,500	1,811.00	19,015,500
三井化学	11,500	2,440.00	28,060,000
J S R	12,700	1,655.00	21,018,500
東京応化工業	2,000	2,846.00	5,692,000
大阪有機化学工業	1,100	1,296.00	1,425,600
三菱ケミカルホールディングス	84,700	850.70	72,054,290
K Hネオケム	1,800	3,230.00	5,814,000
ダイセル	17,200	1,194.00	20,536,800
住友ベークライト	2,000	3,855.00	7,710,000
積水化学工業	25,800	1,663.00	42,905,400
日本ゼオン	10,700	1,031.00	11,031,700
アイカ工業	3,500	3,250.00	11,375,000
宇部興産	6,400	2,336.00	14,950,400
積水樹脂	1,900	1,825.00	3,467,500
タキロンシーアイ	2,600	559.00	1,453,400
旭有機材	700	2,140.00	1,498,000
日立化成	6,200	1,771.00	10,980,200
ニチバン	600	2,127.00	1,276,200
リケンテクノス	2,700	496.00	1,339,200
大倉工業	600	1,826.00	1,095,600

積水化成成品工業	1,600	841.00	1,345,600
群栄化学工業	300	2,827.00	848,100
タイガースポリマー	600	657.00	394,200
ミライアル	400	946.00	378,400
ダイキアクシス	400	1,263.00	505,200
ダイキョーニシカワ	2,500	1,050.00	2,625,000
竹本容器	200	2,503.00	500,600
森六ホールディングス	600	2,784.00	1,670,400
日本化薬	8,200	1,264.00	10,364,800
カーリットホールディングス	1,200	793.00	951,600
日本精化	1,000	1,032.00	1,032,000
扶桑化学工業	1,200	2,101.00	2,521,200
トリケミカル研究所	300	4,205.00	1,261,500
A D E K A	5,500	1,644.00	9,042,000
日油	4,900	3,195.00	15,655,500
新日本理化	2,100	201.00	422,100
ハリマ化成グループ	1,000	807.00	807,000
花王	29,700	7,261.00	215,651,700
第一工業製薬	500	2,776.00	1,388,000
石原ケミカル	300	2,009.00	602,700
日華化学	400	1,100.00	440,000
ニイタカ	200	1,725.00	345,000
三洋化成工業	800	4,980.00	3,984,000
有機合成薬品工業	900	259.00	233,100
大日本塗料	1,400	1,083.00	1,516,200
日本ペイントホールディングス	9,800	3,430.00	33,614,000
関西ペイント	13,300	1,636.00	21,758,800
神東塗料	1,000	198.00	198,000
中国塗料	3,600	890.00	3,204,000
日本特殊塗料	800	2,191.00	1,752,800
藤倉化成	1,600	599.00	958,400
太陽ホールディングス	1,000	3,900.00	3,900,000
D I C	5,400	3,180.00	17,172,000
サカタインクス	2,600	1,082.00	2,813,200
東洋インキ S C ホールディングス	2,500	2,529.00	6,322,500
T & K T O K A	900	1,044.00	939,600

富士フイルムホールディングス	25,100	4,838.00	121,433,800	
資生堂	24,000	6,765.00	162,360,000	
ライオン	16,800	2,052.00	34,473,600	
高砂香料工業	800	3,505.00	2,804,000	
マンダム	2,400	3,130.00	7,512,000	
ミルボン	1,500	4,520.00	6,780,000	
ファンケル	2,900	4,370.00	12,673,000	
コーセー	2,100	16,130.00	33,873,000	
コタ	600	1,402.00	841,200	
シーズ・ホールディングス	1,500	5,880.00	8,820,000	
シーボン	100	2,645.00	264,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	5,200	3,150.00	16,380,000	
ノエビアホールディングス	800	4,615.00	3,692,000	
アジュバンコスメジャパン	300	960.00	288,000	
エステー	900	1,849.00	1,664,100	
アグロ カネショウ	500	2,267.00	1,133,500	
コニシ	2,000	1,508.00	3,016,000	
長谷川香料	1,400	1,954.00	2,735,600	
星光P M C	800	904.00	723,200	
小林製薬	3,400	6,980.00	23,732,000	
荒川化学工業	1,100	1,501.00	1,651,100	
メック	800	1,434.00	1,147,200	
日本高純度化学	300	2,168.00	650,400	
タカラバイオ	3,200	2,627.00	8,406,400	
J C U	1,500	2,267.00	3,400,500	
新田ゼラチン	900	747.00	672,300	
O A T アグリオ	200	2,754.00	550,800	
デクセリアルズ	3,100	951.00	2,948,100	
アース製薬	900	4,965.00	4,468,500	
北興化学工業	1,300	510.00	663,000	
大成ラミック	400	3,015.00	1,206,000	
クミアイ化学工業	5,000	687.00	3,435,000	
日本農薬	2,900	581.00	1,684,900	
アキレス	900	2,163.00	1,946,700	
有沢製作所	2,000	818.00	1,636,000	
日東電工	9,100	6,839.00	62,234,900	

レック	1,400	2,097.00	2,935,800	
三光合成	1,000	366.00	366,000	
きもと	2,200	251.00	552,200	
藤森工業	1,000	3,265.00	3,265,000	
前澤化成工業	900	1,047.00	942,300	
ウェーブロックホールディングス	300	805.00	241,500	
J S P	700	2,396.00	1,677,200	
エフピコ	1,000	5,690.00	5,690,000	
天馬	900	1,886.00	1,697,400	
信越ポリマー	2,500	755.00	1,887,500	
東リ	3,000	316.00	948,000	
ニフコ	4,500	2,578.00	11,601,000	
バルカー	1,000	2,526.00	2,526,000	
ユニ・チャーム	25,600	2,982.50	76,352,000	
協和発酵キリン	15,100	1,926.00	29,082,600	
武田薬品工業	45,100	4,368.00	196,996,800	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	118,700	1,744.50	207,072,150	
大日本住友製薬	8,900	2,355.00	20,959,500	
塩野義製薬	17,000	7,062.00	120,054,000	
田辺三菱製薬	14,700	1,625.00	23,887,500	
わかもと製薬	1,500	274.00	411,000	
あすか製薬	1,400	1,456.00	2,038,400	
日本新薬	3,200	6,390.00	20,448,000	
バイオフェルミン製薬	200	2,853.00	570,600	
中外製薬	12,600	6,570.00	82,782,000	
科研製薬	2,200	5,580.00	12,276,000	
エーザイ	14,500	9,310.00	134,995,000	
ロート製薬	6,600	3,455.00	22,803,000	
小野薬品工業	28,500	2,505.00	71,392,500	
久光製薬	3,600	6,230.00	22,428,000	
持田製薬	800	8,690.00	6,952,000	
参天製薬	22,900	1,631.00	37,349,900	
扶桑薬品工業	400	2,633.00	1,053,200	
日本ケミファ	200	4,095.00	819,000	
ツムラ	4,300	3,430.00	14,749,000	

日医工	3,200	1,556.00	4,979,200
キッセイ薬品工業	2,100	3,135.00	6,583,500
生化学工業	2,300	1,638.00	3,767,400
栄研化学	2,000	2,325.00	4,650,000
日水製薬	500	1,214.00	607,000
鳥居薬品	700	2,448.00	1,713,600
J C R ファーマ	900	5,210.00	4,689,000
東和薬品	600	8,200.00	4,920,000
富士製薬工業	800	1,695.00	1,356,000
沢井製薬	2,400	5,810.00	13,944,000
ゼリア新薬工業	2,600	2,036.00	5,293,600
第一三共	34,600	4,374.00	151,340,400
キョーリン製薬ホールディングス	3,400	2,429.00	8,258,600
大幸薬品	700	1,792.00	1,254,400
ダイト	700	3,205.00	2,243,500
大塚ホールディングス	23,000	5,324.00	122,452,000
大正製薬ホールディングス	2,700	11,940.00	32,238,000
ペプチドリーム	5,500	3,745.00	20,597,500
日本コークス工業	10,300	102.00	1,050,600
昭和シェル石油	11,300	2,056.00	23,232,800
ニチレキ	1,600	1,041.00	1,665,600
ユシロ化学工業	700	1,325.00	927,500
ビーピー・カストロール	400	1,472.00	588,800
富士石油	3,000	421.00	1,263,000
MORESCO	400	1,542.00	616,800
出光興産	10,100	4,890.00	49,389,000
J X T Gホールディングス	194,800	746.50	145,418,200
コスモエネルギーホールディングス	3,500	4,005.00	14,017,500
横浜ゴム	7,000	2,116.00	14,812,000
東洋ゴム工業	6,200	1,814.00	11,246,800
ブリヂストン	37,100	4,227.00	156,821,700
住友ゴム工業	10,800	1,559.00	16,837,200
藤倉ゴム工業	1,100	516.00	567,600
オカモト	800	4,815.00	3,852,000
フコク	500	883.00	441,500
ニッタ	1,300	3,870.00	5,031,000

住友理工	2,400	968.00	2,323,200	
三ツ星ベルト	1,500	2,716.00	4,074,000	
バンドー化学	2,300	1,312.00	3,017,600	
日東紡績	1,800	2,248.00	4,046,400	
A G C	12,200	3,925.00	47,885,000	
日本板硝子	5,900	1,005.00	5,929,500	
石塚硝子	200	2,249.00	449,800	
日本山村硝子	500	1,623.00	811,500	
日本電気硝子	5,200	2,948.00	15,329,600	
オハラ	500	2,352.00	1,176,000	
住友大阪セメント	2,300	4,160.00	9,568,000	
太平洋セメント	7,600	3,150.00	23,940,000	
日本ヒューム	1,300	878.00	1,141,400	
日本コンクリート工業	2,700	289.00	780,300	
三谷セキサン	600	2,384.00	1,430,400	
アジアパイルホールディングス	1,700	617.00	1,048,900	
東海カーボン	11,000	1,600.00	17,600,000	
日本カーボン	600	6,210.00	3,726,000	
東洋炭素	700	2,706.00	1,894,200	
ノリタケカンパニーリミテド	700	5,380.00	3,766,000	
T O T O	9,300	4,005.00	37,246,500	
日本碍子	14,700	1,621.00	23,828,700	
日本特殊陶業	10,200	2,639.00	26,917,800	
ダントーホールディングス	1,400	126.00	176,400	
M A R U W A	400	5,520.00	2,208,000	
品川リフラクトリーズ	300	4,085.00	1,225,500	
黒崎播磨	200	6,960.00	1,392,000	
ヨータイ	1,000	719.00	719,000	
イソライト工業	600	478.00	286,800	
東京窯業	1,600	405.00	648,000	
ニッカトー	600	1,042.00	625,200	
フジインコーポレーテッド	1,100	2,446.00	2,690,600	
クニミネ工業	300	979.00	293,700	
エーアンドエーマテリアル	300	984.00	295,200	
ニチアス	3,300	2,505.00	8,266,500	
ニチハ	1,800	2,357.00	4,242,600	

新日鐵住金	53,400	2,049.50	109,443,300
神戸製鋼所	21,900	942.00	20,629,800
合同製鐵	700	2,006.00	1,404,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	32,200	2,281.00	73,448,200
日新製鋼	3,300	1,443.00	4,761,900
東京製鐵	6,400	839.00	5,369,600
共英製鋼	1,300	1,893.00	2,460,900
大和工業	2,600	2,801.00	7,282,600
東京鐵鋼	500	1,582.00	791,000
大阪製鐵	800	1,982.00	1,585,600
淀川製鋼所	1,800	2,312.00	4,161,600
丸一鋼管	4,200	3,165.00	13,293,000
モリ工業	400	2,503.00	1,001,200
大同特殊鋼	2,100	4,465.00	9,376,500
日本高周波鋼業	500	689.00	344,500
日本冶金工業	10,000	273.00	2,730,000
山陽特殊製鋼	1,500	2,608.00	3,912,000
愛知製鋼	700	3,875.00	2,712,500
日立金属	12,900	1,283.00	16,550,700
日本金属	300	1,338.00	401,400
大平洋金属	800	3,280.00	2,624,000
新日本電工	7,200	250.00	1,800,000
栗本鐵工所	600	1,613.00	967,800
虹技	200	1,603.00	320,600
日本鑄鉄管	100	1,424.00	142,400
三菱製鋼	900	1,853.00	1,667,700
日亜鋼業	1,800	319.00	574,200
日本精線	200	3,700.00	740,000
エンビプロ・ホールディングス	300	629.00	188,700
シンニッタン	1,900	360.00	684,000
新家工業	300	1,768.00	530,400
大紀アルミニウム工業所	2,000	633.00	1,266,000
日本軽金属ホールディングス	34,900	218.00	7,608,200
三井金属鉱業	3,200	2,919.00	9,340,800
東邦亜鉛	700	3,425.00	2,397,500
三菱マテリアル	7,900	3,090.00	24,411,000

住友金属鉱山	15,500	3,443.00	53,366,500
DOWAホールディングス	3,000	3,185.00	9,555,000
古河機械金属	2,000	1,360.00	2,720,000
エス・サイエンス	6,100	72.00	439,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	1,738.00	2,259,400
東邦チタニウム	2,200	1,149.00	2,527,800
UACJ	1,800	2,401.00	4,321,800
CKサンエツ	200	2,843.00	568,600
古河電気工業	4,000	2,883.00	11,532,000
住友電気工業	44,600	1,530.50	68,260,300
フジクラ	14,500	458.00	6,641,000
昭和電線ホールディングス	1,600	669.00	1,070,400
タツタ電線	2,400	525.00	1,260,000
カナレ電気	200	2,022.00	404,400
平河ヒューテック	600	1,498.00	898,800
リョービ	1,500	3,140.00	4,710,000
アーレスティ	1,500	688.00	1,032,000
アサヒホールディングス	2,000	2,307.00	4,614,000
稲葉製作所	700	1,313.00	919,100
宮地エンジニアリンググループ	400	2,598.00	1,039,200
トーカロ	3,300	893.00	2,946,900
アルファC o	400	1,363.00	545,200
SUMCO	13,200	1,301.00	17,173,200
川田テクノロジーズ	300	6,310.00	1,893,000
RS Technologies	200	3,880.00	776,000
東洋製罐グループホールディングス	7,600	2,278.00	17,312,800
ホッカンホールディングス	600	1,944.00	1,166,400
コロナ	700	1,076.00	753,200
横河ブリッジホールディングス	2,200	1,944.00	4,276,800
駒井ハルテック	300	2,010.00	603,000
高田機工	100	2,625.00	262,500
三和ホールディングス	11,600	1,260.00	14,616,000
文化シャッター	3,500	791.00	2,768,500
三協立山	1,700	1,238.00	2,104,600
アルインコ	900	990.00	891,000
東洋シャッター	400	650.00	260,000

LI X I Lグループ	17,600	1,799.00	31,662,400	
日本フィルコン	900	580.00	522,000	
ノーリツ	2,700	1,577.00	4,257,900	
長府製作所	1,200	2,231.00	2,677,200	
リンナイ	2,100	8,120.00	17,052,000	
ダイニチ工業	700	731.00	511,700	
日東精工	1,700	599.00	1,018,300	
三洋工業	200	2,022.00	404,400	
岡部	2,400	975.00	2,340,000	
ジーテクト	1,300	1,526.00	1,983,800	
中国工業	200	569.00	113,800	
東プレ	2,200	2,314.00	5,090,800	
高周波熱錬	2,300	962.00	2,212,600	
東京製網	900	1,221.00	1,098,900	
サンコール	700	721.00	504,700	
モリテック スチール	1,000	451.00	451,000	
パイオラックス	1,800	2,333.00	4,199,400	
エイチワン	1,200	1,099.00	1,318,800	
日本発條	11,900	969.00	11,531,100	
中央発條	100	3,500.00	350,000	
アドバネクス	200	1,730.00	346,000	
立川ブラインド工業	500	1,078.00	539,000	
三益半導体工業	900	1,384.00	1,245,600	
日本ドライケミカル	300	1,226.00	367,800	
日本製鋼所	3,900	2,274.00	8,868,600	
三浦工業	5,200	2,708.00	14,081,600	
タクマ	4,200	1,374.00	5,770,800	
ツガミ	3,200	910.00	2,912,000	
オークマ	1,400	5,420.00	7,588,000	
東芝機械	1,400	1,983.00	2,776,200	
アマダホールディングス	18,400	1,009.00	18,565,600	
アイダエンジニアリング	3,100	877.00	2,718,700	
滝澤鉄工所	400	1,542.00	616,800	
F U J I	3,600	1,491.00	5,367,600	
牧野フライス製作所	1,200	3,920.00	4,704,000	
オーエスジー	5,900	2,201.00	12,985,900	

ダイジェット工業	200	1,824.00	364,800
旭ダイヤモンド工業	3,600	677.00	2,437,200
D M G 森精機	7,600	1,546.00	11,749,600
ソディック	2,600	799.00	2,077,400
ディスコ	1,600	16,550.00	26,480,000
日東工器	700	2,271.00	1,589,700
日進工具	300	2,473.00	741,900
パンチ工業	1,000	602.00	602,000
富士ダイス	600	759.00	455,400
豊和工業	700	801.00	560,700
O K K	500	1,034.00	517,000
東洋機械金属	1,000	618.00	618,000
津田駒工業	300	1,929.00	578,700
島精機製作所	1,500	3,025.00	4,537,500
オプトラン	1,200	2,105.00	2,526,000
N C ホールディングス	400	550.00	220,000
フリュー	900	892.00	802,800
ヤマシンフィルタ	1,900	666.00	1,265,400
日阪製作所	1,700	986.00	1,676,200
やまびこ	2,300	1,146.00	2,635,800
平田機工	500	6,490.00	3,245,000
ベガサスミシン製造	1,100	799.00	878,900
ナプテスコ	6,600	2,306.00	15,219,600
三井海洋開発	1,300	3,290.00	4,277,000
レオン自動機	1,100	1,796.00	1,975,600
S M C	3,800	31,950.00	121,410,000
新川	1,000	444.00	444,000
ホソカワミクロン	400	5,120.00	2,048,000
ユニオンツール	500	3,675.00	1,837,500
オイレス工業	1,600	2,009.00	3,214,400
日精エー・エス・ビー機械	400	3,450.00	1,380,000
サトーホールディングス	1,600	3,175.00	5,080,000
技研製作所	800	3,755.00	3,004,000
日本エアーテック	400	704.00	281,600
カワタ	300	2,202.00	660,600
日精樹脂工業	1,000	973.00	973,000

オカダアイヨン	400	1,485.00	594,000
ワイエイシイホールディングス	500	726.00	363,000
小松製作所	58,300	2,668.00	155,544,400
住友重機械工業	6,900	3,340.00	23,046,000
日立建機	5,600	2,906.00	16,273,600
日工	300	2,463.00	738,900
巴工業	500	2,200.00	1,100,000
井関農機	1,200	1,852.00	2,222,400
T O W A	1,000	895.00	895,000
丸山製作所	300	1,574.00	472,200
北川鉄工所	600	2,570.00	1,542,000
ローツェ	600	1,597.00	958,200
タカキタ	400	667.00	266,800
クボタ	64,800	1,751.00	113,464,800
荏原実業	400	1,780.00	712,000
三菱化工機	400	1,638.00	655,200
月島機械	2,400	1,476.00	3,542,400
帝国電機製作所	900	1,500.00	1,350,000
新東工業	2,900	903.00	2,618,700
澁谷工業	1,100	3,525.00	3,877,500
アイチ コーポレーション	2,100	580.00	1,218,000
小森コーポレーション	3,000	1,252.00	3,756,000
鶴見製作所	1,000	1,914.00	1,914,000
住友精密工業	200	3,550.00	710,000
酒井重工業	200	3,055.00	611,000
荏原製作所	5,400	3,100.00	16,740,000
石井鐵工所	200	1,666.00	333,200
西島製作所	1,300	902.00	1,172,600
北越工業	1,400	1,103.00	1,544,200
ダイキン工業	16,500	12,635.00	208,477,500
オルガノ	400	2,980.00	1,192,000
トーヨーカネツ	500	2,436.00	1,218,000
栗田工業	6,500	2,674.00	17,381,000
椿本チエイン	1,500	4,285.00	6,427,500
大同工業	600	1,028.00	616,800
木村化工機	1,000	384.00	384,000

アネスト岩田	2,000	964.00	1,928,000	
ダイフク	6,200	4,475.00	27,745,000	
サムコ	400	1,114.00	445,600	
加藤製作所	600	3,020.00	1,812,000	
油研工業	200	1,983.00	396,600	
タダノ	5,800	1,042.00	6,043,600	
フジテック	3,700	1,172.00	4,336,400	
C K D	3,400	1,137.00	3,865,800	
キトー	900	1,640.00	1,476,000	
平和	3,700	2,496.00	9,235,200	
理想科学工業	1,200	2,268.00	2,721,600	
S A N K Y O	3,000	4,190.00	12,570,000	
日本金銭機械	1,200	1,056.00	1,267,200	
マースグループホールディングス	800	2,231.00	1,784,800	
福島工業	700	4,975.00	3,482,500	
オーイズミ	500	546.00	273,000	
ダイコク電機	600	1,566.00	939,600	
竹内製作所	2,000	2,150.00	4,300,000	
アマノ	3,700	2,048.00	7,577,600	
J U K I	1,700	1,211.00	2,058,700	
サンデンホールディングス	1,500	1,212.00	1,818,000	
蛇の目マシン工業	1,100	580.00	638,000	
マックス	1,900	1,449.00	2,753,100	
グローリー	3,600	2,514.00	9,050,400	
新晃工業	1,200	1,526.00	1,831,200	
大和冷機工業	1,800	1,146.00	2,062,800	
セガサミーホールディングス	12,000	1,435.00	17,220,000	
日本ピストンリング	500	2,053.00	1,026,500	
リケン	600	5,280.00	3,168,000	
T P R	1,300	2,650.00	3,445,000	
ツバキ・ナカシマ	1,800	1,999.00	3,598,200	
ホシザキ	3,500	10,440.00	36,540,000	
大豊工業	1,000	1,052.00	1,052,000	
日本精工	24,800	1,103.00	27,354,400	
N T N	28,000	392.00	10,976,000	
ジェイテクト	12,900	1,432.00	18,472,800	

不二越	1,100	4,350.00	4,785,000
日本トムソン	3,900	601.00	2,343,900
T H K	7,500	2,278.00	17,085,000
ユーシン精機	1,100	995.00	1,094,500
前澤給装工業	500	1,734.00	867,000
イーグル工業	1,500	1,253.00	1,879,500
前澤工業	900	376.00	338,400
日本ピラー工業	1,200	1,409.00	1,690,800
キッツ	4,900	826.00	4,047,400
マキタ	15,700	4,585.00	71,984,500
日立造船	9,600	419.00	4,022,400
三菱重工業	20,200	4,022.00	81,244,400
I H I	9,300	4,125.00	38,362,500
スター精密	2,000	1,571.00	3,142,000
日清紡ホールディングス	7,800	1,225.00	9,555,000
イビデン	7,400	1,317.00	9,745,800
コニカミノルタ	28,300	1,131.00	32,007,300
ブラザー工業	14,900	1,970.00	29,353,000
ミネベアミツミ	22,400	1,610.00	36,064,000
日立製作所	58,000	3,256.00	188,848,000
三菱電機	120,700	1,308.50	157,935,950
富士電機	7,400	3,320.00	24,568,000
東洋電機製造	500	1,536.00	768,000
安川電機	14,000	2,897.00	40,558,000
シンフォニアテクノロジー	1,600	1,333.00	2,132,800
明電舎	2,000	1,612.00	3,224,000
オリジン電気	300	1,540.00	462,000
山洋電気	600	4,095.00	2,457,000
デンヨー	1,100	1,586.00	1,744,600
東芝テック	1,700	3,355.00	5,703,500
芝浦メカトロニクス	200	3,270.00	654,000
マブチモーター	3,400	3,785.00	12,869,000
日本電産	14,500	13,720.00	198,940,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	500	2,005.00	1,002,500
トレックス・セミコンダクター	300	1,381.00	414,300
東光高岳	600	1,539.00	923,400

ダブル・スコープ	1,800	963.00	1,733,400
ダイヘン	1,300	2,368.00	3,078,400
ヤーマン	1,800	1,645.00	2,961,000
JVCケンウッド	10,000	273.00	2,730,000
ミマキエンジニアリング	1,100	998.00	1,097,800
第一精工	500	1,328.00	664,000
日新電機	2,800	869.00	2,433,200
大崎電気工業	2,600	764.00	1,986,400
オムロン	12,800	4,250.00	54,400,000
日東工業	1,900	1,824.00	3,465,600
I D E C	1,500	1,946.00	2,919,000
不二電機工業	200	1,342.00	268,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,300	2,266.00	9,743,800
サクサホールディングス	300	1,932.00	579,600
メルコホールディングス	600	3,875.00	2,325,000
テクノメディカ	300	1,939.00	581,700
日本電気	15,600	3,205.00	49,998,000
富士通	12,400	7,003.00	86,837,200
沖電気工業	5,000	1,528.00	7,640,000
岩崎通信機	600	729.00	437,400
電気興業	700	2,775.00	1,942,500
サンケン電気	1,400	2,178.00	3,049,200
ナカヨ	200	1,504.00	300,800
アイホン	700	1,445.00	1,011,500
ルネサスエレクトロニクス	12,500	549.00	6,862,500
セイコーエプソン	18,000	1,867.00	33,606,000
ワコム	9,400	480.00	4,512,000
アルバック	2,800	3,330.00	9,324,000
アクセル	600	598.00	358,800
E I Z O	1,100	4,135.00	4,548,500
ジャパンディスプレイ	25,200	104.00	2,620,800
日本信号	3,400	944.00	3,209,600
京三製作所	2,900	470.00	1,363,000
能美防災	1,600	2,200.00	3,520,000
ホーチキ	900	1,353.00	1,217,700
星和電機	500	472.00	236,000

エレコム	1,100	2,536.00	2,789,600
パナソニック	137,900	1,223.00	168,651,700
シャープ	12,000	1,672.00	20,064,000
アンリツ	8,800	1,639.00	14,423,200
富士通ゼネラル	3,700	1,481.00	5,479,700
ソニー	80,900	5,834.00	471,970,600
T D K	6,300	9,050.00	57,015,000
帝国通信工業	500	1,174.00	587,000
タムラ製作所	4,700	548.00	2,575,600
アルプス電気	10,500	2,500.00	26,250,000
池上通信機	400	1,157.00	462,800
パイオニア	20,500	100.00	2,050,000
日本電波工業	1,100	451.00	496,100
鈴木	600	703.00	421,800
日本トリム	300	5,780.00	1,734,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,321.00	1,392,600
フォスター電機	1,400	1,328.00	1,859,200
クラリオン	1,300	2,350.00	3,055,000
S M K	300	2,240.00	672,000
ヨコオ	800	1,218.00	974,400
ホシデン	3,100	973.00	3,016,300
ヒロセ電機	2,000	10,250.00	20,500,000
日本航空電子工業	3,100	1,569.00	4,863,900
T O A	1,300	1,106.00	1,437,800
マクセルホールディングス	2,400	1,559.00	3,741,600
古野電気	1,400	1,293.00	1,810,200
ユニデンホールディングス	400	2,416.00	966,400
アルパイン	2,900	1,833.00	5,315,700
スミダコーポレーション	1,000	1,134.00	1,134,000
アイコム	700	2,362.00	1,653,400
リオン	500	2,562.00	1,281,000
本多通信工業	1,000	698.00	698,000
船井電機	1,300	553.00	718,900
横河電機	12,100	2,199.00	26,607,900
新電元工業	400	4,530.00	1,812,000
アズビル	7,300	2,015.00	14,709,500

東亜ディーケーケー	600	1,098.00	658,800	
日本光電工業	5,100	3,345.00	17,059,500	
チノー	400	1,274.00	509,600	
共和電業	1,300	392.00	509,600	
日本電子材料	500	686.00	343,000	
堀場製作所	2,400	4,865.00	11,676,000	
アドバンテスト	6,800	1,847.00	12,559,600	
小野測器	600	750.00	450,000	
エスベック	1,100	1,690.00	1,859,000	
キーエンス	5,900	51,520.00	303,968,000	
日置電機	600	3,885.00	2,331,000	
シスメックス	9,400	7,730.00	72,662,000	
日本マイクロニクス	2,000	659.00	1,318,000	
メガチップス	1,000	1,934.00	1,934,000	
OBARA GROUP	700	4,280.00	2,996,000	
澤藤電機	100	1,955.00	195,500	
コーセル	1,700	1,075.00	1,827,500	
イリソ電子工業	1,000	4,585.00	4,585,000	
オブテックスグループ	2,100	1,906.00	4,002,600	
千代田インテグレ	500	2,195.00	1,097,500	
アイ・オー・データ機器	500	1,236.00	618,000	
レーザーテック	2,500	2,704.00	6,760,000	
スタンレー電気	9,200	3,535.00	32,522,000	
岩崎電気	500	1,416.00	708,000	
ウシオ電機	7,300	1,277.00	9,322,100	
岡谷電機産業	900	450.00	405,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	721.00	793,100	
日本セラミック	1,200	2,632.00	3,158,400	
遠藤照明	600	758.00	454,800	
古河電池	900	835.00	751,500	
双信電機	600	440.00	264,000	
山一電機	900	1,139.00	1,025,100	
図研	800	1,612.00	1,289,600	
日本電子	2,200	1,834.00	4,034,800	
カシオ計算機	9,800	1,632.00	15,993,600	
ファナック	11,500	17,690.00	203,435,000	

日本シイエムケイ	2,200	714.00	1,570,800	
エンプラス	600	2,879.00	1,727,400	
大真空	400	1,027.00	410,800	
ローム	5,500	6,640.00	36,520,000	
浜松ホトニクス	8,700	3,760.00	32,712,000	
三井ハイテック	1,600	1,104.00	1,766,400	
新光電気工業	4,600	719.00	3,307,400	
京セラ	19,800	5,721.00	113,275,800	
太陽誘電	5,900	2,081.00	12,277,900	
村田製作所	12,700	15,575.00	197,802,500	
ユーシン	1,900	721.00	1,369,900	
双葉電子工業	2,000	1,710.00	3,420,000	
北陸電気工業	500	1,084.00	542,000	
ニチコン	3,800	883.00	3,355,400	
日本ケミコン	1,000	2,431.00	2,431,000	
K O A	1,700	1,470.00	2,499,000	
市光工業	1,800	716.00	1,288,800	
小糸製作所	7,200	5,750.00	41,400,000	
ミツバ	2,200	843.00	1,854,600	
S C R E E Nホールディングス	2,300	5,790.00	13,317,000	
キャノン電子	1,100	2,021.00	2,223,100	
キャノン	65,000	3,206.00	208,390,000	代用有価証券 10,000株
リコー	36,300	1,197.00	43,451,100	
象印マホービン	2,300	1,168.00	2,686,400	
M U T O Hホールディングス	200	2,230.00	446,000	
東京エレクトロン	8,100	14,080.00	114,048,000	
トヨタ紡織	3,600	2,003.00	7,210,800	
芦森工業	300	1,832.00	549,600	
ユニプレス	2,300	1,996.00	4,590,800	
豊田自動織機	9,800	5,620.00	55,076,000	
モリタホールディングス	2,000	2,077.00	4,154,000	
三櫻工業	1,600	635.00	1,016,000	
デンソー	26,800	4,987.00	133,651,600	
東海理化電機製作所	3,200	2,146.00	6,867,200	
三井E & Sホールディングス	4,400	1,910.00	8,404,000	

川崎重工業	9,400	2,686.00	25,248,400	
名村造船所	3,600	473.00	1,702,800	
サノヤスホールディングス	1,600	212.00	339,200	
日本車輛製造	500	2,631.00	1,315,500	
三菱ロジスネクスト	1,400	1,151.00	1,611,400	
近畿車輛	200	2,210.00	442,000	
日産自動車	142,400	990.90	141,104,160	
いすゞ自動車	35,400	1,430.00	50,622,000	
トヨタ自動車	146,800	6,534.00	959,191,200	代用有価証券 35,000株
日野自動車	17,200	1,053.00	18,111,600	
三菱自動車工業	44,700	680.00	30,396,000	
エフテック	800	1,078.00	862,400	
レシップホールディングス	500	757.00	378,500	
G M B	200	1,184.00	236,800	
ファルテック	200	954.00	190,800	
武蔵精密工業	2,600	1,627.00	4,230,200	
日産車体	4,700	891.00	4,187,700	
新明和工業	5,400	1,382.00	7,462,800	
極東開発工業	2,300	1,558.00	3,583,400	
日信工業	2,500	1,600.00	4,000,000	
トピー工業	1,000	2,942.00	2,942,000	
ティラド	400	2,594.00	1,037,600	
曙ブレーキ工業	6,300	223.00	1,404,900	
タチエス	2,100	1,558.00	3,271,800	
N O K	6,500	1,529.00	9,938,500	
フタバ産業	3,700	643.00	2,379,100	
K Y B	1,300	2,470.00	3,211,000	
大同メタル工業	1,800	826.00	1,486,800	
プレス工業	6,400	488.00	3,123,200	
ミクニ	1,600	598.00	956,800	
太平洋工業	2,500	1,595.00	3,987,500	
ケーヒン	2,800	2,130.00	5,964,000	
河西工業	1,500	1,007.00	1,510,500	
アイシン精機	9,900	4,480.00	44,352,000	
マツダ	37,900	1,192.00	45,176,800	

今仙電機製作所	1,100	1,003.00	1,103,300
本田技研工業	108,600	2,977.50	323,356,500
スズキ	23,900	5,577.00	133,290,300
S U B A R U	37,500	3,014.00	113,025,000
安永	600	1,705.00	1,023,000
ヤマハ発動機	17,100	2,561.00	43,793,100
ショーワ	3,200	1,447.00	4,630,400
T B K	1,400	445.00	623,000
エクセディ	1,500	3,115.00	4,672,500
豊田合成	4,400	2,549.00	11,215,600
愛三工業	2,100	797.00	1,673,700
盟和産業	200	1,158.00	231,600
日本プラスト	800	830.00	664,000
ヨロズ	1,200	1,535.00	1,842,000
エフ・シー・シー	2,100	2,765.00	5,806,500
シマノ	4,900	15,370.00	75,313,000
テイ・エス テック	2,800	3,150.00	8,820,000
ジャムコ	600	2,911.00	1,746,600
テルモ	18,500	5,890.00	108,965,000
クリエートメディック	400	1,103.00	441,200
日機装	3,900	1,287.00	5,019,300
島津製作所	14,600	2,803.00	40,923,800
J M S	1,100	545.00	599,500
長野計器	1,000	875.00	875,000
ブイ・テクノロジー	300	12,800.00	3,840,000
東京計器	800	995.00	796,000
愛知時計電機	200	3,820.00	764,000
インターアクション	700	1,676.00	1,173,200
オーバル	1,200	263.00	315,600
東京精密	2,200	2,455.00	5,401,000
マニー	1,500	4,930.00	7,395,000
ニコン	21,000	1,889.00	39,669,000
トプコン	6,500	1,583.00	10,289,500
オリンパス	18,000	3,785.00	68,130,000
理研計器	1,100	1,981.00	2,179,100
タムロン	1,100	1,996.00	2,195,600

HOYA	24,300	6,065.00	147,379,500	
シード	500	1,660.00	830,000	
ノーリツ鋼機	1,200	2,429.00	2,914,800	
エー・アンド・デイ	1,100	772.00	849,200	
シチズン時計	14,400	636.00	9,158,400	
リズム時計工業	400	1,948.00	779,200	
大研医器	1,100	796.00	875,600	
メニコン	1,600	2,484.00	3,974,400	
シンシア	200	565.00	113,000	
松風	600	1,240.00	744,000	
セイコーホールディングス	1,900	2,657.00	5,048,300	
ニプロ	8,400	1,388.00	11,659,200	
中本パックス	300	1,747.00	524,100	
スノーピーク	400	1,503.00	601,200	
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,665.00	6,064,500	
トランザクション	700	800.00	560,000	
SHO-BI	400	388.00	155,200	
ニホンフラッシュ	600	1,860.00	1,116,000	
前田工織	1,300	2,064.00	2,683,200	
永大産業	1,600	459.00	734,400	
アートネイチャー	1,300	663.00	861,900	
バンダイナムコホールディングス	12,500	3,905.00	48,812,500	
アイフィスジャパン	300	750.00	225,000	
共立印刷	2,100	267.00	560,700	
SHOEI	600	4,065.00	2,439,000	
フランスベッドホールディングス	1,400	945.00	1,323,000	
パイロットコーポレーション	2,100	6,170.00	12,957,000	
萩原工業	700	1,642.00	1,149,400	
トッパン・フォームズ	2,600	944.00	2,454,400	
フジシールインターナショナル	2,700	3,330.00	8,991,000	
タカラトミー	5,100	1,228.00	6,262,800	
廣濟堂	1,200	438.00	525,600	
エステールホールディングス	400	692.00	276,800	
アーク	6,400	97.00	620,800	
タカノ	500	838.00	419,000	
プロネクサス	1,000	1,030.00	1,030,000	

ホクシン	1,000	155.00	155,000	
ウッドワン	400	1,163.00	465,200	
大建工業	900	1,954.00	1,758,600	
凸版印刷	17,100	1,546.00	26,436,600	
大日本印刷	15,900	2,480.00	39,432,000	
図書印刷	800	834.00	667,200	
共同印刷	400	2,653.00	1,061,200	
N I S S H A	2,500	1,783.00	4,457,500	
光村印刷	100	2,251.00	225,100	
宝印刷	600	1,756.00	1,053,600	
アシックス	12,000	1,624.00	19,488,000	
ツツミ	400	2,042.00	816,800	
小松ウオール工業	400	2,033.00	813,200	
ヤマハ	7,900	4,925.00	38,907,500	
河合楽器製作所	400	3,775.00	1,510,000	
クリナップ	1,100	687.00	755,700	
ピジョン	7,300	4,675.00	34,127,500	
兼松サステック	100	1,703.00	170,300	
キングジム	1,000	888.00	888,000	
リンテック	2,900	2,606.00	7,557,400	
イトーキ	2,300	576.00	1,324,800	
任天堂	7,400	34,810.00	257,594,000	
三菱鉛筆	2,000	1,855.00	3,710,000	
タカラスタANDARD	2,500	1,734.00	4,335,000	
コクヨ	5,800	1,703.00	9,877,400	
ナカバヤシ	1,200	602.00	722,400	
グローブライド	600	2,550.00	1,530,000	
オカムラ	4,200	1,413.00	5,934,600	
美津濃	1,200	2,565.00	3,078,000	
東京電力ホールディングス	96,500	572.00	55,198,000	
中部電力	37,000	1,612.00	59,644,000	
関西電力	49,300	1,680.50	82,848,650	
中国電力	16,700	1,438.00	24,014,600	
北陸電力	11,900	1,052.00	12,518,800	
東北電力	28,300	1,413.00	39,987,900	
四国電力	10,900	1,425.00	15,532,500	

九州電力	26,700	1,316.00	35,137,200
北海道電力	12,200	659.00	8,039,800
沖縄電力	2,500	2,121.00	5,302,500
電源開発	9,600	3,080.00	29,568,000
エフオン	700	1,042.00	729,400
イーレックス	2,100	887.00	1,862,700
東京瓦斯	25,400	2,743.50	69,684,900
大阪瓦斯	23,400	2,080.00	48,672,000
東邦瓦斯	6,000	4,145.00	24,870,000
北海道瓦斯	700	1,448.00	1,013,600
広島ガス	2,700	356.00	961,200
西部瓦斯	1,500	2,516.00	3,774,000
静岡ガス	3,800	944.00	3,587,200
メタウォーター	700	2,853.00	1,997,100
SBSホールディングス	1,200	1,411.00	1,693,200
東武鉄道	12,700	3,085.00	39,179,500
相鉄ホールディングス	3,900	3,375.00	13,162,500
東京急行電鉄	32,800	1,827.00	59,925,600
京浜急行電鉄	16,600	1,647.00	27,340,200
小田急電鉄	18,200	2,477.00	45,081,400
京王電鉄	6,700	5,990.00	40,133,000
京成電鉄	8,500	3,405.00	28,942,500
富士急行	1,700	3,220.00	5,474,000
東日本旅客鉄道	21,500	9,527.00	204,830,500
西日本旅客鉄道	10,800	7,309.00	78,937,200
東海旅客鉄道	10,800	21,075.00	227,610,000
西武ホールディングス	15,400	2,016.00	31,046,400
鴻池運輸	1,800	1,685.00	3,033,000
西日本鉄道	3,300	2,739.00	9,038,700
ハマキョウレックス	900	3,505.00	3,154,500
サカイ引越センター	600	5,840.00	3,504,000
近鉄グループホールディングス	11,400	4,235.00	48,279,000
阪急阪神ホールディングス	15,300	3,635.00	55,615,500
南海電気鉄道	5,400	2,693.00	14,542,200
京阪ホールディングス	5,100	4,185.00	21,343,500
神戸電鉄	300	3,965.00	1,189,500

名古屋鉄道	9,200	2,660.00	24,472,000
山陽電気鉄道	900	2,369.00	2,132,100
日本通運	4,500	6,480.00	29,160,000
ヤマトホールディングス	20,100	3,114.00	62,591,400
山九	3,000	5,520.00	16,560,000
丸運	700	312.00	218,400
丸全昭和運輸	900	2,910.00	2,619,000
センコーグループホールディングス	6,900	845.00	5,830,500
トナミホールディングス	300	5,770.00	1,731,000
ニッコンホールディングス	4,400	2,665.00	11,726,000
日本石油輸送	200	2,801.00	560,200
福山通運	1,700	4,235.00	7,199,500
セイノーホールディングス	8,600	1,516.00	13,037,600
エスライン	300	1,210.00	363,000
神奈川中央交通	300	3,580.00	1,074,000
日立物流	2,500	2,845.00	7,112,500
丸和運輸機関	600	3,390.00	2,034,000
C & F ロジホールディングス	1,300	1,195.00	1,553,500
九州旅客鉄道	9,600	3,400.00	32,640,000
S Gホールディングス	10,800	2,708.00	29,246,400
日本郵船	9,600	1,795.00	17,232,000
商船三井	7,200	2,608.00	18,777,600
川崎汽船	5,300	1,518.00	8,045,400
N S ユナイテッド海運	600	2,550.00	1,530,000
明治海運	1,300	373.00	484,900
飯野海運	5,900	492.00	2,902,800
共栄タンカー	100	1,812.00	181,200
乾汽船	900	962.00	865,800
日本航空	21,000	3,787.00	79,527,000
A N Aホールディングス	22,200	3,570.00	79,254,000
パスコ	300	1,174.00	352,200
トランコム	300	7,040.00	2,112,000
日新	1,000	2,044.00	2,044,000
三菱倉庫	4,000	2,721.00	10,884,000
三井倉庫ホールディングス	1,400	1,723.00	2,412,200
住友倉庫	4,100	1,267.00	5,194,700

澁澤倉庫	600	1,535.00	921,000
東陽倉庫	2,100	305.00	640,500
日本トランスシティ	2,800	397.00	1,111,600
ケイヒン	200	1,412.00	282,400
中央倉庫	700	1,036.00	725,200
川西倉庫	300	1,534.00	460,200
安田倉庫	1,000	818.00	818,000
東洋埠頭	300	1,548.00	464,400
宇徳	1,000	521.00	521,000
上組	7,100	2,276.00	16,159,600
サンリツ	300	625.00	187,500
キムラユニティー	300	1,110.00	333,000
キューソー流通システム	300	2,441.00	732,300
近鉄エクスプレス	2,100	1,720.00	3,612,000
東海運	700	296.00	207,200
エーアイティー	800	1,016.00	812,800
内外トランスライン	400	1,560.00	624,000
日本コンセプト	300	1,086.00	325,800
N E C ネットエスアイ	1,300	2,313.00	3,006,900
システナ	3,900	1,424.00	5,553,600
デジタルアーツ	600	4,710.00	2,826,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,800	3,095.00	5,571,000
キューブシステム	700	841.00	588,700
エイジア	300	1,231.00	369,300
コア	500	1,191.00	595,500
ソリトンシステムズ	700	897.00	627,900
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,577.00	946,200
T I S	3,900	4,870.00	18,993,000
ネオス	400	1,335.00	534,000
電算システム	500	1,988.00	994,000
グリー	6,400	440.00	2,816,000
コーエーテクモホールディングス	2,400	1,812.00	4,348,800
三菱総合研究所	500	3,835.00	1,917,500
ボルテージ	300	715.00	214,500
電算	100	2,107.00	210,700
A G S	700	720.00	504,000

ファインデックス	1,000	687.00	687,000
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,853.00	555,900
ブレインパッド	300	5,090.00	1,527,000
K L a b	2,100	934.00	1,961,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	900	2,424.00	2,181,600
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,689.00	537,800
ネクソン	30,200	1,249.00	37,719,800
アイスタイル	3,000	977.00	2,931,000
エムアップ	400	2,330.00	932,000
エイチーム	800	1,842.00	1,473,600
テクノスジャパン	1,100	866.00	952,600
コロブラ	3,400	677.00	2,301,800
オルトプラス	700	431.00	301,700
ブロードリーフ	5,900	646.00	3,811,400
クロス・マーケティンググループ	300	438.00	131,400
デジタルハーツホールディングス	600	1,365.00	819,000
メディアドゥホールディングス	400	2,706.00	1,082,400
じげん	1,300	651.00	846,300
ブイキューブ	700	533.00	373,100
サイバーリンクス	200	1,003.00	200,600
ディー・エル・イー	800	316.00	252,800
フィックスターズ	1,100	1,241.00	1,365,100
VOYAGE GROUP	600	1,221.00	732,600
オブティム	200	3,700.00	740,000
セレス	400	1,795.00	718,000
ベリサーブ	200	5,690.00	1,138,000
ティーガイア	1,200	2,517.00	3,020,400
セック	200	4,385.00	877,000
日本アジアグループ	1,300	375.00	487,500
豆蔵ホールディングス	900	769.00	692,100
テクマトリックス	600	2,008.00	1,204,800
プロシップ	200	2,500.00	500,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,600	196.00	5,605,600
GMOペイメントゲートウェイ	2,000	5,510.00	11,020,000
ザッパラス	700	380.00	266,000

システムリサーチ	200	3,840.00	768,000
インターネットイニシアティブ	1,900	2,081.00	3,953,900
さくらインターネット	1,400	632.00	884,800
ヴェンクス	400	1,421.00	568,400
GMOクラウド	300	2,980.00	894,000
SRAホールディングス	600	3,170.00	1,902,000
Minorityソリューションズ	200	1,307.00	261,400
システムインテグレータ	200	2,238.00	447,600
朝日ネット	1,100	495.00	544,500
eBASE	300	1,390.00	417,000
アバント	300	1,388.00	416,400
アドソル日進	500	2,237.00	1,118,500
フリービット	800	848.00	678,400
コムチュア	600	4,005.00	2,403,000
サイバーコム	200	1,619.00	323,800
アステリア	600	949.00	569,400
マークラインズ	400	1,457.00	582,800
メディカル・データ・ビジョン	1,000	1,601.00	1,601,000
gumi	1,400	629.00	880,600
ショーケース・ティービー	300	947.00	284,100
モバイルファクトリー	300	1,336.00	400,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,432.00	716,000
PCIホールディングス	200	2,640.00	528,000
パイブドHD	200	968.00	193,600
アイピーシー	200	1,262.00	252,400
ネオジャパン	300	866.00	259,800
PR TIMES	100	2,023.00	202,300
ランドコンピュータ	100	1,040.00	104,000
オープンドア	500	2,505.00	1,252,500
マイネット	400	1,032.00	412,800
アカツキ	300	4,180.00	1,254,000
ベネフィットジャパン	100	740.00	74,000
Ubicomホールディングス	200	1,009.00	201,800
LINE	3,600	3,400.00	12,240,000
カナミックネットワーク	200	1,965.00	393,000

シンクロ・フード	400	787.00	314,800
オークネット	600	1,145.00	687,000
A O I T Y O H o l d i n g s	1,300	1,209.00	1,571,700
マクロミル	1,500	2,056.00	3,084,000
ビーグリー	200	1,318.00	263,600
オロ	100	4,980.00	498,000
ソルクシーズ	500	816.00	408,000
フェイス	400	1,205.00	482,000
ハイマックス	200	1,770.00	354,000
野村総合研究所	7,500	4,845.00	36,337,500
サイバネットシステム	1,000	610.00	610,000
C E ホールディングス	300	762.00	228,600
日本システム技術	200	2,040.00	408,000
インテージホールディングス	1,400	895.00	1,253,000
東邦システムサイエンス	400	870.00	348,000
ソースネクスト	1,800	1,348.00	2,426,400
F I G	1,100	405.00	445,500
フォーカスシステムズ	700	886.00	620,200
クレスコ	300	3,045.00	913,500
フジ・メディア・ホールディングス	12,300	1,843.00	22,668,900
オービック	3,800	9,110.00	34,618,000
ジャストシステム	1,900	2,260.00	4,294,000
T D C ソフト	1,100	1,010.00	1,111,000
ヤフー	85,400	360.00	30,744,000
トレンドマイクロ	6,300	6,190.00	38,997,000
インフォメーション・ディベロプメント	400	1,406.00	562,400
日本オラクル	1,900	7,450.00	14,155,000
アルファシステムズ	400	2,615.00	1,046,000
フューチャー	1,600	1,488.00	2,380,800
C A C H o l d i n g s	900	992.00	892,800
ソフトバンク・テクノロジー	500	2,080.00	1,040,000
トーセ	300	923.00	276,900
オービックビジネスコンサルタント	600	8,780.00	5,268,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,400	2,093.00	11,302,200
アイティフォー	1,500	902.00	1,353,000
東計電算	200	3,075.00	615,000

エクスネット	200	970.00	194,000
大塚商会	6,400	3,630.00	23,232,000
サイボウズ	1,400	691.00	967,400
ソフトブレーン	900	490.00	441,000
電通国際情報サービス	700	3,820.00	2,674,000
デジタルガレージ	2,200	2,858.00	6,287,600
E Mシステムズ	800	1,173.00	938,400
ウェザーニューズ	400	3,220.00	1,288,000
C I J	900	743.00	668,700
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,101.00	210,100
日本エンタープライズ	1,300	220.00	286,000
WOWOW	600	3,240.00	1,944,000
スカラ	1,000	874.00	874,000
I M A G I C A G R O U P	1,000	555.00	555,000
ネットワンシステムズ	4,800	2,209.00	10,603,200
システムソフト	2,900	98.00	284,200
アルゴグラフィックス	500	4,435.00	2,217,500
マーベラス	2,000	809.00	1,618,000
エイベックス	2,200	1,486.00	3,269,200
日本ユニシス	3,300	2,428.00	8,012,400
兼松エレクトロニクス	700	3,275.00	2,292,500
東京放送ホールディングス	6,600	2,069.00	13,655,400
日本テレビホールディングス	10,900	1,792.00	19,532,800
朝日放送グループホールディングス	1,200	749.00	898,800
テレビ朝日ホールディングス	3,300	2,079.00	6,860,700
スカパーJ S A Tホールディングス	9,000	496.00	4,464,000
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,556.00	2,556,000
日本BS放送	400	1,211.00	484,400
ビジョン	400	3,790.00	1,516,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	500	1,072.00	536,000
ワイヤレスゲート	600	545.00	327,000
コネクシオ	900	1,828.00	1,645,200
クロップス	300	758.00	227,400
日本電信電話	85,100	4,890.00	416,139,000
K D D I	104,500	2,836.00	296,362,000
光通信	1,400	18,780.00	26,292,000

NTTドコモ	85,200	2,886.50	245,929,800
エムティーアイ	1,400	565.00	791,000
GMOインターネット	4,300	1,523.00	6,548,900
アイドママーケティングコミュニケーション	300	616.00	184,800
カドカワ	3,500	1,097.00	3,839,500
学研ホールディングス	400	5,430.00	2,172,000
ゼンリン	2,200	2,933.00	6,452,600
昭文社	600	562.00	337,200
インプレスホールディングス	1,200	161.00	193,200
アイネット	700	1,558.00	1,090,600
松竹	800	10,580.00	8,464,000
東宝	7,800	3,565.00	27,807,000
東映	400	12,180.00	4,872,000
エヌ・ティ・ティ・データ	36,800	1,429.00	52,587,200
ピー・シー・エー	200	1,839.00	367,800
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,069.00	413,800
D T S	1,200	3,770.00	4,524,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,500	3,935.00	21,642,500
シーイーシー	1,400	2,296.00	3,214,400
カプコン	5,100	2,435.00	12,418,500
アイ・エス・ビー	200	2,308.00	461,600
ジャステック	700	1,052.00	736,400
S C S K	2,700	4,585.00	12,379,500
日本システムウエア	400	1,721.00	688,400
アイネス	1,500	1,182.00	1,773,000
T K C	1,000	4,205.00	4,205,000
富士ソフト	1,800	5,090.00	9,162,000
N S D	1,900	2,227.00	4,231,300
コナミホールディングス	4,800	4,220.00	20,256,000
福井コンピュータホールディングス	400	1,735.00	694,000
J B C Cホールディングス	900	1,531.00	1,377,900
ミロク情報サービス	1,100	2,070.00	2,277,000
ソフトバンクグループ	53,600	8,628.00	462,460,800
ハウスイ	100	955.00	95,500
高千穂交易	500	1,017.00	508,500
伊藤忠食品	300	5,280.00	1,584,000

エレマテック	600	2,247.00	1,348,200	
JALUX	400	2,670.00	1,068,000	
あらた	600	4,540.00	2,724,000	
トーメンデバイス	200	2,386.00	477,200	
東京エレクトロン デバイス	400	1,762.00	704,800	
フィールズ	1,000	887.00	887,000	
双日	70,400	370.00	26,048,000	
アルフレッサ ホールディングス	13,200	2,828.00	37,329,600	
横浜冷凍	3,100	862.00	2,672,200	
神栄	200	1,111.00	222,200	
ラサ商事	600	934.00	560,400	
ラクーン	800	542.00	433,600	
アルコニックス	1,300	1,232.00	1,601,600	
神戸物産	900	5,780.00	5,202,000	
あい ホールディングス	1,900	2,074.00	3,940,600	
ディーブイエックス	500	1,262.00	631,000	
ダイワボウホールディングス	1,000	6,510.00	6,510,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,300	1,642.00	3,776,600	
ラクト・ジャパン	300	6,470.00	1,941,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	1,143.00	2,514,600	
八洲電機	900	802.00	721,800	
メディアスホールディングス	700	810.00	567,000	
UKCホールディングス	800	2,140.00	1,712,000	
ジューテックホールディングス	300	999.00	299,700	
大光	300	705.00	211,500	
OCHIホールディングス	400	1,214.00	485,600	
TOKAIホールディングス	6,300	952.00	5,997,600	
黒谷	200	480.00	96,000	
Cominix	200	836.00	167,200	
三洋貿易	600	1,735.00	1,041,000	
ビューティガレージ	200	1,727.00	345,400	
ウイン・パートナーズ	900	1,140.00	1,026,000	
ミタチ産業	300	781.00	234,300	
シップヘルスケアホールディングス	2,500	4,085.00	10,212,500	
明治電機工業	400	1,686.00	674,400	
デリカフーズホールディングス	200	1,497.00	299,400	

スターティアホールディングス	300	609.00	182,700
コメダホールディングス	2,300	2,201.00	5,062,300
富士興産	500	616.00	308,000
協栄産業	200	1,792.00	358,400
小野建	1,000	1,580.00	1,580,000
佐島電機	900	973.00	875,700
エコートレーディング	300	643.00	192,900
伯東	800	1,385.00	1,108,000
コンドーテック	900	1,016.00	914,400
中山福	700	634.00	443,800
ナガイレーベン	1,700	2,482.00	4,219,400
三菱食品	1,300	2,778.00	3,611,400
松田産業	900	1,396.00	1,256,400
第一興商	1,800	5,080.00	9,144,000
メディバルホールディングス	12,100	2,284.00	27,636,400
S P K	300	2,380.00	714,000
萩原電気ホールディングス	400	2,892.00	1,156,800
アズワン	900	8,050.00	7,245,000
スズデン	400	1,255.00	502,000
シモジマ	700	981.00	686,700
ドウシシャ	1,300	2,139.00	2,780,700
小津産業	300	1,968.00	590,400
高速	700	1,013.00	709,100
たけびし	400	1,486.00	594,400
リックス	300	1,506.00	451,800
丸文	1,000	738.00	738,000
ハピネット	900	1,666.00	1,499,400
橋本総業ホールディングス	300	1,307.00	392,100
日本ライフライン	3,500	1,573.00	5,505,500
タカショー	600	471.00	282,600
エクセル	500	1,869.00	934,500
マルカキカイ	400	2,262.00	904,800
I D O M	3,800	359.00	1,364,200
日本エム・ディ・エム	800	1,230.00	984,000
進和	700	2,171.00	1,519,700
エスケイジャパン	300	847.00	254,100

ダイترون	600	1,803.00	1,081,800
シークス	1,500	1,456.00	2,184,000
田中商事	400	630.00	252,000
オーハシテクニカ	700	1,398.00	978,600
白銅	400	1,730.00	692,000
伊藤忠商事	87,300	2,016.00	175,996,800
丸紅	100,200	885.60	88,737,120
高島	200	1,940.00	388,000
長瀬産業	7,100	1,677.00	11,906,700
蝶理	800	1,811.00	1,448,800
豊田通商	13,300	3,870.00	51,471,000
三共生興	2,000	438.00	876,000
兼松	5,100	1,416.00	7,221,600
ツカモトコーポレーション	200	1,185.00	237,000
三井物産	98,000	1,847.00	181,006,000
日本紙パルプ商事	600	3,920.00	2,352,000
日立ハイテクノロジーズ	4,100	3,695.00	15,149,500
カメイ	1,500	1,208.00	1,812,000
東都水産	200	2,046.00	409,200
OUGホールディングス	200	2,612.00	522,400
スターゼン	500	4,460.00	2,230,000
山善	4,700	1,187.00	5,578,900
椿本興業	300	2,920.00	876,000
住友商事	75,000	1,670.50	125,287,500
内田洋行	600	2,575.00	1,545,000
三菱商事	83,400	3,157.00	263,293,800
第一実業	500	3,545.00	1,772,500
キヤノンマーケティングジャパン	3,400	1,961.00	6,667,400
西華産業	700	1,668.00	1,167,600
佐藤商事	1,100	1,015.00	1,116,500
菱洋エレクトロ	1,100	1,558.00	1,713,800
東京産業	1,200	599.00	718,800
ユアサ商事	1,100	3,535.00	3,888,500
神鋼商事	300	2,696.00	808,800
小林産業	700	313.00	219,100
阪和興業	2,200	3,455.00	7,601,000

正栄食品工業	600	3,995.00	2,397,000
カナデン	1,100	1,127.00	1,239,700
菱電商事	900	1,530.00	1,377,000
フルサト工業	700	1,579.00	1,105,300
岩谷産業	2,600	3,800.00	9,880,000
すてきナイスグループ	500	1,163.00	581,500
昭光通商	500	785.00	392,500
ニチモウ	200	1,525.00	305,000
極東貿易	400	1,954.00	781,600
イワキ	1,400	524.00	733,600
三愛石油	3,200	1,250.00	4,000,000
稲畑産業	2,900	1,475.00	4,277,500
G S Iクレオス	300	1,332.00	399,600
明和産業	1,100	411.00	452,100
ワキタ	2,500	1,169.00	2,922,500
東邦ホールディングス	3,500	2,883.00	10,090,500
サンゲツ	3,900	2,047.00	7,983,300
ミツウロコグループホールディングス	1,700	704.00	1,196,800
シナネンホールディングス	500	2,544.00	1,272,000
伊藤忠エネクス	2,600	1,066.00	2,771,600
サンリオ	3,400	2,309.00	7,850,600
サンワテクノス	800	1,149.00	919,200
リョーサン	1,300	3,170.00	4,121,000
新光商事	1,300	1,513.00	1,966,900
トーヨー	600	2,211.00	1,326,600
三信電気	1,100	1,748.00	1,922,800
東陽テクニカ	1,400	844.00	1,181,600
モスフードサービス	1,600	2,963.00	4,740,800
加賀電子	1,100	2,356.00	2,591,600
ソーダニッカ	1,200	602.00	722,400
立花エレットク	800	1,700.00	1,360,000
フォーバル	500	962.00	481,000
P A L T A C	1,700	4,985.00	8,474,500
三谷産業	1,400	315.00	441,000
太平洋興発	500	878.00	439,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	300	5,050.00	1,515,000

ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,292.00	129,200
国際紙パルプ商事	2,200	322.00	708,400
ヤマタネ	600	1,781.00	1,068,600
丸紅建材リース	100	2,141.00	214,100
日鉄住金物産	900	4,610.00	4,149,000
泉州電業	400	2,613.00	1,045,200
トラスコ中山	2,500	2,786.00	6,965,000
オートバックスセブン	4,700	1,890.00	8,883,000
モリト	800	824.00	659,200
加藤産業	1,900	3,425.00	6,507,500
イノテック	1,000	1,181.00	1,181,000
イエローハット	1,100	2,666.00	2,932,600
J Kホールディングス	1,200	676.00	811,200
日伝	1,000	1,747.00	1,747,000
北沢産業	1,100	224.00	246,400
杉本商事	600	1,885.00	1,131,000
因幡電機産業	1,600	4,245.00	6,792,000
パイテックホールディングス	500	2,138.00	1,069,000
東テク	400	2,884.00	1,153,600
ミスミグループ本社	14,000	2,184.00	30,576,000
アルテック	1,000	254.00	254,000
タキヒヨー	400	1,822.00	728,800
蔵王産業	200	1,436.00	287,200
スズケン	5,400	5,190.00	28,026,000
ジェコス	800	1,045.00	836,000
ルネサスイーストン	1,100	462.00	508,200
ローソン	3,000	6,900.00	20,700,000
サンエー	900	4,685.00	4,216,500
カワチ薬品	900	2,116.00	1,904,400
エービーシー・マート	2,200	6,450.00	14,190,000
ハードオフコーポレーション	500	923.00	461,500
アスクル	1,000	3,065.00	3,065,000
ゲオホールディングス	2,000	1,635.00	3,270,000
アダストリア	1,800	1,801.00	3,241,800
ジーフット	700	742.00	519,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	732.00	146,400

くらコーポレーション	700	6,430.00	4,501,000	
キャンドウ	600	1,661.00	996,600	
パルグループホールディングス	600	3,250.00	1,950,000	
エディオン	4,700	1,195.00	5,616,500	
サーラコーポレーション	2,500	632.00	1,580,000	
ワッツ	400	895.00	358,000	
ハローズ	400	2,452.00	980,800	
あみやき亭	300	3,965.00	1,189,500	
ひらまつ	1,800	430.00	774,000	
大黒天物産	300	4,160.00	1,248,000	
ハニーズホールディングス	1,200	892.00	1,070,400	
ファーマライズホールディングス	300	604.00	181,200	
アルペン	900	1,877.00	1,689,300	
ハブ	400	873.00	349,200	
クオールホールディングス	1,300	2,290.00	2,977,000	
ジーンズ	800	6,170.00	4,936,000	
ビックカメラ	6,300	1,436.00	9,046,800	
D C Mホールディングス	6,400	1,071.00	6,854,400	
ペッパーフードサービス	900	3,125.00	2,812,500	
Monotaro	7,500	2,533.00	18,997,500	
東京一番フーズ	300	601.00	180,300	
D Dホールディングス	300	2,194.00	658,200	
きちり	400	792.00	316,800	
アークランドサービスホールディングス	900	2,203.00	1,982,700	
J . フロント リテイリング	14,400	1,427.00	20,548,800	
ドトール・日レスホールディングス	2,100	2,030.00	4,263,000	
マツモトキヨシホールディングス	4,900	3,720.00	18,228,000	
ブロンコピリー	600	2,916.00	1,749,600	
Z O Z O	11,800	2,747.00	32,414,600	
トレジャー・ファクトリー	400	659.00	263,600	
物語コーポレーション	300	9,880.00	2,964,000	
ココカラファイン	1,300	5,730.00	7,449,000	
三越伊勢丹ホールディングス	22,200	1,246.00	27,661,200	
H a m e e	300	1,706.00	511,800	
ウエルシアホールディングス	3,200	5,610.00	17,952,000	
クリエイトSDホールディングス	1,700	2,717.00	4,618,900	

丸善C H Iホールディングス	1,400	342.00	478,800
ミサワ	300	444.00	133,200
ティーライフ	200	962.00	192,400
エー・ピーカンパニー	300	608.00	182,400
チムニー	400	2,777.00	1,110,800
シュッピン	800	1,353.00	1,082,400
ネクステージ	1,900	922.00	1,751,800
ジョイフル本田	3,500	1,578.00	5,523,000
鳥貴族	400	2,025.00	810,000
キリン堂ホールディングス	500	1,405.00	702,500
ホットランド	600	1,297.00	778,200
すかいらーくホールディングス	11,100	1,703.00	18,903,300
綿半ホールディングス	500	2,386.00	1,193,000
ヨシックス	200	2,472.00	494,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	1,166.00	4,547,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	865.00	432,500
B E E N O S	300	1,622.00	486,600
あさひ	900	1,366.00	1,229,400
日本調剤	400	3,465.00	1,386,000
コスモス薬品	600	22,220.00	13,332,000
トーエル	600	825.00	495,000
一六堂	300	362.00	108,600
オンリー	200	1,018.00	203,600
セブン&アイ・ホールディングス	49,800	4,766.00	237,346,800
薬王堂	500	3,345.00	1,672,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,200	1,193.00	3,817,600
ツルハホールディングス	2,600	10,860.00	28,236,000
サンマルクホールディングス	900	2,632.00	2,368,800
フェリシモ	300	1,188.00	356,400
トリドールホールディングス	1,500	1,905.00	2,857,500
T O K Y O B A S E	1,100	592.00	651,200
ジャパンミート	500	1,970.00	985,000
サツドラホールディングス	200	1,970.00	394,000
ダイユー・リックホールディングス	600	1,020.00	612,000
パロックジャパンリミテッド	1,000	961.00	961,000

クスリのアオキホールディングス	900	7,570.00	6,813,000	
力の源ホールディングス	300	928.00	278,400	
スシログローバルホールディングス	1,300	5,740.00	7,462,000	
LIXILビバ	1,500	1,642.00	2,463,000	
メディカルシステムネットワーク	1,400	492.00	688,800	
はるやまホールディングス	600	883.00	529,800	
ノジマ	2,100	2,471.00	5,189,100	
カッパ・クリエイト	1,500	1,331.00	1,996,500	
ライトオン	1,000	919.00	919,000	
ジーンズメイト	400	607.00	242,800	
良品計画	1,600	28,210.00	45,136,000	
三城ホールディングス	1,500	471.00	706,500	
アドヴァン	1,300	998.00	1,297,400	
アルピス	400	2,820.00	1,128,000	
コナカ	1,500	485.00	727,500	
ハウス オブ ローゼ	200	1,814.00	362,800	
G - 7ホールディングス	400	2,412.00	964,800	
イオン北海道	1,200	788.00	945,600	
コジマ	1,800	480.00	864,000	
ヒマラヤ	400	941.00	376,400	
コーナン商事	1,700	2,835.00	4,819,500	
エコス	500	1,905.00	952,500	
ワタミ	1,400	1,342.00	1,878,800	
マルシェ	400	797.00	318,800	
ドンキホーテホールディングス	7,700	6,790.00	52,283,000	
西松屋チェーン	2,600	981.00	2,550,600	
ゼンショーホールディングス	6,200	2,054.00	12,734,800	
幸楽苑ホールディングス	800	1,569.00	1,255,200	
ハークスレイ	300	1,022.00	306,600	
サイゼリヤ	2,000	2,019.00	4,038,000	
V Tホールディングス	4,000	454.00	1,816,000	
魚力	300	1,375.00	412,500	
ポブラ	400	588.00	235,200	
フジ・コーポレーション	200	2,083.00	416,600	
ユナイテッドアローズ	1,500	4,530.00	6,795,000	
ハイデイ日高	1,600	2,164.00	3,462,400	

京都きもの友禅	800	474.00	379,200
コロワイド	4,000	2,701.00	10,804,000
ピーシーデポコーポレーション	1,800	536.00	964,800
壱番屋	800	4,230.00	3,384,000
P L A N T	300	1,151.00	345,300
スギホールディングス	2,600	5,000.00	13,000,000
ヴィア・ホールディングス	1,500	703.00	1,054,500
スクロール	1,900	569.00	1,081,100
ヨンドシーホールディングス	1,200	2,303.00	2,763,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,800	12,850.00	48,830,000
木曽路	1,500	2,647.00	3,970,500
S R Sホールディングス	1,400	987.00	1,381,800
千趣会	2,200	335.00	737,000
タカキュー	1,100	197.00	216,700
ケーヨー	2,200	553.00	1,216,600
上新電機	1,400	2,804.00	3,925,600
日本瓦斯	2,200	3,485.00	7,667,000
ロイヤルホールディングス	2,100	2,762.00	5,800,200
東天紅	100	1,500.00	150,000
いなげや	1,300	1,533.00	1,992,900
島忠	2,700	2,884.00	7,786,800
チヨダ	1,400	2,091.00	2,927,400
ライフコーポレーション	900	2,793.00	2,513,700
リンガーハット	1,500	2,248.00	3,372,000
Mr M a x H D	1,600	505.00	808,000
テンアライド	1,200	432.00	518,400
A O K Iホールディングス	2,400	1,459.00	3,501,600
オークワ	1,700	1,109.00	1,885,300
コメリ	1,800	2,466.00	4,438,800
青山商事	2,300	3,360.00	7,728,000
しまむら	1,400	9,130.00	12,782,000
はせがわ	700	460.00	322,000
高島屋	9,300	1,689.00	15,707,700
松屋	2,400	993.00	2,383,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,700	1,653.00	9,422,100
近鉄百貨店	500	3,490.00	1,745,000

パルコ	1,100	1,153.00	1,268,300
丸井グループ	10,900	2,429.00	26,476,100
アクシアル リテイリング	1,000	3,535.00	3,535,000
イオン	45,800	2,549.50	116,767,100
イズミ	2,200	5,850.00	12,870,000
平和堂	2,400	2,825.00	6,780,000
フジ	1,400	1,996.00	2,794,400
ヤオコー	1,300	6,020.00	7,826,000
ゼビオホールディングス	1,600	1,515.00	2,424,000
ケーズホールディングス	10,700	1,420.00	15,194,000
Olympicグループ	700	794.00	555,800
日産東京販売ホールディングス	1,800	334.00	601,200
Genky DrugStores	500	3,540.00	1,770,000
総合メディカルホールディングス	1,000	2,309.00	2,309,000
ブックオフグループホールディングス	700	739.00	517,300
アインホールディングス	1,600	8,500.00	13,600,000
元気寿司	300	5,800.00	1,740,000
ヤマダ電機	40,600	526.00	21,355,600
アークランドサカモト	2,000	1,462.00	2,924,000
ニトリホールディングス	4,900	13,905.00	68,134,500
愛眼	1,000	303.00	303,000
ケーユーホールディングス	600	901.00	540,600
吉野家ホールディングス	4,000	1,827.00	7,308,000
松屋フーズホールディングス	600	3,595.00	2,157,000
サガミホールディングス	1,600	1,321.00	2,113,600
関西スーパーマーケット	900	1,010.00	909,000
王将フードサービス	900	7,630.00	6,867,000
プレナス	1,300	1,753.00	2,278,900
ミニストップ	900	2,035.00	1,831,500
アークス	2,200	2,627.00	5,779,400
パローホールディングス	2,800	2,354.00	6,591,200
藤久	100	1,044.00	104,400
ベルク	500	5,560.00	2,780,000
大庄	600	1,642.00	985,200
ファーストリテイリング	1,600	55,530.00	88,848,000
サンドラッグ	4,500	3,905.00	17,572,500

サクスパー ホールディングス	1,100	970.00	1,067,000	
ヤマザワ	200	1,602.00	320,400	
やまや	200	2,509.00	501,800	
ペルーナ	2,900	1,036.00	3,004,400	
島根銀行	300	1,163.00	348,900	
じもとホールディングス	8,100	144.00	1,166,400	
めぶきフィナンシャルグループ	61,900	341.00	21,107,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,600	1,779.00	2,846,400	
九州フィナンシャルグループ	19,500	486.00	9,477,000	
ゆうちょ銀行	33,700	1,296.00	43,675,200	
富山第一銀行	3,000	412.00	1,236,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	75,900	496.00	37,646,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,600	1,024.00	7,782,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	5,600	886.00	4,961,600	
三十三フィナンシャルグループ	1,000	1,974.00	1,974,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,100	3,990.00	8,379,000	
新生銀行	9,800	1,642.00	16,091,600	
あおぞら銀行	7,100	3,715.00	26,376,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	829,300	653.10	541,615,830	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	130,700	584.10	76,341,870	
三井住友トラスト・ホールディングス	23,300	4,352.00	101,401,600	
三井住友フィナンシャルグループ	89,100	4,248.00	378,496,800	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	42,200	701.00	29,582,200	
群馬銀行	23,800	504.00	11,995,200	
武蔵野銀行	1,900	2,916.00	5,540,400	
千葉興業銀行	3,300	429.00	1,415,700	
筑波銀行	5,000	247.00	1,235,000	
七十七銀行	3,700	2,305.00	8,528,500	
青森銀行	900	2,975.00	2,677,500	
秋田銀行	800	2,554.00	2,043,200	
山形銀行	1,300	2,252.00	2,927,600	
岩手銀行	800	4,115.00	3,292,000	
東邦銀行	10,600	392.00	4,155,200	
東北銀行	600	1,264.00	758,400	
みちのく銀行	800	1,754.00	1,403,200	

ふくおかフィナンシャルグループ	9,700	2,713.00	26,316,100	
静岡銀行	30,000	955.00	28,650,000	
十六銀行	1,600	2,552.00	4,083,200	
スルガ銀行	12,200	487.00	5,941,400	
八十二銀行	21,500	461.00	9,911,500	
山梨中央銀行	1,500	1,575.00	2,362,500	
大垣共立銀行	1,900	2,534.00	4,814,600	
福井銀行	1,000	2,062.00	2,062,000	
北國銀行	1,400	3,655.00	5,117,000	
清水銀行	500	1,904.00	952,000	
富山銀行	200	3,600.00	720,000	
滋賀銀行	2,400	2,559.00	6,141,600	
南都銀行	1,400	2,519.00	3,526,600	
百五銀行	11,400	398.00	4,537,200	
京都銀行	4,600	4,910.00	22,586,000	
紀陽銀行	4,500	1,587.00	7,141,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,900	1,369.00	10,815,100	
広島銀行	17,600	678.00	11,932,800	
山陰合同銀行	7,000	832.00	5,824,000	
中国銀行	8,200	1,004.00	8,232,800	
鳥取銀行	400	1,581.00	632,400	
伊予銀行	17,000	654.00	11,118,000	
百十四銀行	1,300	2,795.00	3,633,500	
四国銀行	1,800	1,176.00	2,116,800	
阿波銀行	1,900	2,876.00	5,464,400	
大分銀行	700	3,670.00	2,569,000	
宮崎銀行	800	2,861.00	2,288,800	
佐賀銀行	700	2,087.00	1,460,900	
十八銀行	700	3,235.00	2,264,500	
沖縄銀行	1,200	3,645.00	4,374,000	
琉球銀行	2,800	1,221.00	3,418,800	
セブン銀行	44,700	347.00	15,510,900	
みずほフィナンシャルグループ	1,618,000	188.60	305,154,800	
高知銀行	500	988.00	494,000	
山口フィナンシャルグループ	14,900	1,160.00	17,284,000	
長野銀行	400	1,663.00	665,200	

名古屋銀行	1,000	3,595.00	3,595,000	
北洋銀行	18,000	336.00	6,048,000	
愛知銀行	400	4,290.00	1,716,000	
中京銀行	500	2,275.00	1,137,500	
大光銀行	400	1,920.00	768,000	
愛媛銀行	1,700	1,158.00	1,968,600	
トマト銀行	500	1,355.00	677,500	
京葉銀行	5,300	803.00	4,255,900	
栃木銀行	6,200	323.00	2,002,600	
北日本銀行	400	2,410.00	964,000	
東和銀行	2,100	892.00	1,873,200	
福島銀行	1,200	591.00	709,200	
大東銀行	600	942.00	565,200	
トモニホールディングス	9,800	417.00	4,086,600	
フィデアホールディングス	11,500	150.00	1,725,000	
池田泉州ホールディングス	12,600	343.00	4,321,800	
F P G	3,800	1,015.00	3,857,000	
マーキュリアインベストメント	500	775.00	387,500	
S B Iホールディングス	13,500	2,852.00	38,502,000	
ジャフコ	1,700	4,035.00	6,859,500	
大和証券グループ本社	101,900	650.50	66,285,950	
野村ホールディングス	208,900	528.00	110,299,200	
岡三証券グループ	10,200	516.00	5,263,200	
丸三証券	3,800	870.00	3,306,000	
東洋証券	4,400	218.00	959,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,200	575.00	7,590,000	
光世証券	300	1,029.00	308,700	
水戸証券	3,600	324.00	1,166,400	
いちよし証券	2,500	932.00	2,330,000	
松井証券	5,900	1,172.00	6,914,800	
だいこう証券ビジネス	600	475.00	285,000	
マネックスグループ	12,200	463.00	5,648,600	
カブドットコム証券	7,600	393.00	2,986,800	
極東証券	1,600	1,304.00	2,086,400	
岩井コスモホールディングス	1,200	1,402.00	1,682,400	
藍澤証券	2,300	718.00	1,651,400	

マネーパートナーズグループ	1,600	348.00	556,800	
かんぽ生命保険	4,500	2,672.00	12,024,000	
S O M P Oホールディングス	23,400	4,580.00	107,172,000	
アニコム ホールディングス	800	3,225.00	2,580,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	31,100	3,401.00	105,771,100	
ソニーフィナンシャルホールディングス	9,800	2,415.00	23,667,000	
第一生命ホールディングス	67,400	2,122.00	143,022,800	
東京海上ホールディングス	44,900	5,153.00	231,369,700	
T & Dホールディングス	36,800	1,770.00	65,136,000	
アドバンスクリエイト	300	2,009.00	602,700	
全国保証	3,400	3,965.00	13,481,000	
ジェイリース	200	653.00	130,600	
イントラスト	300	437.00	131,100	
アルヒ	1,400	1,782.00	2,494,800	
クレディセゾン	9,000	1,689.00	15,201,000	
芙蓉総合リース	1,400	6,030.00	8,442,000	
興銀リース	2,200	2,721.00	5,986,200	
東京センチュリー	2,400	5,710.00	13,704,000	
日本証券金融	5,100	614.00	3,131,400	
アイフル	20,200	295.00	5,959,000	
リコーリース	900	3,460.00	3,114,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,400	2,074.00	17,421,600	
アコム	24,000	406.00	9,744,000	
ジャックス	1,400	2,072.00	2,900,800	
オリエントコーポレーション	25,900	165.00	4,273,500	
日立キャピタル	3,300	2,699.00	8,906,700	
アプラスフィナンシャル	6,000	98.00	588,000	
オリックス	79,400	1,716.50	136,290,100	
三菱UFJリース	30,200	563.00	17,002,600	
九州リースサービス	600	680.00	408,000	
日本取引所グループ	34,200	1,865.00	63,783,000	
イー・ギャランティ	1,300	1,143.00	1,485,900	
アサックス	500	550.00	275,000	
N E Cキャピタルソリューション	500	1,765.00	882,500	
いちご	17,000	356.00	6,052,000	

日本駐車場開発	14,400	147.00	2,116,800
ヒューリック	24,900	985.00	24,526,500
三栄建築設計	500	1,467.00	733,500
スター・マイカ	600	1,487.00	892,200
野村不動産ホールディングス	7,900	2,154.00	17,016,600
三重交通グループホールディングス	2,400	509.00	1,221,600
サムティ	1,700	1,489.00	2,531,300
ディア・ライフ	1,500	520.00	780,000
コーセーアールイー	300	847.00	254,100
エー・ディー・ワークス	17,300	38.00	657,400
日本商業開発	700	1,675.00	1,172,500
プレサンスコーポレーション	1,700	1,240.00	2,108,000
ユニゾホールディングス	1,700	2,100.00	3,570,000
THEグローバル社	600	704.00	422,400
日本管理センター	800	1,230.00	984,000
サンセイランディック	300	1,064.00	319,200
エストラスト	200	762.00	152,400
フージャースホールディングス	2,900	606.00	1,757,400
オープンハウス	1,900	4,300.00	8,170,000
東急不動産ホールディングス	28,900	638.00	18,438,200
飯田グループホールディングス	9,900	2,000.00	19,800,000
イーランド	200	712.00	142,400
ムゲンエステート	800	621.00	496,800
ファーストブラザーズ	300	1,169.00	350,700
ハウスドゥ	400	1,648.00	659,200
シーアールイー	400	953.00	381,200
プロパティエージェント	100	938.00	93,800
ケイアイスター不動産	400	1,892.00	756,800
アグレ都市デザイン	200	738.00	147,600
グッドコムアセット	200	1,765.00	353,000
パーク24	7,000	2,981.00	20,867,000
バラカ	300	1,944.00	583,200
三井不動産	60,400	2,561.00	154,684,400
三菱地所	88,700	1,801.00	159,748,700
平和不動産	2,100	1,995.00	4,189,500
東京建物	13,000	1,184.00	15,392,000

ダイビル	3,100	1,063.00	3,295,300
京阪神ビルディング	2,000	825.00	1,650,000
住友不動産	28,600	3,942.00	112,741,200
大京	1,900	2,396.00	4,552,400
テーオーシー	4,100	755.00	3,095,500
東京楽天地	200	4,700.00	940,000
レオパレス21	14,300	522.00	7,464,600
スターツコーポレーション	1,600	2,247.00	3,595,200
フジ住宅	1,500	790.00	1,185,000
空港施設	1,200	590.00	708,000
明和地所	700	611.00	427,700
ゴールドクレスト	900	1,731.00	1,557,900
日本エスリード	500	1,419.00	709,500
日神不動産	1,600	499.00	798,400
日本エスコン	2,200	652.00	1,434,400
タカラレーベン	5,600	304.00	1,702,400
サンヨーハウジング名古屋	700	976.00	683,200
イオンモール	7,700	2,007.00	15,453,900
ファースト住建	400	1,337.00	534,800
カチタス	1,600	2,540.00	4,064,000
トーセイ	1,700	984.00	1,672,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,400	1,680.00	12,432,000
サンフロンティア不動産	1,500	1,081.00	1,621,500
エフ・ジェー・ネクスト	900	802.00	721,800
インテリックス	400	750.00	300,000
ランドビジネス	700	555.00	388,500
グランディハウス	1,100	443.00	487,300
日本空港ビルディング	3,500	4,145.00	14,507,500
日本工営	800	2,439.00	1,951,200
LIFULL	4,000	705.00	2,820,000
ジェイエイシーリクルートメント	900	2,031.00	1,827,900
日本M&Aセンター	8,100	2,741.00	22,202,100
メンバーズ	400	1,230.00	492,000
中広	100	661.00	66,100
タケエイ	1,200	707.00	848,400
E・Jホールディングス	200	1,185.00	237,000

トラスト・テック	600	3,320.00	1,992,000
コシダカホールディングス	3,100	1,287.00	3,989,700
アルトナー	200	776.00	155,200
パソナグループ	1,100	1,353.00	1,488,300
C D S	300	1,184.00	355,200
リンクアンドモチベーション	2,100	1,067.00	2,240,700
G C A	1,200	856.00	1,027,200
エス・エム・エス	4,600	1,754.00	8,068,400
パーソルホールディングス	10,800	2,101.00	22,690,800
リニカル	700	1,481.00	1,036,700
クックパッド	3,600	393.00	1,414,800
エスクリ	400	663.00	265,200
アイ・ケイ・ケイ	600	688.00	412,800
学情	500	1,476.00	738,000
スタジオアリス	600	2,510.00	1,506,000
シミックホールディングス	600	1,958.00	1,174,800
N J S	300	1,689.00	506,700
総合警備保障	4,600	4,720.00	21,712,000
カカクコム	8,700	2,001.00	17,408,700
アイロムグループ	400	1,750.00	700,000
セントケア・ホールディング	600	615.00	369,000
サイネックス	200	749.00	149,800
ルネサンス	600	2,337.00	1,402,200
ディップ	1,600	2,428.00	3,884,800
オプトホールディング	700	2,410.00	1,687,000
新日本科学	1,600	502.00	803,200
ツクイ	2,700	936.00	2,527,200
キャリアデザインセンター	300	1,481.00	444,300
エムスリー	24,300	1,822.00	44,274,600
ツカダ・グローバルホールディング	700	592.00	414,400
プラス	100	584.00	58,400
アウトソーシング	6,100	1,401.00	8,546,100
ウェルネット	1,200	1,037.00	1,244,400
ワールドホールディングス	300	2,540.00	762,000
ディー・エヌ・エー	6,200	1,854.00	11,494,800
博報堂D Yホールディングス	16,000	1,876.00	30,016,000

ぐるなび	1,800	911.00	1,639,800
エスアールジータカミヤ	1,400	622.00	870,800
ジャパンベストレスキューシステム	900	1,036.00	932,400
ファンコミュニケーションズ	3,200	581.00	1,859,200
ライク	400	1,572.00	628,800
ビジネス・ブレークスルー	600	394.00	236,400
WDBホールディングス	500	3,020.00	1,510,000
ティア	500	761.00	380,500
CDG	100	1,543.00	154,300
バリューコマース	800	1,875.00	1,500,000
インフォマート	6,300	1,125.00	7,087,500
JPHホールディングス	3,600	281.00	1,011,600
エコナックホールディングス	2,500	111.00	277,500
EPSホールディングス	1,700	2,067.00	3,513,900
レグス	300	1,023.00	306,900
プレステージ・インターナショナル	2,400	1,231.00	2,954,400
アミューズ	800	2,729.00	2,183,200
ドリームインキュベータ	400	1,789.00	715,600
クイック	700	1,700.00	1,190,000
TAC	800	243.00	194,400
ケネディクス	10,900	566.00	6,169,400
電通	14,100	5,260.00	74,166,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,758.00	1,054,800
ぴあ	400	5,090.00	2,036,000
イオンファンタジー	400	3,405.00	1,362,000
シーティーエス	1,300	562.00	730,600
みらかホールディングス	3,400	2,645.00	8,993,000
アルプス技研	1,000	2,233.00	2,233,000
ダイオーズ	300	1,307.00	392,100
日本空調サービス	1,300	772.00	1,003,600
オリエンタルランド	13,600	10,140.00	137,904,000
ダスキン	3,100	2,523.00	7,821,300
明光ネットワークジャパン	1,500	939.00	1,408,500
ファルコホールディングス	600	1,661.00	996,600
秀英予備校	300	485.00	145,500
田谷	300	640.00	192,000

ラウンドワン	3,600	1,276.00	4,593,600
リゾートトラスト	4,900	1,635.00	8,011,500
ビー・エム・エル	1,500	3,050.00	4,575,000
ワタベウェディング	200	625.00	125,000
りらいあコミュニケーションズ	1,900	1,207.00	2,293,300
リソー教育	2,000	1,106.00	2,212,000
早稲田アカデミー	200	1,811.00	362,200
ユー・エス・エス	14,100	1,977.00	27,875,700
東京個別指導学院	400	1,331.00	532,400
サイバーエージェント	7,100	4,740.00	33,654,000
楽天	53,800	739.80	39,801,240
クリーク・アンド・リバー社	700	994.00	695,800
テー・オー・ダブリュー	1,100	838.00	921,800
セントラルスポーツ	400	3,860.00	1,544,000
フルキャストホールディングス	1,200	1,991.00	2,389,200
エン・ジャパン	1,000	4,415.00	4,415,000
リソルホールディングス	100	4,150.00	415,000
テクノプロ・ホールディングス	2,200	5,600.00	12,320,000
アトラ	200	573.00	114,600
インターワークス	300	872.00	261,600
K e e P e r 技研	400	1,034.00	413,600
ファーストロジック	200	883.00	176,600
三機サービス	200	1,930.00	386,000
G u n o s y	700	2,881.00	2,016,700
デザインワン・ジャパン	200	510.00	102,000
イー・ガーディアン	600	2,258.00	1,354,800
リブセンス	700	324.00	226,800
ジャパンマテリアル	3,200	1,243.00	3,977,600
ベクトル	1,400	1,879.00	2,630,600
ウチヤマホールディングス	600	482.00	289,200
ライクキッズネクスト	300	1,102.00	330,600
キャリアリンク	400	402.00	160,800
I B J	800	618.00	494,400
アサンテ	500	2,196.00	1,098,000
N・フィールド	800	1,624.00	1,299,200
バリューHR	300	2,116.00	634,800

M & Aキャピタルパートナーズ	300	5,170.00	1,551,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,264.00	632,000	
E R Iホールディングス	300	939.00	281,700	
アビスト	200	3,495.00	699,000	
シグマクシス	600	968.00	580,800	
ウィルグループ	600	920.00	552,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,600	464.00	742,400	
日本ビューホテル	400	1,308.00	523,200	
リクルートホールディングス	89,000	2,846.50	253,338,500	
エラン	400	2,681.00	1,072,400	
土木管理総合試験所	500	575.00	287,500	
日本郵政	65,500	1,316.00	86,198,000	
ベルシステム24ホールディングス	1,900	1,504.00	2,857,600	
鎌倉新書	900	1,118.00	1,006,200	
一蔵	100	769.00	76,900	
L I T A L I C O	300	1,996.00	598,800	
グローバルグループ	100	1,354.00	135,400	
エボラブルアジア	300	2,116.00	634,800	
アトラエ	200	1,793.00	358,600	
ストライク	300	3,085.00	925,500	
ソラスト	2,200	1,182.00	2,600,400	
セラク	300	791.00	237,300	
インソース	400	2,095.00	838,000	
アイモバイル	300	670.00	201,000	
キャリアインデックス	400	1,449.00	579,600	
M S - J a p a n	500	1,576.00	788,000	
船場	200	1,016.00	203,200	
グレイステクノロジー	300	2,632.00	789,600	
フルテック	100	1,068.00	106,800	
グリーンズ	300	1,320.00	396,000	
ツナグ・ソリューションズ	100	757.00	75,700	
日総工産	400	2,378.00	951,200	
キュービーネットホールディングス	600	2,080.00	1,248,000	
スプリックス	300	2,579.00	773,700	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	971.00	388,400	
リログループ	6,300	2,638.00	16,619,400	

東祥	700	4,415.00	3,090,500	
エイチ・アイ・エス	2,100	3,385.00	7,108,500	
ラックランド	200	2,790.00	558,000	
共立メンテナンス	2,100	4,705.00	9,880,500	
イチネンホールディングス	1,300	1,256.00	1,632,800	
建設技術研究所	800	1,477.00	1,181,600	
スペース	800	1,241.00	992,800	
長大	500	820.00	410,000	
燦ホールディングス	300	2,545.00	763,500	
スバル興業	100	5,050.00	505,000	
東京テアトル	500	1,303.00	651,500	
タナベ経営	200	1,716.00	343,200	
ナガワ	200	4,890.00	978,000	
よみうりランド	300	4,020.00	1,206,000	
東京都競馬	800	3,790.00	3,032,000	
常磐興産	500	1,730.00	865,000	
カナモト	1,600	3,730.00	5,968,000	
東京ドーム	4,700	964.00	4,530,800	
西尾レントオール	1,200	3,480.00	4,176,000	
トランス・コスモス	1,300	2,502.00	3,252,600	
乃村工藝社	2,700	2,478.00	6,690,600	
藤田観光	500	2,994.00	1,497,000	
KNT-CTホールディングス	700	1,167.00	816,900	
日本管財	1,200	2,013.00	2,415,600	
トーカイ	1,100	2,201.00	2,421,100	
白洋舎	100	2,928.00	292,800	
セコム	12,200	8,963.00	109,348,600	
セントラル警備保障	600	4,925.00	2,955,000	
丹青社	2,400	1,070.00	2,568,000	
メイテック	1,400	4,630.00	6,482,000	
応用地質	1,200	1,295.00	1,554,000	
船井総研ホールディングス	2,400	2,232.00	5,356,800	
進学会ホールディングス	500	588.00	294,000	
オオバ	1,000	649.00	649,000	
いであ	200	1,071.00	214,200	
学究社	400	1,660.00	664,000	

ベネッセホールディングス	4,200	2,975.00	12,495,000	
イオンディライト	1,400	3,685.00	5,159,000	
ナック	800	988.00	790,400	
ニチイ学館	2,200	929.00	2,043,800	
ダイセキ	1,900	2,501.00	4,751,900	
ステップ	400	1,508.00	603,200	
合 計	13,911,500		27,555,913,710	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	424,419,839	161,793,334
金銭信託	-	231,905,007
コール・ローン	357,348,787	952,451,846
出資金	4,502,837	8,217,162
株式	79,605,811,014	86,957,039,121
投資証券	2,074,915,029	2,218,921,193
派生商品評価勘定	18,007,713	4,602,675
未収入金	181,725	107,998,029
未収配当金	63,655,859	77,429,302
差入委託証拠金	199,246,220	241,069,971
流動資産合計	82,748,089,023	90,961,427,640
資産合計	82,748,089,023	90,961,427,640
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	681,321	101,384,053
未払金	30,317,676	119,398,847
未払解約金	159,846,558	22,580,739
未払利息	468	1,498
流動負債合計	190,846,023	243,365,137
負債合計	190,846,023	243,365,137
純資産の部		
元本等		
元本	34,878,791,197	37,961,659,533
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	47,678,451,803	52,756,402,970
元本等合計	82,557,243,000	90,718,062,503
純資産合計	82,557,243,000	90,718,062,503
負債純資産合計	82,748,089,023	90,961,427,640

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
1.	期首	平成28年10月27日	平成29年10月27日
	期首元本額	38,877,746,606円	34,878,791,197円
	期首からの追加設定元本額	2,431,074,859円	6,427,442,010円

期首からの一部解約元本額	6,430,030,268円	3,344,573,674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)	15,103,205,248円	17,203,096,280円
DCインデックスバランス(株式20)	58,050,502円	80,398,407円
DCインデックスバランス(株式40)	179,902,285円	233,573,191円
DCインデックスバランス(株式60)	350,897,322円	447,780,159円
DCインデックスバランス(株式80)	381,859,625円	476,526,520円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,448,288,498円	2,074,639,698円
日興五大陸株式ファンド	5,838,410,861円	5,375,436,468円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	27,231,067円	18,815,844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)	200,803,262円	93,227,038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)	114,014,686円	147,464,472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)	-円	2,627,937,561円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	-円	25,916,934円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,718,625円	5,282,446円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	4,331,083円	4,311,945円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,633,016円	7,218,871円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	7,204,167円	6,309,667円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	5,576,111,060円	4,512,298,631円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	27,315,219円	26,918,914円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	81,059,833円	76,175,076円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	116,134,275円	112,997,773円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	118,739,544円	113,413,192円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,232,881,019円	4,291,920,446円
計	34,878,791,197円	37,961,659,533円
2. 受益権の総数	34,878,791,197口	37,961,659,533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 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	3,339,177
株式	11,517,859,996
投資証券	34,359,283
合計	11,548,880,102

(平成30年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	1,016,422
株式	417,790,428
投資証券	17,735,973
合計	401,070,877

(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)

(平成29年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引	830,471,990		843,511,142	13,039,152
	買建				
合計		830,471,990	-	843,511,142	13,039,152

(平成30年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引	1,601,502,112		1,504,603,584	96,898,528
	買建				

合計	1,601,502,112	-	1,504,603,584	96,898,528
----	---------------	---	---------------	------------

(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)

(平成29年10月26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	541,663,260	-	545,175,500	3,512,240
	米ドル	428,424,510	-	431,082,500	2,657,990
	ユーロ	113,238,750	-	114,093,000	854,250
	売建	284,675,000	-	283,900,000	775,000
	米ドル	284,675,000	-	283,900,000	775,000
合計		826,338,260	-	829,075,500	4,287,240

(平成30年10月26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	1,305,740,850	-	1,305,858,000	117,150
	米ドル	1,168,581,175	-	1,171,604,500	3,023,325
	ユーロ	137,159,675	-	134,253,500	2,906,175
合計		1,305,740,850	-	1,305,858,000	117,150

(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)

平成29年10月26日現在		平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.3670円	1口当たり純資産額	2.3897円
(1万口当たり純資産額)	(23,670円)	(1万口当たり純資産額)	(23,897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	ANADARKO PETROLEUM CORP	11,893	59.63	709,179.59	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,560	16.31	74,373.60	
	APACHE CORP	8,704	38.15	332,057.60	
	BAKER HUGHES A GE CO	9,345	27.55	257,454.75	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	21.40	208,222.00	
	CHENIERE ENERGY INC	4,830	60.03	289,944.90	
	CHEVRON CORP	43,131	111.58	4,812,556.98	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	82.83	166,074.15	

CONCHO RESOURCES INC	4,415	136.34	601,941.10
CONOCOPHILLIPS	26,560	68.02	1,806,611.20
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	54.15	106,134.00
DEVON ENERGY CORPORATION	11,251	32.85	369,595.35
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,210	114.24	252,470.40
EOG RESOURCES INC	13,152	107.12	1,408,842.24
EQT CORP	5,765	35.34	203,735.10
EXXON MOBIL CORP	95,671	78.31	7,491,996.01
HALLIBURTON CO	19,787	34.74	687,400.38
HELMERICH & PAYNE	2,660	62.77	166,968.20
HESS CORP	6,650	58.99	392,283.50
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	63.15	236,181.00
KINDER MORGAN INC	43,680	16.58	724,214.40
MARATHON OIL CORP	20,287	18.79	381,192.73
MARATHON PETROLEUM CORP	15,722	69.96	1,099,911.12
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,671	37.01	320,913.71
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	20.66	83,466.40
NOBLE ENERGY INC	10,672	26.61	283,981.92
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,421	68.65	1,195,951.65
ONEOK INC	9,560	64.61	617,671.60
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,120	24.82	151,898.40
PHILLIPS 66	10,105	98.49	995,241.45
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,750	153.61	576,037.50
SCHLUMBERGER LTD	31,181	53.30	1,661,947.30
TARGA RESOURCES CORP	5,430	52.45	284,803.50
TECHNIPFMC PLC	9,351	27.02	252,664.02
VALERO ENERGY CORP	9,832	87.38	859,120.16
WILLIAMS COS INC	27,104	25.02	678,142.08
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,055	151.48	765,731.40
ALBEMARLE CORP	2,320	95.41	221,351.20
AVERY DENNISON CORP	2,270	89.00	202,030.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,850	24.86	145,431.00
BALL CORP	8,230	43.32	356,523.60
CELANESE CORP	3,270	96.41	315,260.70
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,530	44.88	248,186.40

CHEMOURS CO/THE	3,600	33.28	119,808.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	41.77	117,582.55
DOWDUPONT INC	52,407	52.92	2,773,378.44
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	77.67	234,175.05
ECOLAB INC	5,710	150.10	857,071.00
FMC CORP	2,790	76.04	212,151.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	31,648	11.25	356,040.00
INTERNATIONAL PAPER CO	9,000	43.76	393,840.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	139.73	232,510.72
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,340	89.20	654,728.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,455	162.00	235,710.00
MOSAIC CO/THE	8,490	30.00	254,700.00
NEWMONT MINING CORP	11,050	29.60	327,080.00
NUCOR CORP	6,919	57.72	399,364.68
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,490	89.02	221,659.80
PPG INDUSTRIES INC	5,794	103.71	600,895.74
PRAXAIR INC	12,580	165.00	2,075,700.00
SEALED AIR CORP	3,966	31.02	123,025.32
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,857	368.00	683,376.00
STEEL DYNAMICS INC	5,580	39.56	220,744.80
VULCAN MATERIALS CO	3,063	90.91	278,457.33
WESTLAKE CHEMICAL CORP	790	70.76	55,900.40
WESTROCK CO	6,049	41.55	251,335.95
3M CO	13,446	184.99	2,487,375.54
ACUITY BRANDS INC	890	119.29	106,168.10
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	49.64	132,042.40
AGCO CORP	1,250	50.60	63,250.00
ALLEGION PLC	2,080	82.94	172,515.20
AMETEK INC	5,313	66.43	352,942.59
ARCONIC INC	8,783	19.95	175,220.85
BOEING CO/THE	12,502	363.77	4,547,852.54
CATERPILLAR INC	13,586	115.63	1,570,949.18
CUMMINS INC	3,505	128.37	449,936.85
DEERE & CO	6,860	136.78	938,310.80
DOVER CORP	3,810	81.72	311,353.20

EATON CORP PLC	9,686	72.20	699,329.20
EMERSON ELECTRIC CO	14,430	67.10	968,253.00
FASTENAL CO	6,473	49.31	319,183.63
FLOWSERVE CORP	3,265	45.55	148,720.75
FLUOR CORP	2,903	43.61	126,599.83
FORTIVE CORP	6,924	76.33	528,508.92
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	46.77	147,793.20
GENERAL DYNAMICS CORP	5,752	170.60	981,291.20
GENERAL ELECTRIC CO	197,013	11.80	2,324,753.40
HARRIS CORP	2,710	161.03	436,391.30
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	37.11	138,791.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,856	147.48	2,485,922.88
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	219.04	210,278.40
IDEX CORP	1,910	126.86	242,302.60
ILLINOIS TOOL WORKS	7,040	122.68	863,667.20
INGERSOLL-RAND PLC	5,576	95.52	532,619.52
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,060	75.23	230,203.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,170	56.86	293,966.20
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	32.00	144,000.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	20,244	32.10	649,832.40
L3 TECHNOLOGIES INC	1,891	204.38	386,482.58
LENNOX INTERNATIONAL INC	770	205.14	157,957.80
LOCKHEED MARTIN CORP	5,791	306.41	1,774,420.31
MASCO CORP	6,439	30.16	194,200.24
MIDDLEBY CORP	1,180	110.72	130,649.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,764	269.98	1,016,204.72
OWENS CORNING	2,950	45.37	133,841.50
PACCAR INC	7,894	55.22	435,906.68
PARKER HANNIFIN CORP	3,010	146.70	441,567.00
PENTAIR PLC	3,498	38.84	135,862.32
RAYTHEON COMPANY	6,492	176.52	1,145,967.84
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,973	157.49	468,217.77
ROCKWELL COLLINS INC.	3,873	129.28	500,701.44
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,260	265.34	599,668.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,410	42.02	185,308.20

SMITH (A.O.) CORP	3,020	45.18	136,443.60
SNAP-ON INC	1,430	149.96	214,442.80
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,760	81.67	225,409.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,466	114.86	398,104.76
TEXTRON INC	6,126	53.63	328,537.38
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	327.89	360,679.00
UNITED RENTALS INC	2,020	111.33	224,886.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,215	124.40	2,141,546.00
WABCO HOLDINGS INC	1,110	104.50	115,995.00
WABTEC CORP	1,880	91.07	171,211.60
WW GRAINGER INC	1,107	271.23	300,251.61
XYLEM INC	4,168	66.85	278,630.80
CINTAS CORP	2,117	173.69	367,701.73
COPART INC	4,880	48.41	236,240.80
COSTAR GROUP INC	865	358.36	309,981.40
EQUIFAX INC	2,764	98.31	271,728.84
IHS MARKIT LTD	9,063	50.89	461,216.07
MANPOWERGROUP INC	1,447	74.71	108,105.37
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	24.99	185,050.95
REPUBLIC SERVICES INC	5,560	68.36	380,081.60
ROBERT HALF INTL INC	3,075	59.72	183,639.00
ROLLINS INC	2,000	56.74	113,480.00
STERICYCLE INC	1,705	49.52	84,431.60
TRANSUNION	4,100	63.88	261,908.00
VERISK ANALYTICS INC	3,770	114.91	433,210.70
WASTE CONNECTIONS INC	6,026	72.51	436,945.26
WASTE MANAGEMENT INC	9,564	84.84	811,409.76
AMERCO	155	323.98	50,216.90
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,270	32.37	73,479.90
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,440	87.41	300,690.40
CSX CORP	18,913	66.39	1,255,634.07
DELTA AIR LINES INC	3,615	53.71	194,161.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,367	66.22	289,182.74
FEDEX CORP	5,778	213.78	1,235,220.84
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,820	107.40	195,468.00

KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	103.70	223,992.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	33.39	91,822.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,500	164.24	1,067,560.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,460	124.72	182,091.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,770	49.91	188,160.70
UNION PACIFIC CORP	17,566	144.15	2,532,138.90
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	85.60	146,804.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,657	107.82	1,688,137.74
XPO LOGISTICS INC	2,720	90.22	245,398.40
APTIV PLC	5,900	74.13	437,367.00
AUTOLIV INC	1,770	80.02	141,635.40
BORGWARNER INC	4,330	37.72	163,327.60
FORD MOTOR COMPANY	84,765	8.99	762,037.35
GENERAL MOTORS CORP	29,215	32.00	934,880.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	20.57	111,695.10
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	37.31	138,382.79
LEAR CORP	1,660	133.48	221,576.80
TESLA INC	2,900	314.86	913,094.00
DR HORTON INC	8,596	35.62	306,189.52
GARMIN LTD	2,395	62.15	148,849.25
HANESBRANDS INC	7,940	16.86	133,868.40
HASBRO INC	2,748	93.50	256,938.00
LEGGETT & PLATT INC	2,778	38.52	107,008.56
LENNAR CORP-CL A	6,960	40.19	279,722.40
LULULEMON ATHLETICA INC	2,300	137.22	315,606.00
MATTEL INC	7,349	13.84	101,710.16
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,490	56.90	198,581.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,628	151.07	245,941.96
NEWELL BRANDS INC	10,026	16.40	164,426.40
NIKE INC -CL B	29,138	73.10	2,129,987.80
NVR INC	70	2,164.26	151,498.20
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	86.47	107,222.80
PULTE GROUP INC	5,660	23.16	131,085.60
PVH CORP	1,600	120.70	193,120.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	127.04	148,001.60

TAPESTRY INC	6,756	41.52	280,509.12
TOLL BROTHERS INC	3,321	30.38	100,891.98
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	18.51	65,895.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	17.03	70,027.36
VF CORP	7,420	79.38	588,999.60
WHIRLPOOL CORP	1,414	111.34	157,434.76
ARAMARK	5,980	35.02	209,419.60
CARNIVAL CORP	9,397	55.85	524,822.45
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	555	423.88	235,253.40
DARDEN RESTAURANTS INC	2,943	106.43	313,223.49
DOMINO'S PIZZA INC	940	261.77	246,063.80
H&R BLOCK INC	4,510	25.90	116,809.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,340	67.55	428,267.00
LAS VEGAS SANDS CORP	8,690	54.26	471,519.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,683	111.54	745,421.82
MCDONALD'S CORP	17,821	175.31	3,124,199.51
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	5,100	17.37	88,587.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	11,570	25.30	292,721.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,910	45.43	223,061.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,008	107.94	432,623.52
STARBUCKS CORP	31,344	58.96	1,848,042.24
VAIL RESORTS INC	840	240.60	202,104.00
WYNN RESORTS LTD	2,030	103.22	209,536.60
YUM! BRANDS INC	7,324	86.92	636,602.08
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,978	54.68	436,237.04
CHARTER COMMUNICATION-A	3,801	314.81	1,196,592.81
COMCAST CORP-CLASS A	104,174	35.84	3,733,596.16
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	30.94	102,720.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,490	28.19	182,953.10
DISH NETWORK CORP-A	4,769	30.25	144,262.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,836	23.33	182,813.88
LIBERTY BROADBAND-C	2,700	80.89	218,403.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,975	23.99	95,360.25
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	23.46	289,050.66
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	4,700	32.77	154,019.00

LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,580	39.90	142,842.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	39.90	78,802.50
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,430	50.70	173,901.00
NEWS CORP - CLASS A	7,570	12.86	97,350.20
OMNICOM GROUP	5,247	71.89	377,206.83
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	5.79	198,307.50
THE WALT DISNEY CO.	33,703	114.16	3,847,534.48
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,619	44.79	475,625.01
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	23,352	45.26	1,056,911.52
VIACOM INC-CLASS B	7,248	29.68	215,120.64
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,748	163.17	285,221.16
AMAZON.COM INC	9,325	1,782.17	16,618,735.25
AUTOZONE INC	622	740.00	460,280.00
BEST BUY CO INC	5,564	69.17	384,861.88
BOOKING HOLDINGS INC	1,093	1,804.53	1,972,351.29
CARMAX INC	4,299	70.65	303,724.35
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,960	111.04	661,798.40
DOLLAR TREE INC	5,366	83.02	445,485.32
EBAY INC	22,297	28.06	625,653.82
EXPEDIA INC	2,912	117.57	342,363.84
GAP INC/THE	5,106	26.62	135,921.72
GENUINE PARTS CO	3,421	100.60	344,152.60
HOME DEPOT INC	26,090	179.07	4,671,936.30
KOHL'S CORP	3,792	73.93	280,342.56
L BRANDS INC	4,858	30.60	148,654.80
LKQ CORP	7,600	26.60	202,160.00
LOWE'S COS INC	18,642	97.95	1,825,983.90
MACY'S INC	6,469	33.09	214,059.21
MERCADOLIBRE INC	990	297.59	294,614.10
NETFLIX INC	9,830	312.87	3,075,512.10
NORDSTROM INC	2,540	61.50	156,210.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,885	324.55	611,776.75
QURATE RETAIL INC	10,830	22.18	240,209.40
ROSS STORES INC	8,362	96.40	806,096.80
TARGET CORP	11,190	83.83	938,057.70

TIFFANY & CO	2,610	107.29	280,026.90
TJX COMPANIES INC	14,203	106.50	1,512,619.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	89.07	244,942.50
TRIPADVISOR INC	2,330	48.75	113,587.50
ULTA BEAUTY INC	1,240	272.24	337,577.60
COSTCO WHOLESALE CORP	9,959	226.40	2,254,717.60
KROGER CO	19,240	28.00	538,720.00
SYSCO CORP	10,866	71.71	779,200.86
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,352	75.74	1,465,720.48
WALMART INC	33,462	99.18	3,318,761.16
ALTRIA GROUP INC	42,838	63.16	2,705,648.08
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,503	47.90	598,893.70
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,980	46.86	280,222.80
BUNGE LTD	2,857	66.12	188,904.84
CAMPBELL SOUP CO	3,485	37.95	132,255.75
COCA-COLA CO/THE	91,212	46.51	4,242,270.12
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,130	43.53	223,308.90
CONAGRA BRANDS INC	10,810	36.37	393,159.70
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,750	213.15	799,312.50
GENERAL MILLS INC	13,969	44.47	621,201.43
HERSHEY CO/THE	3,015	102.84	310,062.60
HORMEL FOODS CORP	6,920	41.71	288,633.20
INGREDION INC	1,840	99.64	183,337.60
JM SMUCKER CO/THE	2,720	106.53	289,761.60
KELLOGG CO	6,188	70.55	436,563.40
KRAFT HEINZ CO/THE	14,081	55.98	788,254.38
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,805	139.67	391,774.35
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,440	56.83	252,325.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	33,605	41.00	1,377,805.00
MONSTER BEVERAGE CORP	9,160	52.51	480,991.60
PEPSICO INC	32,051	112.85	3,616,955.35
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,248	90.63	3,194,526.24
TYSON FOODS INC-CL A	6,806	61.68	419,794.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,200	59.28	308,256.00
CLOROX COMPANY	3,006	151.59	455,679.54

COLGATE-PALMOLIVE CO	18,480	63.82	1,179,393.60
COTY INC-CL A	10,000	10.37	103,700.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,910	126.41	620,673.10
KIMBERLY-CLARK CORP	7,763	104.57	811,776.91
PROCTER & GAMBLE CO	56,949	89.00	5,068,461.00
ABBOTT LABORATORIES	39,766	67.67	2,690,965.22
ABIOMED INC	940	333.12	313,132.80
AETNA INC	7,439	196.07	1,458,564.73
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,680	232.07	389,877.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,714	85.72	318,364.08
ANTHEM INC	5,806	270.93	1,573,019.58
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,929	67.84	809,263.36
BECTON DICKINSON AND CO	6,077	231.45	1,406,521.65
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,898	36.39	1,160,768.22
CARDINAL HEALTH INC	7,495	50.64	379,546.80
CENTENE CORP	4,440	131.45	583,638.00
CERNER CORP	6,770	62.32	421,906.40
CIGNA CORP	5,600	210.37	1,178,072.00
COOPER COS INC/THE	1,040	250.55	260,572.00
CVS HEALTH CORP	23,097	70.67	1,632,264.99
DANAHER CORP	14,299	98.29	1,405,448.71
DAVITA INC	2,978	65.34	194,582.52
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	35.19	170,741.88
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,680	143.35	670,878.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	12,824	95.41	1,223,537.84
HCA HEALTHCARE INC	6,235	127.06	792,219.10
HENRY SCHEIN INC	3,340	81.35	271,709.00
HOLOGIC INC	5,708	38.98	222,497.84
HUMANA INC	3,175	321.58	1,021,016.50
IDEXX LABORATORIES INC	2,070	210.78	436,314.60
INTUITIVE SURGICAL INC	2,575	492.92	1,269,269.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,535	156.64	397,082.40
MCKESSON CORP	4,754	121.99	579,940.46
MEDTRONIC PLC	30,708	91.76	2,817,766.08
QUEST DIAGNOSTICS	2,876	91.89	264,275.64

RESMED INC	3,240	98.50	319,140.00
STRYKER CORP	7,683	165.27	1,269,769.41
TELEFLEX INC	1,090	239.92	261,512.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	21,740	264.24	5,744,577.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	121.55	220,005.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	113.55	218,470.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	2,860	87.35	249,821.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,502	122.15	549,919.30
ABBVIE INC	34,376	81.73	2,809,550.48
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,140	62.61	447,035.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,140	117.16	602,202.40
ALKERMES PLC	3,220	41.67	134,177.40
ALLERGAN PLC	7,705	180.29	1,389,134.45
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,800	77.92	140,256.00
AMGEN INC	15,011	188.10	2,823,569.10
BIOGEN INC	4,793	298.47	1,430,566.71
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,880	96.43	374,148.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	36,871	49.21	1,814,421.91
CELGENE CORP	16,584	72.72	1,205,988.48
ELI LILLY & CO	22,013	107.89	2,374,982.57
GILEAD SCIENCES INC	29,524	68.62	2,025,936.88
ILLUMINA INC	3,330	298.14	992,806.20
INCYTE CORP	3,700	64.29	237,873.00
IQVIA HOLDINGS INC	3,533	119.92	423,677.36
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,400	153.95	215,530.00
JOHNSON & JOHNSON	60,561	138.47	8,385,881.67
MERCK & CO. INC.	60,703	69.96	4,246,781.88
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	605	536.40	324,522.00
MYLAN NV	10,965	31.01	340,024.65
NEKTAR THERAPEUTICS	3,790	36.77	139,358.30
PERRIGO CO PLC	3,009	69.61	209,456.49
PFIZER INC	132,030	43.41	5,731,422.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,840	336.94	619,969.60
SEATTLE GENETICS INC	2,280	65.35	148,998.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	22,030	20.30	447,209.00

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,074	230.19	2,088,744.06
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	118.95	111,813.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,620	165.61	930,728.20
WATERS CORP	1,866	183.64	342,672.24
ZOETIS INC	11,010	90.47	996,074.70
BANK OF AMERICA CORP	217,479	26.59	5,782,766.61
BB&T CORP	17,748	47.01	834,333.48
CIT GROUP INC	2,655	44.87	119,129.85
CITIGROUP INC	57,527	64.97	3,737,529.19
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,590	35.89	380,075.10
COMERICA INC	3,950	79.71	314,854.50
EAST WEST BANCORP INC	3,000	51.76	155,280.00
FIFTH THIRD BANCORP	16,209	25.87	419,326.83
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,460	87.27	301,954.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,720	13.59	335,944.80
JPMORGAN CHASE & CO	76,900	104.86	8,063,734.00
KEYCORP	24,618	17.14	421,952.52
M & T BANK CORP	3,153	158.36	499,309.08
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	13,444	9.13	122,743.72
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	9,730	15.44	150,231.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,550	119.63	1,262,096.50
REGIONS FINANCIAL CORP	25,844	16.06	415,054.64
SIGNATURE BANK	1,370	107.98	147,932.60
SUNTRUST BANKS INC	10,557	60.37	637,326.09
SVB FINANCIAL GROUP	1,210	263.92	319,343.20
US BANCORP	35,121	51.27	1,800,653.67
WELLS FARGO & CO	104,500	51.86	5,419,370.00
ZIONS BANCORP NA	4,120	47.15	194,258.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,330	118.38	157,445.40
ALLY FINANCIAL INC	9,120	25.01	228,091.20
AMERICAN EXPRESS CO	16,454	103.60	1,704,634.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,330	126.19	420,212.70
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	22,752	46.15	1,050,004.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	28,780	201.98	5,812,984.40
BLACKROCK INC	2,660	391.96	1,042,613.60

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,045	88.27	974,942.15	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,540	106.70	271,018.00	
CME GROUP INC	7,650	177.47	1,357,645.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,020	73.22	587,224.40	
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,050	47.37	286,588.50	
EATON VANCE CORP	3,200	43.55	139,360.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	7,935	29.34	232,812.90	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,098	214.01	1,733,052.98	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	12,610	74.12	934,653.20	
INVESCO LTD	10,627	21.54	228,905.58	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	20.06	130,089.10	
MOODY'S CORP	3,797	155.07	588,800.79	
MORGAN STANLEY	30,065	44.55	1,339,395.75	
MSCI INC	2,000	149.34	298,680.00	
NASDAQ INC	2,825	83.59	236,141.75	
NORTHERN TRUST CORP	4,690	89.60	420,224.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,060	75.56	231,213.60	
S&P GLOBAL INC	5,592	177.17	990,734.64	
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,284	43.18	1,178,123.12	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,165	53.04	167,871.60	
STATE STREET CORP	8,107	68.05	551,681.35	
SYNCHRONY FINANCIAL	15,730	28.83	453,495.90	
T ROWE PRICE GROUP INC	5,375	95.52	513,420.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,280	50.27	315,695.60	
VOYA FINANCIAL INC	3,700	42.99	159,063.00	
AFLAC INC	17,324	42.19	730,899.56	
ALLEGHANY CORP	330	583.12	192,429.60	
ALLSTATE CORP	7,983	92.85	741,221.55	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,960	99.80	195,608.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,405	42.38	864,763.90	
AON PLC	5,607	149.98	840,937.86	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,345	26.57	274,866.65	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,500	72.97	328,365.00	
ASSURANT INC	1,110	96.23	106,815.30	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,700	45.99	170,163.00	

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,225	56.92	126,647.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,874	40.10	115,247.40
CHUBB LTD	10,575	123.68	1,307,916.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,920	71.75	281,260.00
EVEREST RE GROUP LTD	874	207.55	181,398.70
FNF GROUP	6,671	32.12	214,272.52
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,532	45.54	388,547.28
LINCOLN NATIONAL CORP	5,513	59.61	328,629.93
LOEWS CORP	5,785	45.75	264,663.75
MARKEL CORP	320	1,077.32	344,742.40
MARSH & MCLENNAN COS	11,593	81.72	947,379.96
METLIFE INC	19,555	40.77	797,257.35
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,120	49.43	351,941.60
PROGRESSIVE CORP	13,000	68.96	896,480.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,842	92.36	909,007.12
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,690	130.98	221,356.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	127.30	112,915.10
TORCHMARK CORP	2,866	83.07	238,078.62
TRAVELERS COS INC/THE	6,134	121.24	743,686.16
UNUM GROUP	4,788	34.88	167,005.44
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,878	138.11	397,480.58
WR BERKLEY CORP	2,063	74.11	152,888.93
CBRE GROUP INC - A	7,550	39.34	297,017.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	6.00	142,200.00
JONES LANG LASALLE INC	1,160	130.35	151,206.00
ACCENTURE PLC-CL A	14,568	156.92	2,286,010.56
ACTIVISION BLIZZARD INC	16,490	70.32	1,159,576.80
ADOBE INC	11,139	252.92	2,817,275.88
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	63.29	233,540.10
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,270	202.66	257,378.20
ALPHABET INC-CL A	6,760	1,103.59	7,460,268.40
ALPHABET INC-CL C	7,112	1,095.57	7,791,693.84
ANSYS INC	1,820	146.83	267,230.60
AUTODESK INC	4,880	130.01	634,448.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,026	140.49	1,408,552.74

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,730	116.62	318,372.60	
CA INC	7,150	43.90	313,885.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	6,730	46.53	313,146.90	
CDK GLOBAL INC	3,490	57.11	199,313.90	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,710	109.23	296,013.30	
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	102.05	329,417.40	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,488	71.48	964,122.24	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	90.85	392,472.00	
DXC TECHNOLOGY CO	6,523	75.94	495,356.62	
ELECTRONIC ARTS INC	7,064	98.64	696,792.96	
FACEBOOK INC-A	54,280	150.95	8,193,566.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,285	102.92	749,772.20	
FIRST DATA CORP- CLASS-A	12,110	22.14	268,115.40	
FISERV INC	9,166	78.89	723,105.74	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,050	195.00	399,750.00	
FORTINET INC	3,100	81.10	251,410.00	
GARTNER INC	2,050	144.34	295,897.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,620	114.14	413,186.80	
GODADDY INC-CLASS A	3,560	72.80	259,168.00	
IAC/INTERACTIVECORP	1,650	193.41	319,126.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,842	126.45	2,635,470.90	
INTUIT INC	5,426	207.66	1,126,763.16	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,950	150.43	293,338.50	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,680	61.22	225,289.60	
MASTERCARD INC	20,920	204.20	4,271,864.00	
MICROSOFT CORP	165,024	108.30	17,872,099.20	
ORACLE CORP	69,403	47.96	3,328,567.88	
PAYCHEX INC	7,382	64.92	479,239.44	
PAYPAL HOLDINGS INC	25,597	85.96	2,200,318.12	
RED HAT INC	3,890	120.52	468,822.80	
SABRE CORP	6,100	24.29	148,169.00	
SALESFORCE.COM INC	15,920	140.80	2,241,536.00	
SERVICENOW INC	4,060	172.63	700,877.80	
SPLUNK INC	3,190	93.64	298,711.60	
SQUARE INC - A	6,640	73.49	487,973.60	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,830	51.33	247,923.90
SYMANTEC CORP	13,055	18.99	247,914.45
SYNOPSYS INC	3,207	89.64	287,475.48
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,700	120.70	325,890.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,826	93.66	358,343.16
TWITTER INC	15,660	31.80	497,988.00
VERISIGN INC	2,670	135.84	362,692.80
VISA INC-CLASS A SHARES	40,362	140.52	5,671,668.24
VMWARE INC	1,555	141.61	220,203.55
WESTERN UNION CO	12,691	17.93	227,549.63
WORKDAY INC-CLASS A	3,300	125.84	415,272.00
WORLDPAY INC-CLASS A	6,570	92.90	610,353.00
ZILLOW GROUP INC - C	2,720	41.65	113,301.60
AMPHENOL CORP-CL A	6,750	86.05	580,837.50
APPLE INC	111,092	219.80	24,418,021.60
ARISTA NETWORKS INC	1,130	230.69	260,679.70
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	65.55	126,511.50
AVNET INC	2,610	38.62	100,798.20
CDW CORP/DE	3,500	81.02	283,570.00
CISCO SYSTEMS INC	106,140	45.47	4,826,185.80
COGNEX CORP	3,970	41.90	166,343.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,030	24.46	98,573.80
CORNING INC	18,388	31.45	578,302.60
F5 NETWORKS INC	1,335	171.47	228,912.45
FLEX LTD	10,936	10.91	119,311.76
FLIR SYSTEMS INC	3,355	55.37	185,766.35
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,585	15.15	539,112.75
HP INC	36,325	23.79	864,171.75
IPG PHOTONICS CORP	730	133.31	97,316.30
JUNIPER NETWORKS INC	7,933	28.63	227,121.79
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,180	59.38	248,208.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,855	121.62	468,845.10
NETAPP INC	5,836	76.24	444,936.64
PALO ALTO NETWORKS INC	2,050	190.62	390,771.00
SEAGATE TECHNOLOGY	5,684	42.61	242,195.24

TE CONNECTIVITY LTD	7,755	75.82	587,984.10
TRIMBLE INC	6,070	37.36	226,775.20
WESTERN DIGITAL CORP	6,718	54.01	362,839.18
XEROX CORP	4,938	27.74	136,980.12
AT&T INC	163,807	29.98	4,910,933.86
CENTURYLINK INC	21,296	21.07	448,706.72
SPRINT CORP	17,350	6.08	105,488.00
T-MOBILE US INC	7,702	66.32	510,796.64
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,107	56.43	5,254,028.01
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,050	30.80	155,540.00
AES CORP	13,728	14.71	201,938.88
ALLIANT ENERGY CORP	4,740	43.52	206,284.80
AMEREN CORPORATION	5,552	65.69	364,710.88
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,718	73.54	788,201.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,935	89.93	353,874.55
ATMOS ENERGY CORP	2,540	95.63	242,900.20
CENTERPOINT ENERGY INC	11,712	27.75	325,008.00
CMS ENERGY CORP	6,680	50.75	339,010.00
CONSOLIDATED EDISON INC	6,986	76.81	536,594.66
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,697	72.73	1,068,912.81
DTE ENERGY COMPANY	4,068	115.05	468,023.40
DUKE ENERGY CORP	15,746	83.64	1,316,995.44
EDISON INTERNATIONAL	7,179	69.46	498,653.34
ENERGY CORP	3,847	83.50	321,224.50
EVERGY INC	6,190	56.75	351,282.50
EVERSOURCE ENERGY	7,280	63.67	463,517.60
EXELON CORP	20,896	43.85	916,289.60
FIRSTENERGY CORP	10,755	37.89	407,506.95
NEXTERA ENERGY INC	10,585	173.20	1,833,322.00
NISOURCE INC	8,510	25.92	220,579.20
OGE ENERGY CORP	4,980	37.19	185,206.20
P G & E CORP	11,431	47.37	541,486.47
PINNACLE WEST CAPITAL	2,849	84.45	240,598.05
PPL CORP	15,728	30.53	480,175.84
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,128	55.85	621,498.80

	SCANA CORP	2,683	37.37	100,263.71	
	SEMPRA ENERGY	5,657	115.04	650,781.28	
	SOUTHERN CO	22,895	45.27	1,036,456.65	
	UGI CORP	4,060	54.31	220,498.60	
	VISTRA ENERGY CORP	7,920	22.26	176,299.20	
	WEC ENERGY GROUP INC	7,190	70.59	507,542.10	
	XCEL ENERGY INC	11,324	49.43	559,745.32	
	ADVANCED MICRO DEVICES	20,220	19.27	389,639.40	
	ANALOG DEVICES INC	8,650	79.08	684,042.00	
	APPLIED MATERIALS INC	22,653	32.64	739,393.92	
	BROADCOM INC	9,320	222.24	2,071,276.80	
	INTEL CORP	105,412	44.31	4,670,805.72	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,529	89.03	314,186.87	
	LAM RESEARCH CORP	3,837	142.56	547,002.72	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	13,764	16.84	231,785.76	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,790	48.13	326,802.70	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,664	62.51	354,056.64	
	MICRON TECHNOLOGY INC	26,457	36.78	973,088.46	
	NVIDIA CORP	13,045	207.84	2,711,272.80	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	7,857	73.75	579,453.75	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	8,730	15.34	133,918.20	
	QORVO INC	2,670	70.98	189,516.60	
	QUALCOMM INC	31,682	63.20	2,002,302.40	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,320	81.86	353,635.20	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	22,212	91.77	2,038,395.24	
	XILINX INC	5,705	79.40	452,977.00	
	米ドル小計	6,902,839		529,403,866.56	(59,542,052,871)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	7,925	12.53	99,300.25	
	CAMECO CORP	7,892	14.38	113,486.96	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	27,414	36.54	1,001,707.56	
	CENOVUS ENERGY INC	25,343	11.10	281,307.30	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	6.76	77,571.00	
	ENBRIDGE INC	38,797	40.79	1,582,529.63	
	ENCANA CORP	21,068	13.81	290,949.08	

HUSKY ENERGY INC	6,873	18.82	129,349.86
IMPERIAL OIL LTD	7,132	41.79	298,046.28
INTER PIPELINE LTD	9,840	21.67	213,232.80
KEYERA CORP	4,270	33.20	141,764.00
PEMBINA PIPELINE CORP	11,262	43.80	493,275.60
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	20.99	86,059.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	7,090	14.26	101,103.40
SUNCOR ENERGY INC	37,169	43.98	1,634,692.62
TOURMALINE OIL CORP	6,635	19.64	130,311.40
TRANSCANADA CORP	19,853	50.06	993,841.18
VERMILION ENERGY INC	3,840	35.48	136,243.20
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	46.36	217,660.20
BARRICK GOLD CORP	29,584	16.43	486,065.12
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	53.76	163,968.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	10.93	160,780.30
FRANCO-NEVADA CORP	3,805	80.58	306,606.90
GOLDCORP INC	17,917	11.09	198,699.53
KINROSS GOLD CORP	25,015	3.39	84,800.85
LUNDIN MINING CORP	12,280	4.94	60,663.20
METHANEX CORP	1,650	83.20	137,280.00
NUTRIEN LTD	14,058	67.07	942,870.06
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	24.83	296,842.65
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	2.11	49,414.09
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	67.89	99,119.40
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	21.23	199,455.85
BOMBARDIER INC 'B'	40,026	3.31	132,486.06
CAE INC	5,615	23.20	130,268.00
FINNING INTERNATIONAL INC	3,545	27.75	98,373.75
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,605	46.94	169,218.70
WSP GLOBAL INC	2,100	65.80	138,180.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,718	106.70	1,783,810.60
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,175	256.50	814,387.50
LINAMAR CORP	980	54.50	53,410.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,448	62.81	467,808.88
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	39.15	177,741.00

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	5,358	73.62	394,455.96
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	24.42	261,171.90
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,670	149.10	248,997.00
DOLLARAMA INC	6,540	39.67	259,441.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,770	61.49	600,757.30
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	23.66	70,980.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,269	64.96	277,314.24
METRO INC	6,210	41.51	257,777.10
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	91.25	107,857.50
SAPUTO INC	6,060	39.70	240,582.00
AURORA CANNABIS INC	13,500	9.55	128,925.00
BAUSCH HEALTH COS INC	6,734	30.29	203,972.86
BANK OF MONTREAL	14,201	99.72	1,416,123.72
BANK OF NOVA SCOTIA	26,839	70.14	1,882,487.46
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,905	113.25	1,121,741.25
NATIONAL BANK OF CANADA	7,950	60.06	477,477.00
ROYAL BANK OF CANADA	32,469	94.73	3,075,788.37
TORONTO-DOMINION BANK	41,420	72.44	3,000,464.80
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,373	53.24	978,178.52
CI FINANCIAL CORP	5,700	18.99	108,243.00
IGM FINANCIAL INC	1,945	32.10	62,434.50
ONEX CORPORATION	2,315	84.78	196,265.70
THOMSON REUTERS CORP	6,054	60.68	367,356.72
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	670	615.16	412,157.20
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	29.91	178,682.34
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,225	46.46	103,373.50
INTACT FINANCIAL CORP	3,535	100.87	356,575.45
MANULIFE FINANCIAL CORP	44,161	20.46	903,534.06
POWER CORP OF CANADA	7,800	26.94	210,132.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	28.24	161,391.60
SUN LIFE FINANCIAL INC	13,674	48.15	658,403.10
FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	19.58	65,005.60
BLACKBERRY LTD	10,328	11.96	123,522.88
CGI GROUP INC - CL A	5,940	77.89	462,666.60
CONSTELLATION SOFTWARE INC	485	860.00	417,100.00

	OPEN TEXT CORP	6,900	44.05	303,945.00	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	1,960	178.82	350,487.20	
	BCE INC	2,930	52.44	153,649.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,765	67.51	524,215.15	
	TELUS CORP	4,366	45.40	198,216.40	
	ALTAGAS LTD	7,050	21.08	148,614.00	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	37.90	72,768.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	30.76	79,668.40	
	EMERA INC	1,270	40.37	51,269.90	
	FORTIS INC	10,215	43.50	444,352.50	
	HYDRO ONE LTD	9,070	19.57	177,499.90	
加ドル小計		920,745		37,470,705.44	(3,220,607,132)
ユーロ	ENAGAS SA	4,790	23.21	111,175.90	
	ENI SPA	59,296	14.97	887,898.30	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	10,915	15.19	165,853.42	
	NESTE OYJ	2,740	66.48	182,155.20	
	OMV AG	3,940	45.79	180,412.60	
	REPSOL SA	31,209	15.05	469,695.45	
	SNAM SPA	59,280	3.64	215,779.20	
	TENARIS SA	11,695	12.97	151,684.15	
	TOTAL SA	54,227	51.41	2,787,810.07	
	VOPAK	1,270	39.72	50,444.40	
	AIR LIQUIDE SA	9,759	107.70	1,051,044.30	
	AKZO NOBEL	5,728	73.44	420,664.32	
	ARCELORMITTAL	15,022	22.05	331,310.21	
	ARKEMA	1,885	89.42	168,556.70	
	BASF SE	20,785	66.66	1,385,528.10	
	COVESTRO AG	4,320	54.00	233,280.00	
	CRH PLC	18,710	24.10	450,911.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	26.19	93,760.20	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	40.06	68,903.20	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,825	57.36	219,402.00	
	IMERYS SA	830	53.40	44,322.00	
	K+S AG	3,880	16.01	62,118.80	

KONINKLIJKE DSM NV	3,842	76.30	293,144.60
LANXESS AG	1,935	53.26	103,058.10
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	4,600	28.30	130,180.00
SOLVAY SA	1,581	99.38	157,119.78
STORA ENSO OYJ-R SHS	11,535	13.24	152,723.40
SYMRISE AG	2,640	71.78	189,499.20
THYSSENKRUPP AG	8,755	18.24	159,734.97
UMICORE	5,130	40.39	207,200.70
UPM-KYMMENE OYJ	11,868	27.69	328,624.92
VOESTALPINE AG	2,509	30.06	75,420.54
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,086	32.38	197,064.68
AIRBUS GROUP SE	13,188	97.94	1,291,632.72
ALSTOM	3,220	37.54	120,878.80
ANDRITZ AG	1,420	43.80	62,196.00
BOUYGUES SA	5,400	31.93	172,422.00
BRENTAG AG	3,925	45.71	179,411.75
CNH INDUSTRIAL NV	25,270	8.82	223,083.56
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,366	31.55	358,597.30
DASSAULT AVIATION SA	50	1,477.00	73,850.00
EIFFAGE	1,580	86.38	136,480.40
FERROVIAL SA	9,975	17.97	179,250.75
GEA GROUP AG	3,940	26.04	102,597.60
HOCHTIEF AG	440	131.60	57,904.00
KION GROUP AG	1,400	46.65	65,310.00
KONE OYJ-B	7,604	40.60	308,722.40
LEGRAND SA	6,618	57.10	377,887.80
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	9.97	81,104.88
MAN SE	824	91.30	75,231.20
METSO OYJ	2,420	26.75	64,735.00
MTU AERO ENGINES AG	1,110	186.10	206,571.00
OSRAM LICHT AG	2,002	34.40	68,868.80
PRYSMIAN SPA	6,315	16.70	105,460.50
REXEL SA	6,250	11.12	69,500.00
SAFRAN SA	7,610	110.95	844,329.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,358	62.06	766,937.48

SIEMENS AG-REG	17,336	101.26	1,755,443.36
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	9.95	41,599.36
THALES SA	2,485	118.40	294,224.00
VINCI SA	11,790	78.34	923,628.60
WARTSILA OYJ ABP	8,820	14.59	128,727.90
BUREAU VERITAS SA	5,650	19.18	108,395.25
EDENRED	5,696	30.95	176,291.20
RANDSTAD NV	3,115	42.61	132,730.15
SOCIETE BIC SA	565	82.50	46,612.50
TELEPERFORMANCE	1,430	152.70	218,361.00
WOLTERS KLUWER	6,297	52.14	328,325.58
ADP	650	185.00	120,250.00
AENA SA	1,590	140.55	223,474.50
ATLANTIA SPA	10,860	17.61	191,244.60
BOLLORE	20,400	3.69	75,439.20
DEUTCHE LUFTHANSA	4,950	18.81	93,134.25
DEUTSCHE POST AG-REG	23,043	28.48	656,264.64
FRAPORT AG	980	68.12	66,757.60
GETLINK	11,810	11.15	131,681.50
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	6.59	84,573.91
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,325	74.50	545,712.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	64.80	77,112.00
CONTINENTAL AG	2,495	138.50	345,557.50
DAIMLER AG	20,692	51.35	1,062,534.20
FAURECIA	1,630	41.96	68,394.80
FERRARI NV	2,894	101.20	292,872.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	24,427	14.13	345,300.07
MICHELIN (CGDE)-B	3,879	87.14	338,016.06
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,565	31.46	80,694.90
PEUGEOT SA	13,890	20.33	282,383.70
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	51.76	163,044.00
RENAULT SA	4,467	64.47	287,987.49
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	8.94	31,751.20
VALEO SA	5,760	29.87	172,051.20
VOLKSWAGEN AG	891	134.50	119,839.50

VOLKSWAGEN AG-PFD	4,163	137.00	570,331.00	
ADIDAS AG	4,311	207.30	893,670.30	
HERMES INTERNATIONAL	697	503.20	350,730.40	
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	60.36	74,242.80	
KERING	1,757	381.10	669,592.70	
LUXOTTICA GROUP SPA	4,376	55.50	242,868.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,324	265.45	1,678,705.80	
MONCLER SPA	3,650	30.60	111,690.00	
PUMA SE	219	444.00	97,236.00	
SEB SA	480	139.00	66,720.00	
ACCOR SA	3,926	40.13	157,550.38	
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,150	71.65	154,047.50	
SODEXO	1,880	87.52	164,537.60	
AXEL SPRINGER SE	995	55.30	55,023.50	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	22.09	83,831.55	
JC DECAUX SA	1,580	29.26	46,230.80	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	19.92	95,739.62	
PUBLICIS GROUPE	4,905	51.04	250,351.20	
RTL GROUP	860	56.15	48,289.00	
SES	7,520	19.89	149,572.80	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	45.72	56,692.80	
VIVENDI	22,740	21.47	488,227.80	
INDITEX	25,005	24.83	620,874.15	
ZALANDO SE	2,160	33.87	73,159.20	
CARREFOUR SA	12,213	16.86	205,911.18	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	38.02	51,098.88	
COLRUYT SA	1,375	51.10	70,262.50	
JERONIMO MARTINS	5,075	11.73	59,555.12	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,118	20.51	597,355.77	
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	12.68	52,495.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,321	64.85	1,123,266.85	
DANONE	13,924	63.34	881,946.16	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,820	6.70	99,368.10	
HEINEKEN HOLDING NV	2,725	75.80	206,555.00	
HEINEKEN NV	5,643	77.96	439,928.28	

KERRY GROUP PLC-A	3,660	91.70	335,622.00
PERNOD-RICARD SA	4,806	132.60	637,275.60
REMY COINTREAU	470	103.60	48,692.00
BEIERSDORF AG	2,615	94.50	247,117.50
HENKEL AG & CO KGAA	2,730	85.85	234,370.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,943	94.60	373,007.80
L'OREAL	5,756	192.50	1,108,030.00
UNILEVER NV-CVA	35,045	48.45	1,698,105.47
BIOMERIEUX	1,070	64.50	69,015.00
ESSILORLUXOTTICA	4,585	120.75	553,638.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,103	68.92	351,698.76
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,475	58.90	558,077.50
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,751	31.92	694,291.92
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	730	119.00	86,870.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,400	35.11	119,391.00
BAYER AG-REG	21,144	66.23	1,400,367.12
EUROFINS SCIENTIFIC	280	424.60	118,888.00
GRIFOLS SA	6,260	22.31	139,660.60
IPSEN	780	122.90	95,862.00
MERCK KGAA	3,090	88.26	272,723.40
ORION OYJ-CLASS B	1,830	29.18	53,399.40
QIAGEN N.V.	5,344	29.85	159,518.40
RECORDATI SPA	2,530	29.79	75,368.70
SANOFI	25,436	75.65	1,924,233.40
UCB SA	3,028	70.90	214,685.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,570	21.29	182,455.30
AIB GROUP PLC	15,300	4.18	63,954.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	149,393	5.10	762,800.65
BANCO DE SABADELL SA	133,052	1.03	137,442.71
BANCO SANTANDER SA	366,509	4.07	1,491,691.63
BANK OF IRELAND GROUP PLC	24,219	6.26	151,732.03
BANKIA SA	33,700	2.79	94,258.90
BANKINTER SA	13,960	7.09	98,976.40
BNP PARIBAS	25,552	47.15	1,204,904.56
CAIXABANK S.A	81,100	3.45	280,443.80

COMMERZBANK AG	21,334	8.12	173,402.75
CREDIT AGRICOLE SA	27,112	11.36	308,046.54
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	34.87	224,493.06
ING GROEP NV-CVA	88,175	10.36	913,493.00
INTESA SANPAOLO	335,563	1.95	655,421.65
KBC GROEP NV	5,709	60.48	345,280.32
MEDIOBANCA SPA	12,760	7.78	99,272.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	24.15	66,895.50
SOCIETE GENERALE	17,839	32.88	586,635.51
UNICREDIT SPA	46,626	11.14	519,413.64
AMUNDI SA	1,140	54.70	62,358.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	45,725	8.82	403,294.50
DEUTSCHE BOERSE AG	4,260	109.40	466,044.00
EURAZEO SE	1,055	62.45	65,884.75
EXOR NV	2,264	49.53	112,135.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,632	79.84	130,298.88
NATIXIS	19,150	5.08	97,358.60
WENDEL	600	110.90	66,540.00
AEGON NV	38,139	5.28	201,373.92
AGEAS	4,044	43.75	176,925.00
ALLIANZ SE-REG	9,948	183.14	1,821,876.72
ASSICURAZIONI GENERALI	25,628	14.04	359,945.26
AXA	44,632	22.07	985,251.40
CNP ASSURANCES	3,530	19.13	67,528.90
HANNOVER RUECK SE-REG	1,275	116.50	148,537.50
MAPFRE SA	20,814	2.53	52,659.42
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,366	186.45	627,590.70
NN GROUP NV	6,340	37.31	236,545.40
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.12	62,873.28
SAMPO OYJ-A SHS	10,069	40.08	403,565.52
SCOR SE	3,562	40.74	145,115.88
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	40.48	303,600.00
VONOVIA SE	11,328	40.38	457,424.64
AMADEUS IT GROUP SA	10,210	72.28	737,978.80
ATOS SE	2,250	68.16	153,360.00

CAP GEMINI SA	3,679	103.45	380,592.55
DASSAULT SYSTEMES SA	2,930	113.30	331,969.00
DELIVERY HERO SE	1,880	34.20	64,296.00
SAP SE	22,242	93.68	2,083,630.56
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,920	84.22	161,702.40
WIRECARD AG	2,610	165.20	431,172.00
INGENICO GROUP	1,160	66.90	77,604.00
NOKIA OYJ	132,796	4.70	624,141.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,196	14.43	1,085,454.26
DRILLISCH AG	980	39.04	38,259.20
ELISA OYJ	3,045	34.70	105,661.50
ILIAD SA	520	97.10	50,492.00
KONINKLIJKE KPN NV	82,606	2.35	194,867.55
ORANGE S.A.	44,474	13.85	615,964.90
PROXIMUS	3,040	23.23	70,619.20
TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.48	114,246.14
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.42	52,910.30
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,270	3.67	59,775.98
TELEFONICA SA	108,829	6.93	754,293.79
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,400	36.01	86,424.00
E.ON SE	49,369	8.52	420,969.46
EDF	11,785	14.66	172,768.10
ENDESA SA	6,840	18.45	126,198.00
ENEL SPA	182,177	4.43	808,319.34
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	3.07	168,932.35
ENGIE	39,514	11.64	460,140.53
FORTUM OYJ	11,015	18.50	203,777.50
IBERDROLA SA	132,772	6.36	845,226.55
INNOGY SE	2,850	38.57	109,924.50
NATURGY ENERGY GROUP SA	7,722	22.00	169,884.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,120	18.60	206,832.00
RWE AG	10,685	17.71	189,231.35
SUEZ	7,629	12.46	95,057.34
TERNA SPA	35,697	4.58	163,742.13
UNIPER SE	3,800	26.03	98,914.00

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	12,624	17.15	216,501.60	
	ASML HOLDING NV	9,252	147.52	1,364,855.04	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	25,245	16.45	415,280.25	
	STMICROELECTRONICS NV	15,063	12.10	182,262.30	
ユーロ小計		4,379,122		80,797,397.44	(10,328,331,314)
英債券	BP PLC	450,458	5.35	2,412,202.59	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	104,118	24.16	2,515,490.88	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	84,249	24.69	2,080,529.05	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	17,360	7.11	123,533.76	
	ANGLO AMERICAN PLC	24,834	16.21	402,708.14	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	7.45	65,108.34	
	BHP BILLITON PLC	49,421	15.19	750,704.99	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	47.33	130,204.83	
	FRESNILLO PLC	4,710	9.13	43,011.72	
	GLENCORE PLC	261,813	3.02	792,900.67	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	28.92	121,435.08	
	MONDI PLC	9,350	18.01	168,393.50	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	2,520	61.98	156,189.60	
	RIO TINTO PLC	27,255	36.55	996,306.52	
	ASHTREAD GROUP PLC	11,210	18.43	206,600.30	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	71,205	5.44	387,924.84	
	BUNZL PLC	7,276	22.75	165,529.00	
	DCC PLC	2,530	65.30	165,209.00	
	FERGUSON PLC	5,432	51.84	281,594.88	
	MEGGITT PLC	16,205	5.21	84,460.46	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	110,300	1.57	174,108.55	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	36,015	8.72	314,050.80	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT-C(N)	1,656,690	0.00	1,656.69	
	SMITHS GROUP PLC	8,233	13.32	109,704.72	
	TRAVIS PERKINS PLC	5,250	10.72	56,280.00	
	WEIR GROUP PLC/THE	5,990	14.09	84,399.10	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	5.98	37,537.05	
	EXPERIAN PLC	20,468	17.60	360,236.80	
	G4S PLC	34,639	2.14	74,439.21	

INTERTEK GROUP PLC	3,365	44.73	150,516.45
RELX PLC	43,975	15.52	682,492.00
EASYJET PLC	3,840	11.69	44,908.80
ROYAL MAIL PLC	19,950	3.63	72,538.20
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,690	4.97	102,870.68
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	33.38	86,788.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	17.17	152,926.20
PERSIMMON PLC	7,470	22.07	164,862.90
TAYLOR WIMPEY PLC	92,590	1.53	141,986.76
CARNIVAL PLC	3,850	42.33	162,970.50
COMPASS GROUP PLC	35,088	15.43	541,583.28
GVC HOLDINGS PLC	11,000	8.74	96,140.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,719	40.23	189,845.37
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.12	48,578.20
TUI AG-DI	9,213	13.06	120,367.84
WHITBREAD PLC	3,820	43.75	167,125.00
INFORMA PLC	28,840	7.15	206,263.68
ITV PLC	77,235	1.45	112,145.22
PEARSON PLC	17,749	9.04	160,592.95
WPP PLC	28,054	9.10	255,515.83
KINGFISHER PLC	45,257	2.44	110,698.62
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	2.84	99,559.59
NEXT PLC	2,987	51.34	153,352.58
SAINSBURY (J) PLC	42,801	3.10	132,897.10
TESCO PLC	229,014	2.15	493,067.14
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.55	125,600.25
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,505	23.51	199,952.55
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	51,987	36.08	1,875,690.96
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,140	23.25	119,505.00
DIAGEO PLC	55,392	26.82	1,485,890.40
IMPERIAL BRANDS PLC	22,002	27.43	603,624.87
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,235	67.47	1,027,905.45
UNILEVER PLC	27,827	42.37	1,179,169.12
CONVATEC GROUP PLC	27,730	1.49	41,331.56
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	3.40	23,835.00

NMC HEALTH PLC	2,120	32.30	68,476.00	
SMITH & NEPHEW PLC	20,386	12.75	260,023.43	
ASTRAZENECA PLC	28,503	58.12	1,656,594.36	
GLAXOSMITHKLINE PLC	111,701	15.32	1,711,482.72	
SHIRE PLC	20,865	44.28	924,006.52	
BARCLAYS PLC	374,501	1.72	644,366.42	
HSBC HOLDINGS PLC	450,341	6.09	2,744,378.05	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,624,396	0.57	937,601.37	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	100,970	2.34	236,774.65	
STANDARD CHARTERED PLC	61,220	5.25	321,588.66	
3I GROUP PLC	20,499	8.49	174,200.50	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	18.08	103,417.60	
INVESTEC PLC	13,185	4.76	62,852.89	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	43.11	283,534.47	
SCHRODERS PLC	2,621	26.61	69,744.81	
ST JAMES'S PLACE PLC	12,080	9.83	118,818.88	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	54,215	2.61	141,907.76	
ADMIRAL GROUP PLC	4,245	19.45	82,565.25	
AVIVA PLC	91,805	4.18	383,836.70	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.24	95,068.25	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	136,201	2.44	333,420.04	
PRUDENTIAL PLC	58,802	15.06	885,852.13	
RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	5.46	117,551.06	
AUTO TRADER GROUP PLC	20,690	3.94	81,684.12	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	12.45	108,358.50	
SAGE GROUP PLC/THE	26,940	5.32	143,374.68	
BT GROUP PLC	184,862	2.40	444,685.54	
VODAFONE GROUP PLC	604,108	1.46	885,622.32	
CENTRICA PLC	126,905	1.49	189,405.71	
NATIONAL GRID PLC	75,888	8.40	637,914.52	
SEVERN TRENT PLC	6,043	18.56	112,158.08	
SSE PLC	23,977	11.41	273,697.45	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,085	7.17	122,567.79	
英債券小計	8,460,072		39,953,080.35 (5,761,633,717)	

スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,430	21.19	93,871.70	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	525.00	89,250.00	
	GIVAUDAN-REG	213	2,340.00	498,420.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,939	41.90	458,344.10	
	SIKA AG-REG	3,010	123.10	370,531.00	
	ABB LTD-REG	40,645	20.08	816,151.60	
	GEBERIT AG-REG	880	420.20	369,776.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	450	195.60	88,020.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	840	200.20	168,168.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,327	46.98	156,302.46	
	SGS SA-REG	113	2,261.00	255,493.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	136.40	156,860.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12,349	70.36	868,875.64	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	323.80	220,184.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,400	63.55	88,970.00	
	DUFREY AG-REG	690	105.20	72,588.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,939.00	87,255.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	6,685.00	153,755.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	77,300.00	231,900.00	
	NESTLE SA-REG	70,413	84.04	5,917,508.52	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,350	155.40	209,790.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	230	620.00	142,600.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,698	300.80	510,758.40	
	NOVARTIS AG-REG	49,113	85.34	4,191,303.42	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,898	234.15	3,722,516.70	
	VIFOR PHARMA AG	1,070	136.85	146,429.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	57,308	12.56	719,788.48	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,550	43.42	240,981.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	775	69.10	53,552.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	681.00	251,970.00	
	UBS GROUP AG-REG	87,702	13.39	1,174,329.78	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	140.80	152,064.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	830	361.80	300,294.00	
	SWISS RE AG	7,199	87.70	631,352.30	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,531	301.40	1,064,243.40	

	SWISS PRIME SITE-REG	1,551	79.20	122,839.20	
	TEMENOS AG	1,530	129.70	198,441.00	
	SWISSCOM AG-REG	644	445.30	286,773.20	
スイスフラン小計		389,199		25,282,250.90 (2,841,725,001)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	269.60	1,164,672.00	
	BOLIDEN AB	5,920	199.64	1,181,868.80	
	ALFA LAVAL AB	6,030	227.70	1,373,031.00	
	ASSA ABLOY AB-B	23,020	175.60	4,042,312.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,245	214.50	3,270,052.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	197.68	1,798,888.00	
	EPIROC AB-A	13,705	82.61	1,132,170.05	
	EPIROC AB-B	9,100	75.59	687,869.00	
	SANDVIK AB	25,790	138.35	3,568,046.50	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	137.15	983,365.50	
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	138.30	1,082,750.70	
	VOLVO AB-B SHS-B	35,270	133.90	4,722,653.00	
	SECURITAS AB-B SHS	8,769	144.60	1,267,997.40	
	ELECTROLUX AB - B	4,825	180.10	868,982.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	64.72	548,825.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	159.60	2,998,564.80	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	304.80	441,960.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	442.40	1,787,296.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,885	217.20	3,233,022.00	
	NORDEA BANK ABP	65,938	79.41	5,236,136.58	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	34,730	93.54	3,248,644.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,130	101.00	3,548,130.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,630	205.00	4,229,150.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,370	183.00	616,710.00	
	INVESTOR AB-B SHS	10,095	383.10	3,867,394.50	
	KINNEVIK AB - B	4,885	246.50	1,204,152.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	1,400	265.20	371,280.00		
ERICSSON LM-B SHS	67,775	79.50	5,388,112.50		
HEXAGON AB-B SHS	5,850	441.90	2,585,115.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	502.00	687,740.00		

	TELE2 AB-B SHS	7,555	104.80	791,764.00	
	TELIA CO AB	57,340	40.64	2,330,297.60	
スウェーデンクローナ小計		539,804		70,258,954.23	(866,995,495)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	2,200	289.60	637,120.00	
	EQUINOR ASA	26,264	214.00	5,620,496.00	
	NORSK HYDRO A S	36,870	41.09	1,514,988.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	353.30	1,335,474.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,070	264.00	546,480.00	
	MARINE HARVEST	8,740	199.50	1,743,630.00	
	ORKLA ASA	17,310	71.02	1,229,356.20	
	DNB ASA	21,025	153.55	3,228,388.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	126.80	532,560.00	
	TELENOR ASA	16,365	154.05	2,521,028.25	
ノルウェークローネ小計		138,824		18,909,521.50	(254,711,254)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,400	665.20	1,596,480.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,845	301.30	1,459,798.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	411.80	1,828,392.00	
	ISS A/S	4,720	210.60	994,032.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	7,460.00	596,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	7,994.00	1,103,172.00	
	DSV A/S	4,610	507.80	2,340,958.00	
	PANDORA A/S	2,190	422.00	924,180.00	
	CARLSBERG AS-B	2,720	717.20	1,950,784.00	
	COLOPLAST-B	2,545	619.20	1,575,864.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,610	200.00	522,000.00	
	GENMAB A/S	1,380	792.40	1,093,512.00	
	H LUNDBECK A/S	1,460	300.00	438,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,275	274.65	11,336,178.75	
	DANSKE BANK A/S	16,415	126.35	2,074,035.25	
	TRYG A/S	2,575	155.30	399,897.50	
ORSTED A/S	4,460	415.50	1,853,130.00		
デンマーククローネ小計		98,863		32,087,214.00	(549,653,975)

豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	27.61	147,299.35
	OIL SEARCH LTD	28,830	7.87	226,892.10
	ORIGIN ENERGY LTD	43,120	7.09	305,720.80
	SANTOS LTD	39,755	6.65	264,370.75
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	21,413	33.60	719,476.80
	ALUMINA LTD	46,512	2.45	113,954.40
	AMCOR LIMITED	27,430	12.71	348,635.30
	BHP BILLITON LTD	72,966	30.80	2,247,352.80
	BLUESCOPE STEEL LTD	11,500	13.84	159,160.00
	BORAL LTD	25,275	5.64	142,551.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	3.64	107,980.60
	INCITEC PIVOT LTD	44,370	3.76	166,831.20
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,885	18.90	205,726.50
	NEWCREST MINING LTD	18,889	21.44	404,980.16
	ORICA LIMITED	7,605	16.44	125,026.20
	RIO TINTO LTD	9,988	73.52	734,317.76
	SOUTH32 LTD	122,197	3.52	430,133.44
	CIMIC GROUP LTD	1,867	45.93	85,751.31
	BRAMBLES LTD	38,398	10.55	405,098.90
	SEEK LTD	6,920	18.02	124,698.40
	AURIZON HOLDINGS LTD	41,770	4.05	169,168.50
	SYDNEY AIRPORT	24,156	6.34	153,149.04
	TRANSURBAN GROUP	60,149	11.12	668,856.88
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,980	26.75	347,215.00
	CROWN RESORTS LTD	6,745	12.32	83,098.40
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	52.98	62,516.40
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	46.76	45,357.20
	TABCORP HOLDINGS LTD	39,384	4.58	180,378.72
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	11,392	3.16	35,998.72
	WESFARMERS LTD	25,205	45.62	1,149,852.10
	WOOLWORTHS GROUP LTD	29,922	27.55	824,351.10
	COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.67	102,985.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	14.97	238,711.62	
COCHLEAR LTD	1,277	173.24	221,227.48	
HEALTHSCOPE LTD	33,080	2.15	71,122.00	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	54.77	160,749.95
	SONIC HEALTHCARE LTD	10,050	22.76	228,738.00
	CSL LTD	10,292	174.69	1,797,909.48
	AUST AND NZ BANKING GROUP	64,999	24.80	1,611,975.20
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	9.43	76,571.60
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	9.85	103,208.30
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	39,697	65.27	2,591,023.19
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	61,193	24.53	1,501,064.29
	WESTPAC BANKING CORP	77,111	25.84	1,992,548.24
	AMP LTD	59,627	2.50	149,067.50
	ASX LTD	4,035	57.37	231,487.95
	CHALLENGER LTD	12,110	10.77	130,424.70
	MACQUARIE GROUP LTD	7,084	110.13	780,160.92
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	57,588	6.78	390,446.64
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.69	166,780.00
	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,260	11.17	326,834.20
	SUNCORP GROUP LTD	32,570	13.61	443,277.70
	COMPUTERSHARE LTD	9,430	19.35	182,470.50
	REA GROUP LTD	1,150	70.00	80,500.00
	TELSTRA CORPORATION LTD	88,954	3.05	271,309.70
	TPG TELECOM LTD	7,840	7.59	59,505.60
	AGL ENERGY LTD	14,751	17.85	263,305.35
	AUSNET SERVICES	40,750	1.65	67,441.25
豪ドル小計		1,639,750		25,426,746.69 (2,022,697,699)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	18,583	5.71	106,108.93
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	6.81	146,108.55
	A2 MILK CO LTD	15,000	9.91	148,650.00
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,700	13.28	142,096.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	11.77	100,045.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.83	134,827.09
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	3.07	85,960.00
ニュージーランドドル小計		137,395		863,795.57 (63,307,577)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	60,208	79.20	4,768,473.60

NWS HOLDINGS LTD	28,500	15.30	436,050.00	
MTR CORP	34,000	38.40	1,305,600.00	
MINTH GROUP LTD	14,000	26.35	368,900.00	
LI & FUNG LTD	138,000	1.52	209,760.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	41.15	1,193,350.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	20.95	303,775.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	54,000	42.45	2,292,300.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	11.72	196,896.00	
SANDS CHINA LTD	61,400	31.55	1,937,170.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	10.70	299,600.00	
SJM HOLDINGS LTD	48,000	6.41	307,680.00	
WYNN MACAU LTD	35,800	16.46	589,268.00	
WH GROUP LTD	182,000	5.81	1,057,420.00	
BANK OF EAST ASIA	26,040	25.25	657,510.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	80,000	32.20	2,576,000.00	
HANG SENG BANK LTD	17,400	194.70	3,387,780.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,400	210.60	5,770,440.00	
AIA GROUP LTD	273,990	59.35	16,261,306.50	
CK ASSET HOLDINGS LTD	60,208	52.75	3,175,972.00	
HANG LUNG GROUP LTD	17,000	19.24	327,080.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	14.06	646,760.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,638	36.70	1,014,314.60	
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	36.90	553,500.00	
KERRY PROPERTIES LTD	11,450	24.25	277,662.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	169,666	9.90	1,679,693.40	
SINO LAND CO	85,050	12.38	1,052,919.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	38,480	100.90	3,882,632.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	83.05	873,436.85	
SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	27.50	638,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	24,800	19.18	475,664.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	31,800	46.95	1,493,010.00	
WHEELLOCK & CO LTD	17,600	40.30	709,280.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	91,000	10.70	973,700.00	
PCCW LTD	80,000	4.34	347,200.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	16,000	57.55	920,800.00	

	CLP HOLDINGS LTD	36,500	86.80	3,168,200.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.50	420,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	204,668	14.96	3,061,833.28	
	POWER ASSETS HOLDINGS	32,000	52.55	1,681,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,200	69.95	433,690.00	
香港ドル小計		2,269,815		71,726,226.73 (1,029,271,353)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	39,560	6.21	245,667.60	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.79	58,590.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.43	113,190.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	50,900	1.18	60,062.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.27	104,420.00	
	SATS LTD	13,000	4.89	63,570.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	9.28	118,784.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	125,000	0.89	111,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.64	85,932.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	28.55	57,100.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.24	31,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.11	154,442.60	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	40,615	23.71	962,981.65	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	69,140	10.60	732,884.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	28,900	24.95	721,055.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,000	6.96	153,120.00	
	CAPITALAND LTD	72,500	3.05	221,125.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.00	80,000.00	
	UOL GROUP LTD	9,350	6.10	57,035.00	
	VENTURE CORP LTD	5,600	15.75	88,200.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.15	542,367.00	
シンガポールドル小計		985,755		4,763,625.85 (387,854,416)	
イスラエルシ ュ ケル	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	201	511.10	102,731.10	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	13,070	20.97	274,077.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	437.60	218,800.00	
	BANK HAPUALIM BM	21,225	24.90	528,502.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	30,255	22.90	692,839.50	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	61.55	178,495.00	
	AZRIELI GROUP LTD	940	179.30	168,542.00	
	NICE LTD	1,385	390.90	541,396.50	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	4.01	195,843.06	
イスラエルシュケル小計		119,266		2,901,227.56	(88,197,317)
合 計		26,981,449		86,957,039,121	(86,957,039,121)

(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	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	3,327.00	73,060.92		
	出資金小計		3,327.00	73,060.92	(8,217,162)	
	投資証券		AGNC INVESTMENT CORP	10,210	184,392.60	
			ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	2,420	301,677.20	
			AMERICAN TOWER CORP	10,009	1,536,481.59	
			ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	27,640	276,400.00	
			AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,115	553,473.20	
			BOSTON PROPERTIES INC	3,487	407,839.52	
			BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,558	126,634.98	
			CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	182,301.80	
			CROWN CASTLE INTL CORP	9,400	1,009,090.00	
			DIGITAL REALTY TRUST INC	4,605	537,864.00	
			DUKE REALTY CORPORATION	8,845	251,109.55	
			EQUINIX INC	1,738	716,003.86	
			EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,170	539,710.20	
			ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	356,174.00	
			EXTRA SPACE STORAGE INC	3,020	266,575.40	
			FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,875	231,018.75	
			HCP INC	10,905	294,762.15	
			HOST HOTELS & RESORTS INC	16,889	315,993.19	

		INVITATION HOMES INC	6,200	136,338.00	
		IRON MOUNTAIN INC	6,925	226,447.50	
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	139,400.75	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	136,038.10	
		MACERICH CO/THE	2,460	126,567.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,670	267,080.10	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,050	192,618.00	
		PROLOGIS INC	13,932	917,979.48	
		PUBLIC STORAGE	3,479	701,818.67	
		REALTY INCOME CORP	6,660	401,198.40	
		REGENCY CENTERS CORP	3,175	203,803.25	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,660	415,305.80	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,054	1,275,504.28	
		SL GREEN REALTY CORP	2,040	189,536.40	
		UDR INC	5,820	232,043.40	
		VENTAS INC	8,015	456,053.50	
		VEREIT INC	19,554	145,677.30	
		VORNADO REALTY TRUST	4,021	273,709.47	
		WELLTOWER INC	8,360	554,100.80	
		WEYERHAEUSER CO	16,658	482,249.10	
		投資証券小計	267,867	15,560,971.29	(1,750,142,440)
		米ドル小計	271,194	15,634,032.21	(1,758,359,602)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	78,360.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	81,356.60	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	50,801.40	
		加ドル小計	9,070	210,518.00	(18,094,022)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	995	86,366.00	
		GECINA SA	970	127,167.00	
		ICADE	685	50,484.50	
		KLEPIERRE	4,732	138,505.64	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,130	502,239.80	
		ユーロ小計	10,512	904,762.94	(115,655,846)

英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	20,201	118,256.65	
		HAMMERSON PLC	15,295	66,212.05	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	127,828.02	
		SEGRO PLC	21,263	133,361.53	
英ポンド小計			71,973	445,658.25	(64,268,376)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,518	251,390.64	
		DEXUS	21,247	215,657.05	
		GOODMAN GROUP	37,672	388,775.04	
		GPT GROUP	37,975	195,571.25	
		LENDLEASE GROUP	12,197	209,910.37	
		MIRVAC GROUP	78,535	171,991.65	
		SCENTRE GROUP	122,321	475,828.69	
		STOCKLAND	50,500	187,355.00	
		VICINITY CENTRES	72,862	192,355.68	
豪ドル小計			459,827	2,288,835.37	(182,076,853)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	51,500	3,731,175.00	
香港ドル小計			51,500	3,731,175.00	(53,542,361)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	133,902.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	54,940	95,046.20	
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	104,377.00	
		SUNTEC REIT	54,600	98,280.00	
シンガポールドル小計			209,540	431,605.20	(35,141,295)
合計				2,227,138,355	(2,227,138,355)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入出資金 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	出資金 1銘柄		0.0%		0.0%
	株式 594銘柄	97.1%			66.6%
	投資証券 38銘柄			2.9%	2.0%
加ドル	株式 88銘柄	99.4%			3.6%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	98.9%			11.6%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 97銘柄	98.9%			6.5%
	投資証券 4銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
豪ドル	株式 58銘柄	91.7%			2.3%
	投資証券 9銘柄			8.3%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 41銘柄	95.1%			1.2%
	投資証券 1銘柄			4.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.7%			0.4%
	投資証券 4銘柄			8.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	65,349,308	51,897,794
金銭信託	-	41,634,297
コール・ローン	245,107,968	170,995,284
株式	5,134,697,018	6,327,724,845
投資証券	132,915,409	162,570,443
派生商品評価勘定	14,081,560	39,065,779
未収入金	99,243	9,232,010
未収配当金	4,201,655	5,787,810
差入委託証拠金	54,602,980	55,461,137
流動資産合計	5,651,055,141	6,864,369,399
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	102,846,959	58,701,960
未払金	-	10,068,734
未払解約金	10,976,206	2,580,812
未払利息	321	269
流動負債合計	113,823,486	71,351,775
負債合計	113,823,486	71,351,775
純資産の部		
元本等		
元本	3,576,957,718	4,317,838,768
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,960,273,937	2,475,178,856
元本等合計	5,537,231,655	6,793,017,624
純資産合計	5,537,231,655	6,793,017,624
負債純資産合計	5,651,055,141	6,864,369,399

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
1.	期首	平成28年10月27日	平成29年10月27日
	期首元本額	2,465,038,729円	3,576,957,718円
	期首からの追加設定元本額	1,516,778,331円	1,161,111,188円
	期首からの一部解約元本額	404,859,342円	420,230,138円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（DC専用）	2,118,055,934円	2,802,212,323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）	336,292,710円	437,588,598円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	8,685,422円	8,034,788円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	6,620,425円	6,520,047円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	10,063,188円	11,040,978円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	11,020,287円	9,640,630円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	33,398,182円	3,367,988円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	46,696,940円	2,839,097円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	41,380,368円	41,001,984円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	122,343,359円	115,922,313円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	177,953,489円	171,685,569円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	180,476,491円	172,791,072円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	483,970,923円	535,193,381円
	計	3,576,957,718円	4,317,838,768円
2.	受益権の総数	3,576,957,718口	4,317,838,768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 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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）

（平成29年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	633,268,328
投資証券	1,581,336
合計	634,849,664

（平成30年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,850,377
投資証券	1,550,976
合計	7,299,401

(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

（株式関連）

（平成29年10月26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	289,424,862	-	299,915,072	10,490,210
合計		289,424,862	-	299,915,072	10,490,210

（平成30年10月26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	334,619,385	-	319,728,260	14,891,125
合計		334,619,385	-	319,728,260	14,891,125

(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)

(平成29年10月26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	5,306,100,111	-	5,405,355,720	99,255,609
	米ドル	3,467,777,285	-	3,545,023,590	77,246,305
	加ドル	207,375,581	-	207,408,820	33,239
	ユーロ	713,511,913	-	728,575,650	15,063,737
	英ポンド	376,691,519	-	381,584,600	4,893,081
	スイスフラン	180,240,285	-	179,926,240	314,045
	スウェーデンクローナ	60,962,290	-	61,073,280	110,990
	ノルウェークローネ	15,475,227	-	15,497,210	21,983
	デンマーククローネ	36,885,548	-	37,627,000	741,452
	豪ドル	148,924,310	-	148,247,060	677,250
	ニュージーランドドル	802,930	-	777,800	25,130
	香港ドル	68,181,270	-	69,569,850	1,388,580

	シンガポールドル	24,269,981	-	24,739,520	469,539
	イスラエルシケル	5,001,972	-	5,305,100	303,128
	合計	5,306,100,111	-	5,405,355,720	99,255,609

(平成30年10月26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	6,525,498,274	-	6,530,243,330	4,745,056
	米ドル	4,435,028,415	-	4,464,638,200	29,609,785
	加ドル	240,820,469	-	241,121,700	301,231
	ユーロ	790,879,581	-	781,360,180	9,519,401
	英ポンド	433,835,312	-	426,204,020	7,631,292
	スイスフラン	215,230,861	-	211,274,060	3,956,801
	スウェーデンクローナ	63,799,572	-	62,785,920	1,013,652
	ノルウェークローネ	18,447,317	-	18,274,320	172,997
	デンマーククローネ	40,275,263	-	39,539,340	735,923
	豪ドル	171,391,847	-	168,984,000	2,407,847
	ニュージーランドドル	2,206,651	-	2,186,740	19,911
	香港ドル	77,832,421	-	78,099,700	267,279
	シンガポールドル	30,147,186	-	30,183,710	36,524
	イスラエルシケル	5,603,379	-	5,591,440	11,939
		合計	6,525,498,274	-	6,530,243,330

(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)

平成29年10月26日現在		平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5480円	1口当たり純資産額	1.5732円
(1万口当たり純資産額)	(15,480円)	(1万口当たり純資産額)	(15,732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	ANADARKO PETROLEUM CORP	931	59.63	55,515.53	
	APACHE CORP	673	38.15	25,674.95	
	BAKER HUGHES A GE CO	885	27.55	24,381.75	
	CABOT OIL & GAS CORP	773	21.40	16,542.20	
	CHENIERE ENERGY INC	350	60.03	21,010.50	
	CHEVRON CORP	3,097	111.58	345,563.26	
	CIMAREX ENERGY CO	248	82.83	20,541.84	
	CONCHO RESOURCES INC	369	136.34	50,309.46	
	CONOCOPHILLIPS	1,948	68.02	132,502.96	
	DEVON ENERGY CORPORATION	899	32.85	29,532.15	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	169	114.24	19,306.56	
	EOG RESOURCES INC	964	107.12	103,263.68	
	EQT CORP	433	35.34	15,302.22	
EXXON MOBIL CORP	6,894	78.31	539,869.14		

HALLIBURTON CO	1,347	34.74	46,794.78
HELMERICH & PAYNE	287	62.77	18,014.99
HESS CORP	622	58.99	36,691.78
HOLLYFRONTIER CORP	293	63.15	18,502.95
KINDER MORGAN INC	3,067	16.58	50,850.86
MARATHON OIL CORP	1,779	18.79	33,427.41
MARATHON PETROLEUM CORP	1,226	69.96	85,770.96
NATIONAL OILWELL VARCO INC	735	37.01	27,202.35
NEWFIELD EXPLORATION CO	378	20.66	7,809.48
NOBLE ENERGY INC	715	26.61	19,026.15
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,259	68.65	86,430.35
ONEOK INC	726	64.61	46,906.86
PHILLIPS 66	738	98.49	72,685.62
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	294	153.61	45,161.34
SCHLUMBERGER LTD	2,332	53.30	124,295.60
TARGA RESOURCES CORP	482	52.45	25,280.90
TECHNIPFMC PLC	715	27.02	19,319.30
VALERO ENERGY CORP	763	87.38	66,670.94
WILLIAMS COS INC	1,582	25.02	39,581.64
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	360	151.48	54,532.80
ALBEMARLE CORP	165	95.41	15,742.65
BALL CORP	775	43.32	33,573.00
CELANESE CORP	251	96.41	24,198.91
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	462	44.88	20,734.56
CROWN HOLDINGS INC	274	41.77	11,444.98
DOWDUPONT INC	3,731	52.92	197,444.52
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	295	77.67	22,912.65
ECOLAB INC	464	150.10	69,646.40
FMC CORP	252	76.04	19,162.08
FREEMPORT-MCMORAN INC	2,185	11.25	24,581.25
INTERNATIONAL PAPER CO	792	43.76	34,657.92
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	132	139.73	18,444.36
LYONDELLBASELL INDU-CL A	557	89.20	49,684.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	94	162.00	15,228.00
MOSAIC CO/THE	882	30.00	26,460.00

NEWMONT MINING CORP	775	29.60	22,940.00
NUCOR CORP	622	57.72	35,901.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	192	89.02	17,091.84
PPG INDUSTRIES INC	481	103.71	49,884.51
PRAXAIR INC	906	165.00	149,490.00
SEALED AIR CORP	300	31.02	9,306.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	157	368.00	57,776.00
STEEL DYNAMICS INC	412	39.56	16,298.72
VULCAN MATERIALS CO	255	90.91	23,182.05
WESTROCK CO	562	41.55	23,351.10
3M CO	975	184.99	180,365.25
ACUITY BRANDS INC	69	119.29	8,231.01
ALLEGION PLC	263	82.94	21,813.22
AMETEK INC	484	66.43	32,152.12
ARCONIC INC	740	19.95	14,763.00
BOEING CO/THE	921	363.77	335,032.17
CATERPILLAR INC	1,027	115.63	118,752.01
CUMMINS INC	246	128.37	31,579.02
DEERE & CO	552	136.78	75,502.56
DOVER CORP	354	81.72	28,928.88
EATON CORP PLC	742	72.20	53,572.40
EMERSON ELECTRIC CO	1,041	67.10	69,851.10
FASTENAL CO	457	49.31	22,534.67
FLUOR CORP	337	43.61	14,696.57
FORTIVE CORP	574	76.33	43,813.42
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	347	46.77	16,229.19
GENERAL DYNAMICS CORP	431	170.60	73,528.60
GENERAL ELECTRIC CO	14,194	11.80	167,489.20
HARRIS CORP	246	161.03	39,613.38
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,216	147.48	179,335.68
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	77	219.04	16,866.08
IDEX CORP	206	126.86	26,133.16
ILLINOIS TOOL WORKS	472	122.68	57,904.96
INGERSOLL-RAND PLC	504	95.52	48,142.08
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	400	56.86	22,744.00

JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	500	32.00	16,000.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,386	32.10	44,490.60
L3 TECHNOLOGIES INC	146	204.38	29,839.48
LOCKHEED MARTIN CORP	427	306.41	130,837.07
MASCO CORP	681	30.16	20,538.96
NORTHROP GRUMMAN CORP	253	269.98	68,304.94
PACCAR INC	570	55.22	31,475.40
PARKER HANNIFIN CORP	264	146.70	38,728.80
PENTAIR PLC	320	38.84	12,428.80
RAYTHEON COMPANY	494	176.52	87,200.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	238	157.49	37,482.62
ROCKWELL COLLINS INC.	294	129.28	38,008.32
ROPER TECHNOLOGIES INC	180	265.34	47,761.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	42.02	15,043.16
SMITH (A.O.) CORP	370	45.18	16,716.60
SNAP-ON INC	152	149.96	22,793.92
STANLEY BLACK & DECKER INC	239	114.86	27,451.54
TEXTRON INC	508	53.63	27,244.04
TRANSDIGM GROUP INC	94	327.89	30,821.66
UNITED RENTALS INC	130	111.33	14,472.90
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,246	124.40	155,002.40
WABTEC CORP	153	91.07	13,933.71
WW GRAINGER INC	71	271.23	19,257.33
XYLEM INC	392	66.85	26,205.20
CINTAS CORP	192	173.69	33,348.48
COSTAR GROUP INC	80	358.36	28,668.80
EQUIFAX INC	193	98.31	18,973.83
IHS MARKIT LTD	723	50.89	36,793.47
NIELSEN HOLDINGS PLC	538	24.99	13,444.62
REPUBLIC SERVICES INC	504	68.36	34,453.44
STERICYCLE INC	282	49.52	13,964.64
TRANSUNION	318	63.88	20,313.84
VERISK ANALYTICS INC	325	114.91	37,345.75
WASTE CONNECTIONS INC	466	72.51	33,789.66
WASTE MANAGEMENT INC	815	84.84	69,144.60

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	278	87.41	24,299.98
CSX CORP	1,343	66.39	89,161.77
DELTA AIR LINES INC	343	53.71	18,422.53
EXPEDITORS INTL WASH INC	427	66.22	28,275.94
FEDEX CORP	438	213.78	93,635.64
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	176	107.40	18,902.40
KANSAS CITY SOUTHERN	160	103.70	16,592.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	501	164.24	82,284.24
UNION PACIFIC CORP	1,281	144.15	184,656.15
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,143	107.82	123,238.26
XPO LOGISTICS INC	207	90.22	18,675.54
APTIV PLC	534	74.13	39,585.42
AUTOLIV INC	241	80.02	19,284.82
FORD MOTOR COMPANY	5,517	8.99	49,597.83
GENERAL MOTORS CORP	1,951	32.00	62,432.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	458	20.57	9,421.06
HARLEY-DAVIDSON INC	418	37.31	15,595.58
LEAR CORP	167	133.48	22,291.16
TESLA INC	199	314.86	62,657.14
DR HORTON INC	575	35.62	20,481.50
HANESBRANDS INC	468	16.86	7,890.48
HASBRO INC	280	93.50	26,180.00
LENNAR CORP-CL A	559	40.19	22,466.21
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	318	56.90	18,094.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	120	151.07	18,128.40
NEWELL BRANDS INC	599	16.40	9,823.60
NIKE INC -CL B	2,156	73.10	157,603.60
NVR INC	8	2,164.26	17,314.08
POLARIS INDUSTRIES INC	85	86.47	7,349.95
PVH CORP	187	120.70	22,570.90
TAPESTRY INC	470	41.52	19,514.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	406	17.03	6,914.18
VF CORP	630	79.38	50,009.40
WHIRLPOOL CORP	131	111.34	14,585.54
ARAMARK	646	35.02	22,622.92

CARNIVAL CORP	815	55.85	45,517.75
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	39	423.88	16,531.32
DARDEN RESTAURANTS INC	216	106.43	22,988.88
DOMINO'S PIZZA INC	93	261.77	24,344.61
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	592	67.55	39,989.60
LAS VEGAS SANDS CORP	718	54.26	38,958.68
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	487	111.54	54,319.98
MCDONALD'S CORP	1,287	175.31	225,623.97
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,153	25.30	29,170.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	348	107.94	37,563.12
STARBUCKS CORP	2,213	58.96	130,478.48
WYNN RESORTS LTD	211	103.22	21,779.42
YUM! BRANDS INC	570	86.92	49,544.40
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	556	54.68	30,402.08
CHARTER COMMUNICATION-A	279	314.81	87,831.99
COMCAST CORP-CLASS A	7,614	35.84	272,885.76
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	695	28.19	19,592.05
DISH NETWORK CORP-A	329	30.25	9,952.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	714	23.33	16,657.62
LIBERTY BROADBAND-C	214	80.89	17,310.46
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,186	23.46	27,823.56
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	602	39.90	24,019.80
NEWS CORP - CLASS A	1,188	12.86	15,277.68
OMNICOM GROUP	510	71.89	36,663.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,371	5.79	19,518.09
THE WALT DISNEY CO.	2,454	114.16	280,148.64
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	576	44.79	25,799.04
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,652	45.26	74,769.52
VIACOM INC-CLASS B	493	29.68	14,632.24
ADVANCE AUTO PARTS INC	116	163.17	18,927.72
AMAZON.COM INC	682	1,782.17	1,215,439.94
AUTOZONE INC	53	740.00	39,220.00
BEST BUY CO INC	371	69.17	25,662.07
BOOKING HOLDINGS INC	81	1,804.53	146,166.93
CARMAX INC	342	70.65	24,162.30

DOLLAR GENERAL CORP/OLD	495	111.04	54,964.80
DOLLAR TREE INC	446	83.02	37,026.92
EBAY INC	1,579	28.06	44,306.74
EXPEDIA INC	210	117.57	24,689.70
GAP INC/THE	486	26.62	12,937.32
GENUINE PARTS CO	327	100.60	32,896.20
HOME DEPOT INC	1,891	179.07	338,621.37
L BRANDS INC	428	30.60	13,096.80
LKQ CORP	715	26.60	19,019.00
LOWE'S COS INC	1,388	97.95	135,954.60
MACY'S INC	442	33.09	14,625.78
MERCADOLIBRE INC	75	297.59	22,319.25
NETFLIX INC	729	312.87	228,082.23
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	148	324.55	48,033.40
QURATE RETAIL INC	590	22.18	13,086.20
ROSS STORES INC	661	96.40	63,720.40
TARGET CORP	828	83.83	69,411.24
TIFFANY & CO	227	107.29	24,354.83
TJX COMPANIES INC	1,059	106.50	112,783.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	89.07	25,652.16
ULTA BEAUTY INC	85	272.24	23,140.40
COSTCO WHOLESALE CORP	732	226.40	165,724.80
KROGER CO	1,197	28.00	33,516.00
SYSCO CORP	935	71.71	67,048.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,404	75.74	106,338.96
WALMART INC	2,363	99.18	234,362.34
ALTRIA GROUP INC	3,051	63.16	192,701.16
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	869	47.90	41,625.10
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	579	46.86	27,131.94
BUNGE LTD	202	66.12	13,356.24
CAMPBELL SOUP CO	333	37.95	12,637.35
COCA-COLA CO/THE	6,523	46.51	303,384.73
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	578	43.53	25,160.34
CONAGRA BRANDS INC	900	36.37	32,733.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	303	213.15	64,584.45

GENERAL MILLS INC	887	44.47	39,444.89
HERSHEY CO/THE	249	102.84	25,607.16
HORMEL FOODS CORP	696	41.71	29,030.16
INGREDION INC	187	99.64	18,632.68
JM SMUCKER CO/THE	211	106.53	22,477.83
KELLOGG CO	427	70.55	30,124.85
KRAFT HEINZ CO/THE	968	55.98	54,188.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	265	139.67	37,012.55
MOLSON COORS BREWING CO -B	389	56.83	22,106.87
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,289	41.00	93,849.00
MONSTER BEVERAGE CORP	794	52.51	41,692.94
PEPSICO INC	2,280	112.85	257,298.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,510	90.63	227,481.30
TYSON FOODS INC-CL A	443	61.68	27,324.24
CHURCH & DWIGHT CO INC	550	59.28	32,604.00
CLOROX COMPANY	261	151.59	39,564.99
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,301	63.82	83,029.82
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	357	126.41	45,128.37
KIMBERLY-CLARK CORP	592	104.57	61,905.44
PROCTER & GAMBLE CO	4,065	89.00	361,785.00
ABBOTT LABORATORIES	2,911	67.67	196,987.37
ABIOMED INC	70	333.12	23,318.40
AETNA INC	551	196.07	108,034.57
ALIGN TECHNOLOGY INC	146	232.07	33,882.22
AMERISOURCEBERGEN CORP	353	85.72	30,259.16
ANTHEM INC	436	270.93	118,125.48
BAXTER INTERNATIONAL INC	963	67.84	65,329.92
BECTON DICKINSON AND CO	455	231.45	105,309.75
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,261	36.39	82,277.79
CARDINAL HEALTH INC	508	50.64	25,725.12
CENTENE CORP	388	131.45	51,002.60
CERNER CORP	552	62.32	34,400.64
CIGNA CORP	376	210.37	79,099.12
COOPER COS INC/THE	111	250.55	27,811.05
CVS HEALTH CORP	1,684	70.67	119,008.28

DANAHER CORP	1,067	98.29	104,875.43
DAVITA INC	260	65.34	16,988.40
DENTSPLY SIRONA INC	429	35.19	15,096.51
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	355	143.35	50,889.25
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	969	95.41	92,452.29
HCA HEALTHCARE INC	494	127.06	62,767.64
HENRY SCHEIN INC	264	81.35	21,476.40
HOLOGIC INC	677	38.98	26,389.46
HUMANA INC	217	321.58	69,782.86
IDEXX LABORATORIES INC	170	210.78	35,832.60
INTUITIVE SURGICAL INC	198	492.92	97,598.16
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	168	156.64	26,315.52
MCKESSON CORP	308	121.99	37,572.92
MEDTRONIC PLC	2,181	91.76	200,128.56
QUEST DIAGNOSTICS	309	91.89	28,394.01
RESMED INC	238	98.50	23,443.00
STRYKER CORP	528	165.27	87,262.56
TELEFLEX INC	102	239.92	24,471.84
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,570	264.24	414,856.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	121.55	22,365.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	234	113.55	26,570.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	354	122.15	43,241.10
ABBVIE INC	2,461	81.73	201,137.53
AGILENT TECHNOLOGIES INC	614	62.61	38,442.54
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	352	117.16	41,240.32
ALLERGAN PLC	578	180.29	104,207.62
AMGEN INC	1,121	188.10	210,860.10
BIOGEN INC	341	298.47	101,778.27
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	361	96.43	34,811.23
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,720	49.21	133,851.20
CELGENE CORP	1,152	72.72	83,773.44
ELI LILLY & CO	1,640	107.89	176,939.60
GILEAD SCIENCES INC	2,221	68.62	152,405.02
ILLUMINA INC	240	298.14	71,553.60
INCYTE CORP	328	64.29	21,087.12

IQVIA HOLDINGS INC	282	119.92	33,817.44
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	103	153.95	15,856.85
JOHNSON & JOHNSON	4,369	138.47	604,975.43
MERCK & CO. INC.	4,411	69.96	308,593.56
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	51	536.40	27,356.40
MYLAN NV	1,004	31.01	31,134.04
NEKTAR THERAPEUTICS	276	36.77	10,148.52
PERRIGO CO PLC	226	69.61	15,731.86
PFIZER INC	9,542	43.41	414,218.22
REGENERON PHARMACEUTICALS	137	336.94	46,160.78
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,778	20.30	36,093.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	689	230.19	158,600.91
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	455	165.61	75,352.55
WATERS CORP	172	183.64	31,586.08
ZOETIS INC	791	90.47	71,561.77
BANK OF AMERICA CORP	15,664	26.59	416,505.76
BB&T CORP	1,283	47.01	60,313.83
CIT GROUP INC	365	44.87	16,377.55
CITIGROUP INC	4,111	64.97	267,091.67
CITIZENS FINANCIAL GROUP	871	35.89	31,260.19
COMERICA INC	345	79.71	27,499.95
EAST WEST BANCORP INC	327	51.76	16,925.52
FIFTH THIRD BANCORP	1,124	25.87	29,077.88
FIRST REPUBLIC BANK/CA	358	87.27	31,242.66
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,332	13.59	31,691.88
JPMORGAN CHASE & CO	5,553	104.86	582,287.58
KEYCORP	1,756	17.14	30,097.84
M & T BANK CORP	231	158.36	36,581.16
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	747	119.63	89,363.61
REGIONS FINANCIAL CORP	1,940	16.06	31,156.40
SUNTRUST BANKS INC	841	60.37	50,771.17
SVB FINANCIAL GROUP	106	263.92	27,975.52
US BANCORP	2,579	51.27	132,225.33
WELLS FARGO & CO	7,517	51.86	389,831.62
ZIONS BANCORP NA	347	47.15	16,361.05

AFFILIATED MANAGERS GROUP	127	118.38	15,034.26
ALLY FINANCIAL INC	701	25.01	17,532.01
AMERICAN EXPRESS CO	1,145	103.60	118,622.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	259	126.19	32,683.21
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,733	46.15	79,977.95
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	2,076	201.98	419,310.48
BLACKROCK INC	189	391.96	74,080.44
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	801	88.27	70,704.27
CBOE GLOBAL MARKETS INC	196	106.70	20,913.20
CME GROUP INC	590	177.47	104,707.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	669	73.22	48,984.18
E*TRADE FINANCIAL CORP	481	47.37	22,784.97
FRANKLIN RESOURCES INC	492	29.34	14,435.28
GOLDMAN SACHS GROUP INC	597	214.01	127,763.97
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,038	74.12	76,936.56
INVESCO LTD	990	21.54	21,324.60
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	546	20.06	10,952.76
MOODY'S CORP	294	155.07	45,590.58
MORGAN STANLEY	2,272	44.55	101,217.60
MSCI INC	202	149.34	30,166.68
NORTHERN TRUST CORP	437	89.60	39,155.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	232	75.56	17,529.92
S&P GLOBAL INC	399	177.17	70,690.83
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,121	43.18	91,584.78
STATE STREET CORP	578	68.05	39,332.90
SYNCHRONY FINANCIAL	1,098	28.83	31,655.34
T ROWE PRICE GROUP INC	464	95.52	44,321.28
TD AMERITRADE HOLDING CORP	625	50.27	31,418.75
VOYA FINANCIAL INC	316	42.99	13,584.84
AFLAC INC	1,118	42.19	47,168.42
ALLEGHANY CORP	27	583.12	15,744.24
ALLSTATE CORP	575	92.85	53,388.75
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,362	42.38	57,721.56
AON PLC	389	149.98	58,342.22
ARCH CAPITAL GROUP LTD	837	26.57	22,239.09

ARTHUR J GALLAGHER & CO	425	72.97	31,012.25
CHUBB LTD	722	123.68	89,296.96
CINCINNATI FINANCIAL CORP	251	71.75	18,009.25
EVEREST RE GROUP LTD	83	207.55	17,226.65
FNF GROUP	449	32.12	14,421.88
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	709	45.54	32,287.86
LINCOLN NATIONAL CORP	407	59.61	24,261.27
LOEWS CORP	575	45.75	26,306.25
MARKEL CORP	27	1,077.32	29,087.64
MARSH & MCLENNAN COS	773	81.72	63,169.56
METLIFE INC	1,313	40.77	53,531.01
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	516	49.43	25,505.88
PROGRESSIVE CORP	1,043	68.96	71,925.28
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	628	92.36	58,002.08
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	184	130.98	24,100.32
TORCHMARK CORP	215	83.07	17,860.05
TRAVELERS COS INC/THE	430	121.24	52,133.20
UNUM GROUP	475	34.88	16,568.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	234	138.11	32,317.74
CBRE GROUP INC - A	605	39.34	23,800.70
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,000	6.00	12,000.00
ACCENTURE PLC-CL A	1,065	156.92	167,119.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,278	70.32	89,868.96
ADOBE INC	835	252.92	211,188.20
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	362	63.29	22,910.98
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	93	202.66	18,847.38
ALPHABET INC-CL A	497	1,103.59	548,484.23
ALPHABET INC-CL C	522	1,095.57	571,887.54
ANSYS INC	172	146.83	25,254.76
AUTODESK INC	429	130.01	55,774.29
AUTOMATIC DATA PROCESSING	693	140.49	97,359.57
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	279	116.62	32,536.98
CA INC	648	43.90	28,447.20
CADENCE DESIGN SYS INC	601	46.53	27,964.53
CHECK POINT SOFTWARE TECH	291	109.23	31,785.93

CITRIX SYSTEMS INC	258	102.05	26,328.90
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	934	71.48	66,762.32
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	334	90.85	30,343.90
DXC TECHNOLOGY CO	566	75.94	42,982.04
ELECTRONIC ARTS INC	572	98.64	56,422.08
FACEBOOK INC-A	3,984	150.95	601,384.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	593	102.92	61,031.56
FISERV INC	791	78.89	62,401.99
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	157	195.00	30,615.00
GARTNER INC	176	144.34	25,403.84
GLOBAL PAYMENTS INC	266	114.14	30,361.24
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,469	126.45	185,755.05
INTUIT INC	431	207.66	89,501.46
MASTERCARD INC	1,540	204.20	314,468.00
MICROSOFT CORP	12,015	108.30	1,301,224.50
ORACLE CORP	4,971	47.96	238,409.16
PAYCHEX INC	662	64.92	42,977.04
PAYPAL HOLDINGS INC	1,928	85.96	165,730.88
RED HAT INC	318	120.52	38,325.36
SALESFORCE.COM INC	1,203	140.80	169,382.40
SERVICENOW INC	318	172.63	54,896.34
SPLUNK INC	237	93.64	22,192.68
SQUARE INC - A	479	73.49	35,201.71
SYMANTEC CORP	1,077	18.99	20,452.23
SYNOPSIS INC	408	89.64	36,573.12
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	197	120.70	23,777.90
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	349	93.66	32,687.34
TWITTER INC	1,049	31.80	33,358.20
VERISIGN INC	195	135.84	26,488.80
VISA INC-CLASS A SHARES	2,936	140.52	412,566.72
WESTERN UNION CO	1,146	17.93	20,547.78
WORKDAY INC-CLASS A	243	125.84	30,579.12
WORLDPAY INC-CLASS A	486	92.90	45,149.40
AMPHENOL CORP-CL A	548	86.05	47,155.40
APPLE INC	8,095	219.80	1,779,281.00

ARISTA NETWORKS INC	89	230.69	20,531.41
CDW CORP/DE	335	81.02	27,141.70
CISCO SYSTEMS INC	7,852	45.47	357,030.44
CORNING INC	1,471	31.45	46,262.95
F5 NETWORKS INC	110	171.47	18,861.70
FLEX LTD	1,074	10.91	11,717.34
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	2,722	15.15	41,238.30
HP INC	3,088	23.79	73,463.52
JUNIPER NETWORKS INC	802	28.63	22,961.26
MOTOROLA SOLUTIONS INC	341	121.62	41,472.42
NETAPP INC	482	76.24	36,747.68
PALO ALTO NETWORKS INC	159	190.62	30,308.58
SEAGATE TECHNOLOGY	608	42.61	25,906.88
TE CONNECTIVITY LTD	625	75.82	47,387.50
TRIMBLE INC	488	37.36	18,231.68
WESTERN DIGITAL CORP	458	54.01	24,736.58
AT&T INC	11,767	29.98	352,774.66
CENTURYLINK INC	1,839	21.07	38,747.73
T-MOBILE US INC	627	66.32	41,582.64
VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,686	56.43	377,290.98
ALLIANT ENERGY CORP	391	43.52	17,016.32
AMEREN CORPORATION	394	65.69	25,881.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	791	73.54	58,170.14
AMERICAN WATER WORKS CO INC	373	89.93	33,543.89
ATMOS ENERGY CORP	198	95.63	18,934.74
CENTERPOINT ENERGY INC	830	27.75	23,032.50
CMS ENERGY CORP	476	50.75	24,157.00
CONSOLIDATED EDISON INC	497	76.81	38,174.57
DOMINION RESOURCES INC/VA	1,003	72.73	72,948.19
DTE ENERGY COMPANY	323	115.05	37,161.15
DUKE ENERGY CORP	1,078	83.64	90,163.92
EDISON INTERNATIONAL	445	69.46	30,909.70
ENTERGY CORP	273	83.50	22,795.50
EVERSOURCE ENERGY	487	63.67	31,007.29
EXELON CORP	1,514	43.85	66,388.90

	FIRSTENERGY CORP	847	37.89	32,092.83	
	NEXTERA ENERGY INC	740	173.20	128,168.00	
	P G & E CORP	909	47.37	43,059.33	
	PINNACLE WEST CAPITAL	319	84.45	26,939.55	
	PPL CORP	1,188	30.53	36,269.64	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	889	55.85	49,650.65	
	SCANA CORP	217	37.37	8,109.29	
	SEMPRA ENERGY	440	115.04	50,617.60	
	SOUTHERN CO	1,520	45.27	68,810.40	
	UGI CORP	317	54.31	17,216.27	
	WEC ENERGY GROUP INC	468	70.59	33,036.12	
	XCEL ENERGY INC	855	49.43	42,262.65	
	ADVANCED MICRO DEVICES	1,775	19.27	34,204.25	
	ANALOG DEVICES INC	708	79.08	55,988.64	
	APPLIED MATERIALS INC	1,706	32.64	55,683.84	
	BROADCOM INC	684	222.24	152,012.16	
	INTEL CORP	7,666	44.31	339,680.46	
	KLA-TENCOR CORPORATION	338	89.03	30,092.14	
	LAM RESEARCH CORP	259	142.56	36,923.04	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	575	48.13	27,674.75	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	405	62.51	25,316.55	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,023	36.78	74,405.94	
	NVIDIA CORP	968	207.84	201,189.12	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	648	73.75	47,790.00	
	QUALCOMM INC	2,461	63.20	155,535.20	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	371	81.86	30,370.06	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,654	91.77	151,787.58	
	XILINX INC	546	79.40	43,352.40	
米ドル小計		492,891		38,545,565.98	(4,335,219,805)
加ドル	CAMECO CORP	1,280	14.38	18,406.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	2,199	36.54	80,351.46	
	CENOVUS ENERGY INC	1,378	11.10	15,295.80	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	1,098	6.76	7,422.48	
	ENBRIDGE INC	2,639	40.79	107,644.81	

ENCANA CORP	2,267	13.81	31,307.27
HUSKY ENERGY INC	959	18.82	18,048.38
IMPERIAL OIL LTD	880	41.79	36,775.20
INTER PIPELINE LTD	1,244	21.67	26,957.48
PEMBINA PIPELINE CORP	1,143	43.80	50,063.40
SUNCOR ENERGY INC	2,841	43.98	124,947.18
TRANSCANADA CORP	1,679	50.06	84,050.74
AGNICO EAGLE MINES LTD	328	46.36	15,206.08
BARRICK GOLD CORP	2,745	16.43	45,100.35
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,206	10.93	13,181.58
FRANCO-NEVADA CORP	307	80.58	24,738.06
GOLDCORP INC	1,343	11.09	14,893.87
NUTRIEN LTD	1,060	67.07	71,094.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	793	24.83	19,690.19
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,129	21.23	23,968.67
BOMBARDIER INC 'B'	4,930	3.31	16,318.30
SNC-LAVALIN GROUP INC	605	46.94	28,398.70
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,281	106.70	136,682.70
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	277	256.50	71,050.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	674	62.81	42,333.94
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	538	73.62	39,607.56
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,223	24.42	29,865.66
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	149.10	20,724.90
DOLLARAMA INC	534	39.67	21,183.78
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	883	61.49	54,295.67
LOBLAW COMPANIES LTD	459	64.96	29,816.64
METRO INC	506	41.51	21,004.06
SAPUTO INC	498	39.70	19,770.60
BANK OF MONTREAL	982	99.72	97,925.04
BANK OF NOVA SCOTIA	1,868	70.14	131,021.52
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	694	113.25	78,595.50
NATIONAL BANK OF CANADA	850	60.06	51,051.00
ROYAL BANK OF CANADA	2,295	94.73	217,405.35
TORONTO-DOMINION BANK	2,954	72.44	213,987.76
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,600	53.24	85,184.00

	CI FINANCIAL CORP	969	18.99	18,401.31	
	THOMSON REUTERS CORP	610	60.68	37,014.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	45	615.16	27,682.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	624	29.91	18,663.84	
	INTACT FINANCIAL CORP	323	100.87	32,581.01	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	3,248	20.46	66,454.08	
	POWER CORP OF CANADA	949	26.94	25,566.06	
	POWER FINANCIAL CORP	525	28.24	14,826.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,059	48.15	50,990.85	
	CGI GROUP INC - CL A	605	77.89	47,123.45	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	44	860.00	37,840.00	
	OPEN TEXT CORP	696	44.05	30,658.80	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	151	178.82	27,001.82	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	606	67.51	40,911.06	
	TELUS CORP	610	45.40	27,694.00	
	FORTIS INC	873	43.50	37,975.50	
加ドル小計		64,245		2,776,751.56	(238,661,796)
ユーロ	ENAGAS SA	514	23.21	11,929.94	
	ENI SPA	4,526	14.97	67,772.32	
	OMV AG	339	45.79	15,522.81	
	REPSOL SA	2,124	15.05	31,966.20	
	SNAM SPA	6,436	3.64	23,427.04	
	TOTAL SA	4,040	51.41	207,696.40	
	AIR LIQUIDE SA	720	107.70	77,544.00	
	AKZO NOBEL	403	73.44	29,596.32	
	ARCELORMITTAL	1,219	22.05	26,885.04	
	ARKEMA	208	89.42	18,599.36	
	BASF SE	1,581	66.66	105,389.46	
	COVESTRO AG	322	54.00	17,388.00	
	CRH PLC	1,670	24.10	40,247.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	270	57.36	15,487.20	
	K+S AG	545	16.01	8,725.45	
	KONINKLIJKE DSM NV	338	76.30	25,789.40	
	LANXESS AG	260	53.26	13,847.60	

SOLVAY SA	192	99.38	19,080.96
STORA ENSO OYJ-R SHS	969	13.24	12,829.56
SYMRISE AG	297	71.78	21,318.66
THYSSENKRUPP AG	881	18.24	16,073.84
UMICORE	374	40.39	15,105.86
UPM-KYMMENE OYJ	1,142	27.69	31,621.98
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	456	32.38	14,765.28
AIRBUS GROUP SE	1,009	97.94	98,821.46
ALSTOM	454	37.54	17,043.16
BOUYGUES SA	502	31.93	16,028.86
BRENTAG AG	402	45.71	18,375.42
CNH INDUSTRIAL NV	2,110	8.82	18,627.08
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,042	31.55	32,875.10
FERROVIAL SA	1,247	17.97	22,408.59
GEA GROUP AG	420	26.04	10,936.80
KONE OYJ-B	732	40.60	29,719.20
LEGRAND SA	581	57.10	33,175.10
MAN SE	83	91.30	7,577.90
SAFRAN SA	557	110.95	61,799.15
SCHNEIDER ELECTRIC SE	964	62.06	59,825.84
SIEMENS AG-REG	1,308	101.26	132,448.08
THALES SA	180	118.40	21,312.00
VINCI SA	852	78.34	66,745.68
WARTSILA OYJ ABP	1,236	14.59	18,039.42
EDENRED	658	30.95	20,365.10
RANDSTAD NV	207	42.61	8,820.27
WOLTERS KLUWER	514	52.14	26,799.96
AENA SA	163	140.55	22,909.65
ATLANTIA SPA	837	17.61	14,739.57
DEUTSCHE POST AG-REG	1,573	28.48	44,799.04
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	1,713	6.59	11,298.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	568	74.50	42,316.00
CONTINENTAL AG	183	138.50	25,345.50
DAIMLER AG	1,539	51.35	79,027.65
FERRARI NV	245	101.20	24,794.00

FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,975	14.13	27,918.60
MICHELIN (CGDE)-B	296	87.14	25,793.44
PEUGEOT SA	1,292	20.33	26,266.36
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	266	51.76	13,768.16
RENAULT SA	379	64.47	24,434.13
VALEO SA	414	29.87	12,366.18
VOLKSWAGEN AG-PFD	315	137.00	43,155.00
ADIDAS AG	336	207.30	69,652.80
HERMES INTERNATIONAL	67	503.20	33,714.40
KERING	137	381.10	52,210.70
LUXOTTICA GROUP SPA	320	55.50	17,760.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	476	265.45	126,354.20
PUMA SE	11	444.00	4,884.00
ACCOR SA	467	40.13	18,740.71
SODEXO	173	87.52	15,140.96
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	737	19.92	14,684.72
PUBLICIS GROUPE	402	51.04	20,518.08
VIVENDI	2,083	21.47	44,722.01
INDITEX	1,636	24.83	40,621.88
CARREFOUR SA	1,068	16.86	18,006.48
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,004	20.51	41,112.06
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,318	64.85	85,472.30
DANONE	1,094	63.34	69,293.96
HEINEKEN HOLDING NV	195	75.80	14,781.00
HEINEKEN NV	441	77.96	34,380.36
KERRY GROUP PLC-A	385	91.70	35,304.50
PERNOD-RICARD SA	354	132.60	46,940.40
BEIERSDORF AG	244	94.50	23,058.00
HENKEL AG & CO KGAA	178	85.85	15,281.30
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	274	94.60	25,920.40
L'OREAL	442	192.50	85,085.00
UNILEVER NV-CVA	2,526	48.45	122,397.33
ESSILORLUXOTTICA	370	120.75	44,677.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	437	68.92	30,118.04
FRESENIUS SE & CO KGAA	810	58.90	47,709.00

KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,754	31.92	55,987.68
BAYER AG-REG	1,593	66.23	105,504.39
GRIFOLS SA	713	22.31	15,907.03
MERCK KGAA	228	88.26	20,123.28
SANOFI	1,924	75.65	145,550.60
UCB SA	286	70.90	20,277.40
ABN AMRO GROUP NV-CVA	809	21.29	17,223.61
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	10,228	5.10	52,224.16
BANCO DE SABADELL SA	10,365	1.03	10,707.04
BANCO SANTANDER SA	27,650	4.07	112,535.50
BNP PARIBAS	1,953	47.15	92,093.71
CAIXABANK S.A	7,994	3.45	27,643.25
COMMERZBANK AG	1,847	8.12	15,012.41
CREDIT AGRICOLE SA	2,542	11.36	28,882.20
ERSTE GROUP BANK AG	501	34.87	17,469.87
ING GROEP NV-CVA	6,067	10.36	62,854.12
INTESA SANPAOLO	28,018	1.95	54,724.75
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	-	-
KBC GROEP NV	394	60.48	23,829.12
MEDIOBANCA SPA	1,534	7.78	11,934.52
SOCIETE GENERALE	1,265	32.88	41,599.52
UNICREDIT SPA	3,866	11.14	43,067.24
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	3,015	8.82	26,592.30
DEUTSCHE BOERSE AG	332	109.40	36,320.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	273	79.84	21,796.32
AEGON NV	4,432	5.28	23,400.96
AGEAS	414	43.75	18,112.50
ALLIANZ SE-REG	754	183.14	138,087.56
ASSICURAZIONI GENERALI	2,483	14.04	34,873.73
AXA	3,442	22.07	75,982.15
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	291	186.45	54,256.95
NN GROUP NV	566	37.31	21,117.46
SAMPO OYJ-A SHS	844	40.08	33,827.52
DEUTSCHE WOHNEN SE	738	40.48	29,874.24
VONOVIA SE	918	40.38	37,068.84

	AMADEUS IT GROUP SA	761	72.28	55,005.08
	ATOS SE	214	68.16	14,586.24
	CAP GEMINI SA	319	103.45	33,000.55
	DASSAULT SYSTEMES SA	237	113.30	26,852.10
	SAP SE	1,673	93.68	156,726.64
	WIRECARD AG	195	165.20	32,214.00
	NOKIA OYJ	9,407	4.70	44,212.90
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	5,565	14.43	80,330.77
	KONINKLIJKE KPN NV	6,612	2.35	15,597.70
	ORANGE S.A.	3,853	13.85	53,364.05
	TELECOM ITALIA SPA	23,632	0.48	11,577.31
	TELEFONICA SA	7,801	6.93	54,068.73
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	474	36.01	17,068.74
	E.ON SE	4,498	8.52	38,354.44
	ENEL SPA	13,636	4.43	60,502.93
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	6,241	3.07	19,172.35
	ENGIE	3,625	11.64	42,213.12
	FORTUM OYJ	1,026	18.50	18,981.00
	IBERDROLA SA	10,640	6.36	67,734.24
	NATURGY ENERGY GROUP SA	720	22.00	15,840.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	989	18.60	18,395.40
	RWE AG	878	17.71	15,549.38
	SUEZ	1,228	12.46	15,300.88
	TERNA SPA	3,500	4.58	16,054.50
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,031	17.15	17,681.65
	ASML HOLDING NV	705	147.52	104,001.60
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,071	16.45	34,067.95
	STMICROELECTRONICS NV	1,161	12.10	14,048.10
ユーロ小計		321,134		5,846,793.24 (747,395,579)
英ポンド	BP PLC	33,435	5.35	179,044.42
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	7,695	24.16	185,911.20
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	6,032	24.69	148,960.24
	ANGLO AMERICAN PLC	2,374	16.21	38,496.78
	ANTOFAGASTA PLC	1,364	7.45	10,172.71

BHP BILLITON PLC	3,440	15.19	52,253.60
GLENCORE PLC	20,472	3.02	61,999.45
JOHNSON MATTHEY PLC	515	28.92	14,893.80
MONDI PLC	799	18.01	14,389.99
RANDGOLD RESOURCES LTD	201	61.98	12,457.98
RIO TINTO PLC	1,955	36.55	71,465.02
ASHTREAD GROUP PLC	839	18.43	15,462.77
BAE SYSTEMS PLC ORD	6,413	5.44	34,938.02
BUNZL PLC	865	22.75	19,678.75
DCC PLC	217	65.30	14,170.10
FERGUSON PLC	415	51.84	21,513.60
MELROSE INDUSTRIES PLC	11,311	1.57	17,854.41
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,897	8.72	25,261.84
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT-C(N)	133,262	0.00	133.26
SMITHS GROUP PLC	845	13.32	11,259.62
TRAVIS PERKINS PLC	913	10.72	9,787.36
EXPERIAN PLC	1,892	17.60	33,299.20
INTERTEK GROUP PLC	389	44.73	17,399.97
RELX PLC	3,799	15.52	58,960.48
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	4.97	11,714.03
BURBERRY GROUP PLC	993	17.17	17,054.77
PERSIMMON PLC	663	22.07	14,632.41
CARNIVAL PLC	365	42.33	15,450.45
COMPASS GROUP PLC	3,041	15.43	46,937.83
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	414	40.23	16,655.22
WHITBREAD PLC	426	43.75	18,637.50
ITV PLC	6,992	1.45	10,152.38
WPP PLC	2,617	9.10	23,835.63
KINGFISHER PLC	4,306	2.44	10,532.47
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,694	2.84	7,669.81
NEXT PLC	290	51.34	14,888.60
TESCO PLC	16,939	2.15	36,469.66
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	568	23.51	13,353.68
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,779	36.08	136,346.32
DIAGEO PLC	4,224	26.82	113,308.80

	IMPERIAL BRANDS PLC	1,739	27.43	47,709.46	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,048	67.47	70,708.56	
	UNILEVER PLC	1,914	42.37	81,105.75	
	SMITH & NEPHEW PLC	1,973	12.75	25,165.61	
	ASTRAZENECA PLC	2,165	58.12	125,829.80	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	8,474	15.32	129,838.62	
	SHIRE PLC	1,613	44.28	71,431.70	
	BARCLAYS PLC	30,400	1.72	52,306.24	
	HSBC HOLDINGS PLC	32,347	6.09	197,122.61	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	116,858	0.57	67,450.43	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	9,505	2.34	22,289.22	
	STANDARD CHARTERED PLC	4,701	5.25	24,694.35	
	3I GROUP PLC	1,628	8.49	13,834.74	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	624	43.11	26,900.64	
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,130	9.83	11,114.68	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	4,676	2.61	12,239.43	
	AVIVA PLC	8,042	4.18	33,623.60	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	12,544	2.44	30,707.71	
	PRUDENTIAL PLC	4,494	15.06	67,702.11	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,591	5.46	14,167.58	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	575	12.45	7,161.62	
	SAGE GROUP PLC/THE	3,107	5.32	16,535.45	
	BT GROUP PLC	15,898	2.40	38,242.63	
	VODAFONE GROUP PLC	41,990	1.46	61,557.34	
	CENTRICA PLC	8,617	1.49	12,860.87	
	NATIONAL GRID PLC	6,161	8.40	51,789.36	
	SEVERN TRENT PLC	491	18.56	9,112.96	
	SSE PLC	1,749	11.41	19,964.83	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	7.17	11,679.27	
英債券小計		621,688		2,932,251.30 (422,859,959)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	16	2,340.00	37,440.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	850	41.90	35,615.00	
	SIKA AG-REG	240	123.10	29,544.00	
	ABB LTD-REG	3,141	20.08	63,071.28	

	GEBERIT AG-REG	72	420.20	30,254.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	103	195.60	20,146.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	46.98	19,684.62	
	SGS SA-REG	14	2,261.00	31,654.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	142	136.40	19,368.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	850	70.36	59,806.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	76	323.80	24,608.80	
	NESTLE SA-REG	5,152	84.04	432,974.08	
	SONOVA HOLDING AG-REG	102	155.40	15,850.80	
	LONZA GROUP AG-REG	146	300.80	43,916.80	
	NOVARTIS AG-REG	3,645	85.34	311,064.30	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,183	234.15	276,999.45	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	4,811	12.56	60,426.16	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	43.42	25,140.18	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	44	681.00	29,964.00	
	UBS GROUP AG-REG	6,739	13.39	90,235.21	
	BALOISE HOLDING AG - REG	127	140.80	17,881.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	60	361.80	21,708.00	
	SWISS RE AG	623	87.70	54,637.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	237	301.40	71,431.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	215	79.20	17,028.00	
	SWISSCOM AG-REG	57	445.30	25,382.10	
	スイスフラン小計	29,643		1,865,833.28	(209,719,660)
スウェーデンク ローナ	ASSA ABLOY AB-B	1,541	175.60	270,599.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,445	214.50	309,952.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	603	197.68	119,201.04	
	EPIROC AB-A	1,044	82.61	86,244.84	
	EPIROC AB-B	603	75.59	45,580.77	
	SANDVIK AB	2,353	138.35	325,537.55	
	SKANSKA AB-B SHS	682	137.15	93,536.30	
	VOLVO AB-B SHS-B	2,549	133.90	341,311.10	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,569	159.60	250,412.40	
	SWEDISH MATCH AB	639	442.40	282,693.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,300	217.20	282,360.00	

	NORDEA BANK ABP	4,757	79.41	377,753.37	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	2,406	93.54	225,057.24	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,151	101.00	318,251.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	1,517	205.00	310,985.00	
	INVESTOR AB-B SHS	798	383.10	305,713.80	
	KINNEVIK AB - B	792	246.50	195,228.00	
	ERICSSON LM-B SHS	5,119	79.50	406,960.50	
	HEXAGON AB-B SHS	583	441.90	257,627.70	
	TELIA CO AB	5,610	40.64	227,990.40	
スウェーデンクローナ小計		39,061		5,032,996.71	(62,107,179)
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	1,861	214.00	398,254.00	
	NORSK HYDRO A S	3,505	41.09	144,020.45	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	353.30	151,565.70	
	ORKLA ASA	1,924	71.02	136,642.48	
	DNB ASA	2,071	153.55	318,002.05	
	TELENOR ASA	1,320	154.05	203,346.00	
ノルウェークローネ小計		11,110		1,351,830.68	(18,209,159)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	501	301.30	150,951.30	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	380	411.80	156,484.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	14	7,994.00	111,916.00	
	DSV A/S	452	507.80	229,525.60	
	PANDORA A/S	209	422.00	88,198.00	
	CARLSBERG AS-B	239	717.20	171,410.80	
	COLOPLAST-B	302	619.20	186,998.40	
	GENMAB A/S	99	792.40	78,447.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,943	274.65	808,294.95	
	DANSKE BANK A/S	1,229	126.35	155,284.15	
	ORSTED A/S	328	415.50	136,284.00	
デンマーククローネ小計		6,696		2,273,794.80	(38,950,104)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	536	27.61	14,798.96	
	ORIGIN ENERGY LTD	2,933	7.09	20,794.97	
	SANTOS LTD	3,916	6.65	26,041.40	

	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,892	33.60	63,571.20	
	AMCOR LIMITED	2,035	12.71	25,864.85	
	BHP BILLITON LTD	5,538	30.80	170,570.40	
	NEWCREST MINING LTD	1,858	21.44	39,835.52	
	ORICA LIMITED	1,061	16.44	17,442.84	
	RIO TINTO LTD	786	73.52	57,786.72	
	SOUTH32 LTD	8,960	3.52	31,539.20	
	CIMIC GROUP LTD	219	45.93	10,058.67	
	BRAMBLES LTD	2,754	10.55	29,054.70	
	TRANSURBAN GROUP	5,592	11.12	62,183.04	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,117	26.75	29,879.75	
	CROWN RESORTS LTD	1,666	12.32	20,525.12	
	TABCORP HOLDINGS LTD	5,056	4.58	23,156.48	
	WESFARMERS LTD	2,052	45.62	93,612.24	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	2,375	27.55	65,431.25	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	454	54.77	24,865.58	
	CSL LTD	786	174.69	137,306.34	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	4,602	24.80	114,129.60	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	2,909	65.27	189,870.43	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	4,692	24.53	115,094.76	
	WESTPAC BANKING CORP	5,689	25.84	147,003.76	
	AMP LTD	5,746	2.50	14,365.00	
	ASX LTD	706	57.37	40,503.22	
	MACQUARIE GROUP LTD	644	110.13	70,923.72	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	5,143	6.78	34,869.54	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	2,614	11.17	29,198.38	
	SUNCORP GROUP LTD	2,377	13.61	32,350.97	
	COMPUTERSHARE LTD	1,700	19.35	32,895.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	5,367	3.05	16,369.35	
	AGL ENERGY LTD	1,271	17.85	22,687.35	
豪ドル小計		95,046		1,824,580.31	(145,145,363)
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	7,059	3.83	27,071.26	
ニュージーランドドル小計		7,059		27,071.26	(1,984,052)

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	5,098	79.20	403,761.60	
	MTR CORP	4,000	38.40	153,600.00	
	LI & FUNG LTD	22,000	1.52	33,440.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	4,000	42.45	169,800.00	
	SANDS CHINA LTD	5,400	31.55	170,370.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	6,500	32.20	209,300.00	
	HANG SENG BANK LTD	1,550	194.70	301,785.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,237	210.60	471,112.20	
	AIA GROUP LTD	20,663	59.35	1,226,349.05	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	4,598	52.75	242,544.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	6,000	14.06	84,360.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	19,000	9.90	188,100.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,933	100.90	295,939.70	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,254	83.05	187,194.70	
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	19.18	38,360.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	46.95	140,850.00	
	CLP HOLDINGS LTD	3,694	86.80	320,639.20	
	HONG KONG & CHINA GAS	18,839	14.96	281,831.44	
POWER ASSETS HOLDINGS	2,500	52.55	131,375.00		
香港ドル小計		136,266		5,050,712.39	(72,477,722)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	3,600	6.21	22,356.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,400	9.28	22,272.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	14,000	0.89	12,460.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	11,400	2.64	30,096.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	3,002	23.71	71,177.42	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	6,308	10.60	66,864.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,642	24.95	65,917.90	
	CAPITALAND LTD	6,000	3.05	18,300.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	17,500	3.15	55,125.00	
シンガポールドル小計		66,852		364,569.12	(29,683,217)
イスラエルシュケル	BANK HAPUALIM BM	4,023	24.90	100,172.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,255	22.90	74,539.50	
		7,278		174,712.20	

イスラエルシュケル小計			(5,311,250)
合 計	1,898,969		6,327,724,845 (6,327,724,845)

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	202	25,181.32	
		AMERICAN TOWER CORP	745	114,364.95	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,031	20,310.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	232	41,221.76	
		BOSTON PROPERTIES INC	326	38,128.96	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	392	7,569.52	
		CROWN CASTLE INTL CORP	724	77,721.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	330	38,544.00	
		DUKE REALTY CORPORATION	777	22,059.03	
		EQUINIX INC	129	53,144.13	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	570	37,654.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	114	29,002.74	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	231	20,390.37	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	194	23,902.74	
		HCP INC	1,109	29,976.27	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,367	25,576.57	
		IRON MOUNTAIN INC	538	17,592.60	
		KIMCO REALTY CORPORATION	1,188	18,829.80	
		MACERICH CO/THE	187	9,621.15	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	280	28,008.40	
		PROLOGIS INC	842	55,479.38	
		PUBLIC STORAGE	277	55,879.21	
		REALTY INCOME CORP	556	33,493.44	
		REGENCY CENTERS CORP	312	20,027.28	
SBA COMMUNICATIONS CORP	192	29,976.96			
SIMON PROPERTY GROUP INC	511	92,399.02			

		SL GREEN REALTY CORP	147	13,657.77	
		UDR INC	680	27,111.60	
		VENTAS INC	650	36,985.00	
		VORNADO REALTY TRUST	292	19,876.44	
		WELLTOWER INC	721	47,787.88	
		WEYERHAEUSER CO	1,363	39,458.85	
米ドル小計			18,209	1,150,932.74	(129,445,405)
ユーロ	投資証券	KLEPIERRE	588	17,210.76	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	271	43,484.66	
ユーロ小計			859	60,695.42	(7,758,695)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	2,367	13,856.41	
		HAMMERSON PLC	3,108	13,454.53	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	14,232.98	
英ポンド小計			7,169	41,543.92	(5,991,048)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	2,425	22,989.00	
		DEXUS	2,875	29,181.25	
		GOODMAN GROUP	3,775	38,958.00	
		LENDLEASE GROUP	1,550	26,675.50	
		SCENTRE GROUP	11,481	44,661.09	
		STOCKLAND	4,905	18,197.55	
		VICINITY CENTRES	6,167	16,280.88	
豪ドル小計			33,178	196,943.27	(15,666,837)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	3,567	258,429.15	
香港ドル小計			3,567	258,429.15	(3,708,458)
合計				162,570,443	(162,570,443)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 497銘柄	97.1%		66.8%
	投資証券 32銘柄		2.9%	2.0%
加ドル	株式 56銘柄	100.0%		3.7%
ユーロ	株式 150銘柄	99.0%		11.5%
	投資証券 2銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 69銘柄	98.6%		6.5%
	投資証券 3銘柄		1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 26銘柄	100.0%		3.2%
スウェーデンクローナ	株式 20銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.6%
豪ドル	株式 33銘柄	90.3%		2.2%
	投資証券 7銘柄		9.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 1銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式 19銘柄	95.1%		1.1%
	投資証券 1銘柄		4.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 9銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成29年10月26日現在

平成30年10月26日現在

資産の部

流動資産		
金銭信託	-	23,033,935
コール・ローン	187,367,446	94,602,155
国債証券	28,595,123,370	30,067,973,850
地方債証券	2,709,286,000	2,792,055,000
特殊債券	3,616,181,000	3,106,375,000
社債券	1,644,973,000	2,356,368,000
未収利息	78,111,629	80,137,461
前払費用	857,096	719,683
流動資産合計	36,831,899,541	38,521,265,084
資産合計		
資産合計	36,831,899,541	38,521,265,084
負債の部		
流動負債		
未払金	133,118,700	-
未払解約金	24,058,816	54,418,138
未払利息	245	148
流動負債合計	157,177,761	54,418,286
負債合計	157,177,761	54,418,286
純資産の部		
元本等		
元本	26,501,934,817	27,733,551,245
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,172,786,963	10,733,295,553
元本等合計	36,674,721,780	38,466,846,798
純資産合計	36,674,721,780	38,466,846,798
負債純資産合計	36,831,899,541	38,521,265,084

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
1.	期首	平成28年10月27日	平成29年10月27日

期首元本額	24,166,629,108円	26,501,934,817円
期首からの追加設定元本額	3,928,655,478円	3,531,441,697円
期首からの一部解約元本額	1,593,349,769円	2,299,825,269円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	1,278,071,280円	1,832,450,054円
DCインデックスバランス（株式40）	1,360,904,841円	1,862,268,494円
DCインデックスバランス（株式60）	998,745,785円	1,342,863,165円
DCインデックスバランス（株式80）	162,344,693円	221,368,003円
インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,673,727,285円	1,798,701,774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	4,144,139,672円	3,834,626,257円
全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	5,013,342円	3,933,014円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,082,407,274円	1,514,625,168円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,867,410円	4,753,159円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	24,787,432円	26,123,505円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	101,291,024円	119,991,693円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	322,587,278円	300,427,344円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,481,306,102円	4,991,215,999円
世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	30,635,180円	3,454,881円
世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	119,899,821円	8,181,717円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,205,939,162円	1,241,071,680円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,207,621,462円	1,252,645,847円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	668,276,228円	685,795,510円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	100,418,595円	102,644,008円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,284,579,693円	6,322,149,282円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	244,371,258円	264,260,691円
計	26,501,934,817円	27,733,551,245円
2. 受益権の総数	26,501,934,817口	27,733,551,245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 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

国債証券	802,453,373
地方債証券	20,339,000
特殊債券	30,201,000
社債券	8,403,000
合計	861,396,373

(平成30年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	239,804,020
地方債証券	22,560,000
特殊債券	19,086,000
社債券	15,636,000
合計	297,086,020

(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)

平成29年10月26日現在		平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3839円	1口当たり純資産額	1.3870円
(1万口当たり純資産額)	(13,839円)	(1万口当たり純資産額)	(13,870円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第120回利付国債（5年）	330,000,000	330,951,828	
	第122回利付国債（5年）	300,000,000	300,822,000	
	第123回利付国債（5年）	505,000,000	506,686,700	
	第124回利付国債（5年）	560,000,000	562,161,600	
	第125回利付国債（5年）	325,000,000	326,449,500	
	第126回利付国債（5年）	220,000,000	221,133,000	
	第1回利付国債（40年）	70,000,000	98,049,700	
	第2回利付国債（40年）	165,000,000	223,380,300	
	第3回利付国債（40年）	50,000,000	67,988,500	
	第4回利付国債（40年）	95,000,000	129,713,000	
	第5回利付国債（40年）	35,000,000	45,945,900	
	第6回利付国債（40年）	70,000,000	90,037,500	
	第7回利付国債（40年）	50,000,000	61,395,000	
	第8回利付国債（40年）	95,000,000	108,019,750	
	第9回利付国債（40年）	160,000,000	131,547,200	
	第10回利付国債（40年）	125,000,000	121,870,000	
	第11回利付国債（40年）	50,000,000	46,909,000	
	第303回利付国債（10年）	331,000,000	335,528,322	
	第305回利付国債（10年）	473,000,000	480,761,930	
	第306回利付国債（10年）	93,000,000	94,986,480	
	第308回利付国債（10年）	140,000,000	143,304,000	
	第309回利付国債（10年）	134,000,000	136,721,540	
	第310回利付国債（10年）	78,000,000	79,680,120	
	第311回利付国債（10年）	23,000,000	23,408,020	
	第312回利付国債（10年）	205,000,000	210,856,850	
	第313回利付国債（10年）	370,000,000	382,676,200	
	第315回利付国債（10年）	65,000,000	67,282,150	
	第316回利付国債（10年）	35,000,000	36,136,100	
	第317回利付国債（10年）	105,000,000	108,718,050	
	第318回利付国債（10年）	185,000,000	191,014,350	
	第319回利付国債（10年）	5,000,000	5,191,550	
	第320回利付国債（10年）	190,000,000	196,680,400	
第321回利付国債（10年）	175,000,000	181,606,250		

第322回利付国債(10年)	75,000,000	77,576,250	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,661,400	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,831,500	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	217,427,700	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,998,100	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,432,950	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,522,450	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	239,538,100	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	219,130,800	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,692,000	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	217,610,400	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,482,000	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	506,076,900	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,710,400	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,646,800	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	401,118,900	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	380,711,500	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	432,474,000	
第341回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,023,250,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,105,000	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	246,964,900	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,354,500	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	613,965,000	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	492,660,700	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	160,756,800	
第348回利付国債(10年)	90,000,000	90,317,700	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	491,332,800	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	480,667,200	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	435,204,450	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	270,067,200	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	193,437,300	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	46,120,900	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	141,926,400	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	25,909,000	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	53,224,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	73,307,300	

第24回利付国債(30年)	68,000,000	90,783,400	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,053,000	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	224,583,600	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	38,911,330	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	126,336,000	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	366,897,840	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	193,099,200	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	155,646,000	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	65,987,500	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	170,418,600	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	261,354,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	212,983,680	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	171,478,350	
第37回利付国債(30年)	101,000,000	126,325,750	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	116,890,850	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	94,013,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	110,869,200	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	48,396,400	
第42回利付国債(30年)	105,000,000	127,086,750	
第43回利付国債(30年)	235,000,000	284,540,350	
第44回利付国債(30年)	100,000,000	121,123,000	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	69,912,000	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	116,521,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	136,855,750	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	119,871,150	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	102,728,700	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	24,860,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	60,905,600	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	82,617,300	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	98,813,400	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	108,991,300	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	108,858,200	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	49,420,000	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	98,716,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	98,592,000	
第59回利付国債(30年)	100,000,000	95,881,000	

第44回利付国債(20年)	51,000,000	52,873,740	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,931,980	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	104,589,540	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	60,052,920	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	248,556,120	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	41,198,040	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,095,150	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	70,740,780	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	55,820,960	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	145,579,950	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,470,710	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	313,405,050	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,303,020	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,730,480	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	59,266,620	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	110,224,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,300,380	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,623,040	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	87,577,620	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	118,480,960	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	126,231,840	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	127,233,480	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	133,590,160	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,370,700	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,609,460	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,226,800	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	181,612,800	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	68,803,800	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	151,243,300	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	352,722,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,763,520	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	295,152,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,144,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	69,890,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,660,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	97,958,020	

第96回利付国債(20年)	98,000,000	115,384,220	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,541,900	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	111,011,180	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	138,639,150	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,943,600	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	80,306,160	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	98,930,970	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,329,910	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,358,440	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	92,085,840	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,411,440	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	155,948,000	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	158,058,360	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,915,080	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	117,849,900	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,415,500	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	96,490,400	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	350,795,600	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	63,043,240	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	67,282,600	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	67,474,000	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	113,053,590	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,075,100	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,541,300	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	81,286,800	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,359,960	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,171,350	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	79,593,150	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	97,012,800	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	61,977,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	30,366,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	78,334,100	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	59,642,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	71,660,400	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,182,200	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	41,404,650	

	第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,871,000	
	第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,885,000	
	第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,543,400	
	第136回利付国債(20年)	180,000,000	210,798,000	
	第137回利付国債(20年)	200,000,000	237,158,000	
	第138回利付国債(20年)	120,000,000	139,143,600	
	第139回利付国債(20年)	150,000,000	175,899,000	
	第140回利付国債(20年)	450,000,000	534,379,500	
	第141回利付国債(20年)	195,000,000	231,878,400	
	第142回利付国債(20年)	85,000,000	102,227,800	
	第143回利付国債(20年)	94,000,000	110,550,580	
	第144回利付国債(20年)	130,000,000	151,100,300	
	第145回利付国債(20年)	205,000,000	244,222,650	
	第146回利付国債(20年)	135,000,000	160,911,900	
	第147回利付国債(20年)	60,000,000	70,683,600	
	第148回利付国債(20年)	120,000,000	139,641,600	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	250,365,350	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	103,448,700	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	167,686,500	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	100,532,700	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	135,896,400	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	133,918,800	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	151,530,400	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	107,980,400	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	47,261,500	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	168,889,900	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	151,362,000	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	143,386,600	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	120,504,000	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	70,178,500	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	165,000,000	
	第164回利付国債(20年)	285,000,000	279,077,700	
国債証券 合計		27,432,000,000	30,067,973,850	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,955,000	
	第690回東京都公募公債	100,000,000	102,724,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	206,390,000	

第708回東京都公募公債	100,000,000	103,191,000	
第709回東京都公募公債	100,000,000	102,790,000	
第712回東京都公募公債	200,000,000	205,886,000	
第730回東京都公募公債	100,000,000	103,336,000	
第731回東京都公募公債	100,000,000	103,180,000	
平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	206,490,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,948,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,601,000	
平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,423,000	
平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,830,000	
第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,141,000	
平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	103,759,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,901,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,661,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,074,000	
平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,114,000	
第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	103,875,000	
第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,980,000	
第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,953,000	
平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	103,448,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,405,000	
地方債証券 合計	2,700,000,000	2,792,055,000	
特殊債券			
第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,175,000	
第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,167,000	
第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,015,000	
第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,413,000	
第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,164,000	
第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,295,000	
第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,538,000	
第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,866,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	117,231,000	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,985,000	
第17回道路債券	100,000,000	106,127,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,628,000	
第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,010,000	

	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,872,000	
	第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,207,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	117,493,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,332,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,724,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,463,000	
	第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	102,530,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,291,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,224,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,152,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,746,000	
	第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,036,000	
	第318回信金中金債(5年)	100,000,000	99,961,000	
	第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,876,000	
	第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,854,000	
特殊債券 合計		3,000,000,000	3,106,375,000	
社債券	第8回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,000,000	
	第15回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,303,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,323,000	
	第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,407,000	
	第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,473,000	
	第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	202,052,000	
	第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,194,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,955,000	
	第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,189,000	
	第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,952,000	
	第9回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	201,174,000	
	第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	106,338,000	

第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	109,261,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,890,000	
第87回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	206,122,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	204,762,000	
第563回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,921,000	
第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,953,000	
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,099,000	
社債券 合計	2,300,000,000	2,356,368,000	
合計	35,432,000,000	38,322,771,850	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	232,930,594	346,171,535
金銭信託	-	7,521,161
コール・ローン	28,316,093	30,889,993
国債証券	156,821,157,845	145,412,931,383
派生商品評価勘定	85,620	165
未収入金	170,428,568	-
未収利息	1,430,385,482	1,305,504,312
前払費用	23,217,159	25,047,200
流動資産合計	158,706,521,361	147,128,065,749
資産合計	158,706,521,361	147,128,065,749
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	352,497	288,000
未払解約金	127,182,933	94,343,279
未払利息	37	48
流動負債合計	127,535,467	94,631,327
負債合計	127,535,467	94,631,327
純資産の部		
元本等		
元本	68,830,787,765	66,172,631,391
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	89,748,198,129	80,860,803,031
元本等合計	158,578,985,894	147,033,434,422
純資産合計	158,578,985,894	147,033,434,422
負債純資産合計	158,706,521,361	147,128,065,749

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
1.	期首	平成28年10月27日	平成29年10月27日
	期首元本額	73,927,331,286円	68,830,787,765円
	期首からの追加設定元本額	2,546,830,257円	3,405,417,219円
	期首からの一部解約元本額	7,643,373,778円	6,063,573,593円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	11,521,320,082円	11,964,377,999円

DCインデックスバランス(株式20)	118,484,642円	174,920,013円
DCインデックスバランス(株式40)	182,743,435円	255,247,492円
DCインデックスバランス(株式60)	240,890,995円	331,015,030円
DCインデックスバランス(株式80)	195,728,786円	268,750,988円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,046,993,706円	23,997,016,330円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,507,014,575円	2,370,288,668円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	22,212,150,097円	19,440,325,696円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	27,352,773円	21,654,534円
日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	948,837,067円	-円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	277,981,971円	543,560,785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)	112,785,347円	158,267,081円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,934,600円	2,942,188円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	2,979,065円	3,217,087円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,797,064円	8,154,550円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	14,866,136円	14,261,162円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	459,105,037円	878,532,138円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,122,268,019円	1,029,476,088円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	25,890,571円	2,937,316円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	82,726,039円	5,673,700円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	55,979,065円	59,228,746円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	81,686,820円	85,787,859円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	80,033,456円	84,822,845円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	60,609,002円	63,482,009円
インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	4,200,287,899円	4,156,011,407円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	242,341,516円	252,679,680円
計	68,830,787,765円	66,172,631,391円
2. 受益権の総数	68,830,787,765口	66,172,631,391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 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年10月26日現在)

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,789,219,483
合計	6,789,219,483

（平成30年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,390,395,352
合計	4,390,395,352

(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）

（平成29年10月26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	215,266,213	-	215,533,090	266,877
	米ドル	84,794,800	-	84,710,800	84,000
	ユーロ	95,056,593	-	95,409,090	352,497
	豪ドル	35,414,820	-	35,413,200	1,620
合計		215,266,213	-	215,533,090	266,877

（平成30年10月26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	74,206,815	-	74,494,650	287,835
	米ドル	67,176,000	-	67,464,000	288,000
	ユーロ	7,030,815	-	7,030,650	165
	合計	74,206,815	-	74,494,650	287,835

(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)

平成29年10月26日現在		平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.3039円	1口当たり純資産額	2.2220円
(1万口当たり純資産額)	(23,039円)	(1万口当たり純資産額)	(22,220円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,450,000.00	7,387,725.45
		US TREASURY N/B-1.0%-19/10/15	5,100,000.00	5,018,920.20
		US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,051,394.50
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,530,000.00	10,601,361.81
		US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	4,935,060.00
		US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,875,879.50
		US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,925,780.00
		US TREASURY N/B-2.0%-20/01/31	3,000,000.00	2,971,992.00
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	8,070,000.00	8,155,582.35
		US TREASURY N/B-1.375%-20/02/29	3,000,000.00	2,945,040.00
		US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,078,493.90
		US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	2,430,000.00	2,378,790.18
		US TREASURY N/B-2.375%-20/04/30	3,000,000.00	2,981,250.00
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	7,911,972.27
		US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,385,243.96
		US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	4,995,312.30
		US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	3,510,000.00	3,455,226.45
		US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,921,952.00
		US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,292,806.25
		US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,916,640.00
		US TREASURY N/B-2.625%-20/07/31	620,000.00	617,808.30
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	4,810,000.00	5,305,184.69
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,180,000.00	5,159,766.92
		US TREASURY N/B-1.5%-20/08/15	800,000.00	781,296.80
		US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,431,223.95
		US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,239,579.00
		US TREASURY N/B-1.375%-20/09/15	4,750,000.00	4,622,994.50
		US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,598,468.30
		US TREASURY N/B-1.625%-20/10/15	2,000,000.00	1,953,124.00
		US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,956,718.00
		US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,252,735.77
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,483,389.00
		US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,369,102.00
US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	1,964,960.00		
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,091,737.92		

US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,351,016.00	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	2,968,770.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,952,968.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,864,152.70	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,360,251.20	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,934,258.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,730,000.00	4,806,583.43	
US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,464,745.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,322,552.60	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,920,664.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	334,926.52	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,221,656.18	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,115,423.18	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,926,680.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,344,468.48	
US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	880,000.00	873,915.68	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	1,981,825.06	
US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,886,641.10	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	5,928,879.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,722,444.70	
US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	2,977,617.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,207,144.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,763,770.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	12,250,000.00	11,991,120.75	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,185,931.20	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,346,796.80	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,424,824.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,728,041.57	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,903,906.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,620,156.25	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,893,516.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	579,269.40	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,044,255.76	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	764,452.80	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,427,100.00	

US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,406,102.50
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,730,707.20
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,881,113.00
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,665,366.00
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,919,648.00
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,295,823.22
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,428,515.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,797,822.31
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,330,187.50
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,904,844.00
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,825,670.10
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,391,705.50
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	1,920,118.00
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,877,246.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	1,000,000.00	963,965.00
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	949,180.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,284,389.24
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,771,877.20
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,902,852.00
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,542,967.96
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,800,000.00	5,574,571.40
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	2,915,512.80
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	562,273.65
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,878,554.00
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,088,897.39
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	622,707.36
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,566,811.60
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	7,727,854.45
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,413,750.00
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,288,294.80
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,721,876.00
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	984,844.00
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	11,000,000.00	10,161,030.00
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,187,894.40
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,716,526.20

US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,316,700.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,593,019.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,956,720.00	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	2,792,066.43	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,411,915.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,927,774.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,260,555.10	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,435,576.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	2,868,984.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,898,398.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,649,333.40	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,430,000.00	3,252,603.83	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,100,000.00	1,042,078.40	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,030,441.42	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,460,646.96	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,333,635.60	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,283,328.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,043,525.67	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,673,806.21	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,139,554.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,816,170.10	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,454,032.50	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,672,575.32	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,025,519.72	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,292,490.40	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,177,742.60	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,536,374.40	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,137,804.25	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	4,000,000.00	3,926,328.00	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	4,000,000.00	3,955,780.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	4,880,292.84	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,632,789.14	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,145,796.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,250,000.00	4,753,917.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,067,571.80	

US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,560,940.00
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,046,134.00
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,647,429.36
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,500,374.40
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	2,864,295.36
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	4,750,003.27
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,960,000.00	4,892,841.36
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	5,680,387.10
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,877,656.00
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	1,870,000.00	1,830,591.62
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,180,469.00
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,184,434.00
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,376,240.40
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,787,245.86
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,250,000.00	1,558,301.25
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,359,165.60
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,220,000.00	1,440,386.90
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,118,864.20
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,152,932.60
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,037,246.75
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,021,611.20
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,853,467.77
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,567,124.64
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,305,650.90
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,840,254.00
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,016,166.96
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,094,444.24
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	723,156.00
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,804,766.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	1,927,930.00
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,346,648.80
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	5,364,101.12
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	4,809,991.50
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,144,081.00
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,419,257.60

		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	3,897,412.20
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,103,419.00
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,811,768.30
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,006,748.80
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	4,859,124.80
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	3,661,047.00
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,375,186.80
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,118,995.00
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,723,569.00
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	1,828,516.00
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	2,623,415.20
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,509,359.04
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,778,984.00
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,870,000.00	1,662,545.94
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,571,035.50
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,300,109.60
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	2,100,000.00	1,963,336.20
	米ドル小計		598,810,000.00	587,081,743.44 (66,029,083,684)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	362,754.75
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-19/11/01	950,000.00	941,830.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-20/02/01	780,000.00	771,006.60
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,170,000.00	2,149,645.40
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/05/01	970,000.00	962,860.80
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,172,275.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/08/01	690,000.00	683,569.20
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	1,964,227.80
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-20/11/01	320,000.00	318,048.00
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,140,000.00	2,064,008.60
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	971,679.00
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,470,000.00	1,406,113.80
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,119,302.10
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	992,740.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,310,000.00	1,244,264.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,110,234.60

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,250,093.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	660,000.00	647,988.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,124,547.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,018,247.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,028,588.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	528,134.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,160,000.00	1,030,544.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,107,000.00	1,064,103.75	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	890,000.00	1,160,284.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	100,000.00	98,005.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,417,772.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,090,000.00	1,494,509.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,225,000.00	1,540,792.75	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,315,000.00	1,573,910.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,114,502.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	200,000.00	178,344.00	
加ドル小計			33,302,000.00	34,504,926.70	(2,965,698,449)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	16,000,000.00	15,466,676.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	26,100,000.00	26,044,870.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	23,742,205.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	2,900,000.00	2,825,861.06	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	20,285,336.06	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	11,000,000.00	10,897,898.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	23,313,213.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	9,172,131.98	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	12,300,000.00	11,659,815.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,750,000.00	11,846,685.46	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	11,281,891.98	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	5,433,672.58	
MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	8,891,350.65			

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	9,400,000.00	9,398,520.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	15,500,000.00	14,294,937.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	7,670,000.00	7,240,911.82	
メキシコペソ小計			216,370,000.00	211,795,977.93	(1,222,062,792)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,518,000.00	1,643,766.30	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,460,128.79	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,239,393.96	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,250,000.00	1,469,023.87	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,196,116.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	493,591.70	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,340,000.00	1,523,908.30	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	639,766.89	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,295,000.00	1,334,036.48	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	850,000.00	1,101,668.85	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,253,063.90	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	1,070,000.00	1,081,001.74	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,464,455.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	520,000.00	519,645.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	743,369.25	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	899,741.04	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	320,000.00	321,640.96	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	733,940.41	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,585,000.00	2,454,689.18	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	320,000.00	319,598.48	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	568,308.29	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,370,000.00	2,070,123.43	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,179,785.85	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	870,000.00	842,294.85	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	279,945.64	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	398,759.99	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	1,850,000.00	1,937,110.95	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	1,480,000.00	1,511,583.20	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,000,000.00	2,127,668.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,207,671.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	1,967,492.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	770,000.00	771,578.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,080,000.00	2,367,456.41	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,759,869.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,790,000.00	2,120,355.77	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,640,651.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,300,000.00	1,305,499.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	2,026,440.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	560,000.00	554,247.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,074,061.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,610,636.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,953,449.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,885,000.00	2,093,395.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,660,000.00	1,727,562.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,287,257.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,810,324.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,660,000.00	1,748,695.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,176,086.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,760,000.00	1,761,884.95	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,495,000.00	1,507,315.81
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,785,000.00	1,784,127.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,722,203.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	830,000.00	816,419.13
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	1,932,800.17
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,844,005.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,630,000.00	1,655,786.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,487,859.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,120,000.00	1,158,976.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,026,949.18
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,026,617.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,570,000.00	2,192,765.14
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,180,000.00	1,760,334.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,260,000.00	1,327,263.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	685,000.00	685,837.07
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	560,000.00	626,628.80
BUNDES OBLIGATION-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,017,531.60
BUNDES OBLIGATION-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,217,251.20
BUNDES OBLIGATION-0.0%-21/10/08	740,000.00	751,254.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,374,628.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	2,889,891.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	1,520,000.00	1,602,508.03
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-	1,410,000.00	1,507,336.53

21/01/04		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,908,134.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,706,222.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,159,101.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,667,733.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,716,876.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,048,935.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,859,588.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,049,655.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,054,376.66
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,060,000.00	2,268,976.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,125,954.35
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,945,429.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	2,670,000.00	2,757,760.23
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,707,426.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,842,132.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,530,000.00	2,499,318.69
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,670,000.00	2,677,849.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,742,170.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	3,000,000.00	3,059,967.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,708,687.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-	1,545,000.00	1,568,616.87

28/02/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	860,000.00	1,222,771.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,580,000.00	1,558,743.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,358,946.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,420,000.00	2,261,672.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,530,000.00	2,456,307.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,775,000.00	2,745,452.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,060,000.00	1,749,021.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,280,000.00	2,274,462.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	1,832,330.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,282,159.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,600,000.00	2,186,403.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	400,000.00	423,122.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 19/10/15	470,000.00	467,619.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,103,229.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,646,568.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,779,503.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	744,778.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	394,792.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,663,857.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.2%- 20/10/15	380,000.00	370,734.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%-	940,000.00	924,325.50	

20/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,089,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 21/04/15	280,000.00	268,486.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,251,990.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,620,000.00	1,565,568.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,910,000.00	3,036,814.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,890,000.00	3,095,704.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	733,624.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,060,881.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,050,000.00	2,222,175.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,339,284.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	938,009.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,200,167.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,103,778.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,262,109.02	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,218,758.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	730,000.00	681,214.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,120,172.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,469,903.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,852,848.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	344,864.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-	2,190,000.00	2,819,451.99	

23/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,774,129.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	895,000.00	845,852.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,558,014.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	810,000.00	741,300.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,364,217.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,160,000.00	3,505,621.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	480,000.00	434,225.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,210,000.00	1,098,938.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	1,914,500.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,551,896.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,105,290.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,660,000.00	2,117,653.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,276,949.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	791,759.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	950,000.00	860,891.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,880,000.00	3,559,828.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	750,000.00	673,714.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,500,000.00	1,668,055.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,311,647.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	1,728,490.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-	2,740,000.00	3,375,036.10	

31/05/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,195,560.13
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,115,154.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	490,000.00	423,164.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,377,315.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	734,989.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	2,782,075.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	594,455.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,103,829.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,060,771.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	1,446,431.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,106,328.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,026,678.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	1,026,918.49
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	535,095.40
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	637,000.00	674,463.88
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	305,300.10
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	769,181.00
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	321,618.75
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	590,339.20
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	250,656.25
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	575,898.44
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	737,411.50
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	333,177.82
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	413,976.18
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	303,000.00	301,707.70

FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	456,417.24	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	210,000.00	206,774.40	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	335,382.68	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	330,000.00	336,145.92	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	466,330.48	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,145,224.50	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	3,150,000.00	3,286,876.95	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,670,018.13	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,007,880.30	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,373,931.34	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,614,470.88	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,690,714.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,488,009.30	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,310,100.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,345,955.04	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,202,569.80	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,017,965.22	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	180,602.82	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,332,028.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,424,629.46	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,770,245.79	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,514,231.48	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,355,000.00	3,671,997.17	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,640,000.00	3,694,497.71	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,154,704.08	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,392,060.15	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,080,000.00	3,794,367.19	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,840,000.00	2,855,279.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,680,000.00	2,627,265.64	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,780,000.00	2,878,551.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,330,000.00	3,959,030.34	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,220,000.00	2,229,568.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	1,160,000.00	1,158,161.40	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,615,000.00	3,867,987.18	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,600,000.00	3,062,229.82	

FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,070,000.00	3,258,238.58	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,720,000.00	4,405,559.52	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	680,000.00	688,092.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,390,000.00	3,688,448.76	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	1,530,000.00	1,524,033.19	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,275,475.69	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	765,000.00	815,416.56	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,163,915.36	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	2,030,000.00	2,787,693.44	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,740,000.00	1,886,799.62	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,120,000.00	1,807,575.84	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	930,000.00	1,537,345.80	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	801,672.30	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	505,000.00	536,729.15	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	870,000.00	933,895.41	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	640,000.00	709,427.26	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	494,967.84	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,015.22	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	666,746.95	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	782,932.52	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,262,401.51	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	945,000.00	967,405.00	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	420,000.00	417,441.36	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	893,743.19	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	175,000.00	171,649.97	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	545,000.00	553,252.17	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	685,000.00	716,611.03	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,240,000.00	1,254,871.32	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,330,000.00	1,425,663.17	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,610,369.78	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	708,821.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,348,894.26	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	585,233.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,209,384.99	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,035,786.90	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	180,360.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,759,890.90	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,283,590.31	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,215,515.76	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,160,000.00	1,192,800.16	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,745,733.67	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	500,000.00	510,629.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,344,435.43	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,195,000.00	1,826,845.49	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,255,000.00	1,984,620.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,025,000.00	1,444,976.32	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	188,498.93	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	337,000.00	377,887.19	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	525,000.00	529,675.12	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,181,000.00	1,272,339.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,404,280.08	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	791,549.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,079,731.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	451,553.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,166,701.25	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	933,927.61	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	958,266.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	760,000.00	1,013,202.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	984,017.28	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	625,000.00	623,845.62	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,193,016.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	460,000.00	465,096.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	678,981.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,074,000.00	1,611,081.51	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	592,000.00	830,033.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	375,000.00	382,590.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	273,000.00	468,857.02	
	ユーロ小計	398,741,000.00	451,324,473.43 (57,692,807,438)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	285,000.00	268,489.95

UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,610,000.00	1,697,734.21	
UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,910,858.75	
UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,530,000.00	1,615,502.97	
UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,064,252.39	
UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,210,429.41	
UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,202,822.64	
UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,215,816.58	
UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,198,053.50	
UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,704,903.06	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,023,077.00	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,615,553.46	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,519,695.70	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,410,000.00	1,400,200.50	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,490,808.20	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	360,000.00	366,242.40	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,437,019.30	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,250,000.00	1,695,262.50	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,664,432.28	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,774,040.00	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,292,626.10	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	100,000.00	98,873.00	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,111,926.20	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,760,527.20	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,415,000.00	2,033,618.19	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,545,000.00	2,337,816.75	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,505,000.00	1,916,436.90	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,319,040.68	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,366,660.40	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,495,000.00	1,373,997.69	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	160,000.00	155,546.05	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,095,800.20	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,440,000.00	2,130,624.00	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,608,493.10	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	665,000.00	652,827.84	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	1,994,914.72	

		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,578,600.84
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,665,000.00	1,641,090.60
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,425,000.00	1,407,250.76
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,246,080.00
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,393,973.16
英ポンド小計			53,652,000.00	66,591,919.18 (9,603,220,664)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,410,000.00	8,256,977.82
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,000,000.00	9,045,104.00
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,560,000.00	7,029,068.20
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,434,311.60
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,308,279.56
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,750,000.00	3,794,495.25
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,590,000.00	5,011,281.00
スウェーデンクローナ小計			39,150,000.00	43,879,517.43 (541,473,245)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,710,000.00	7,126,999.66
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	4,993,545.90
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,120,000.00	3,332,858.88
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,267,663.91
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,176,797.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,470,000.00	2,442,247.08
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,750,000.00	1,756,221.60
ノルウェークローネ小計			25,470,000.00	26,096,334.03 (351,517,619)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	6,720,000.00	7,050,980.16
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,930,000.00	7,667,842.64
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,194,287.28
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,190,000.00	9,142,210.35
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	3,410,000.00	3,460,133.82
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,270,000.00	17,633,680.37
デンマーククローネ小計			42,160,000.00	52,149,134.62 (893,314,676)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,450,000.00	1,511,016.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,571,542.00

		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	220,000.00	214,445.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,704,639.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,160,000.00	2,173,824.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,429,392.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,410,000.00	1,569,330.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,291,970.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,344,171.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	1,780,000.00	1,791,214.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,434,688.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,642,952.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,795,310.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,470,601.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	770,000.00	742,703.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,051,444.80	
		ポーランドズロチ小計	29,925,000.00	30,739,243.80 (911,418,578)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,355,000.00	1,365,982.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	1,940,000.00	2,010,566.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,109,860.18	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,390,000.00	2,611,701.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,353,072.09	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,940,000.00	2,192,811.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	670,000.00	672,833.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,020,000.00	2,305,134.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,990,000.00	2,035,878.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,200,000.00	2,313,510.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,660,000.00	2,982,902.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,722,340.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,270,285.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,020,000.00	1,959,379.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,800,000.00	1,822,220.82	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,670,000.00	1,766,856.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,060,000.00	1,071,967.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	470,000.00	462,571.33	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,379,533.44	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	519,854.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,036,574.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	686,633.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	280,000.00	265,900.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	969,616.33	
豪ドル小計			36,767,000.00	38,887,989.28	(3,093,539,547)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	450,000.00	448,613.76	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	320,000.00	319,936.74	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	675,000.00	689,823.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	611,952.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	240,000.00	234,072.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	206,871.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	380,000.00	392,388.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	200,000.00	196,040.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	655,000.00	668,512.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	558,252.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	199,400.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	195,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	580,230.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	225,000.00	226,797.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	204,760.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	336,831.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	379,427.55	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	220,000.00	202,639.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	364,125.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	410,000.00	396,738.55	
シンガポールドドル小計			7,335,000.00	7,412,710.80	(603,542,913)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,012,979.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	465,016.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	848,725.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	550,000.00	553,977.98	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	580,000.00	581,138.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	797,344.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	100,000.00	100,230.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	120,000.00	118,871.26	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	974,610.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	441,900.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	450,000.00	438,790.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	470,000.00	472,627.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	568,632.45	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,129,170.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	590,587.46	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	920,000.00	896,141.58	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,470,000.00	2,494,403.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	550,082.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	805,697.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,157,690.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	642,401.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,725,444.24	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	948,084.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,286,930.11	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	440,840.07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	618,386.07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	415,526.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	806,384.17	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,212,434.03	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,003,110.66	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	429,361.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	901,234.05	
マレーシアリングット小計			26,585,000.00	26,428,751.77	(712,519,147)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	3,350,000.00	3,370,389.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,536,040.35	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,900,000.00	5,709,936.81	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	16,587,384.06	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	7,500,000.00	6,588,841.12	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	7,637,767.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,920,000.00	6,028,057.67	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	6,610,000.00	5,948,235.55	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,703,826.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,800,000.00	7,561,361.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	6,310,000.00	5,594,819.55	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	4,999,284.87	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	10,650,000.00	9,148,019.31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	15,800,000.00	13,538,325.59	
南アフリカランド小計		117,440,000.00	102,952,289.80 (792,732,631)	
	合計		145,412,931,383 (145,412,931,383)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 192銘柄	100.0%	45.6%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 283銘柄	100.0%	39.7%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%

ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	24銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	106,137,072	97,169,128
金銭信託	-	15,003,438
コール・ローン	29,211,024	61,620,281
国債証券	25,035,604,319	24,012,612,135
派生商品評価勘定	44,582,622	264,684,285
未収利息	246,829,993	239,886,562
前払費用	6,691,034	5,213,463
流動資産合計	25,469,056,064	24,696,189,292
資産合計		
25,469,056,064		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	143,469,700	35,464,965
未払解約金	2,024,179	52,361,625
未払利息	38	96
流動負債合計	145,493,917	87,826,686
負債合計		
145,493,917		
純資産の部		
元本等		
元本	17,017,756,688	16,823,343,930
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,305,805,459	7,785,018,676
元本等合計	25,323,562,147	24,608,362,606
純資産合計		
25,323,562,147		
負債純資産合計		
25,469,056,064		

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
1.	期首	平成28年10月27日	平成29年10月27日
	期首元本額	16,161,520,366円	17,017,756,688円
	期首からの追加設定元本額	2,025,600,511円	1,122,522,227円
	期首からの一部解約元本額	1,169,364,189円	1,316,934,985円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	1,722,524,172円	2,098,854,047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）	829,022,417円	1,183,255,079円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,513,075円	4,492,130円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,583,606円	4,928,627円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	10,423,389円	12,564,634円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	22,994,774円	21,827,881円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	13,495,765,160円	12,532,569,503円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	85,959,303円	90,510,867円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	124,140,206円	131,366,819円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	123,932,091円	129,222,482円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	92,931,619円	97,118,078円
インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	500,966,876円	516,633,783円
計	17,017,756,688円	16,823,343,930円
2. 受益権の総数	17,017,756,688口	16,823,343,930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 平成28年10月27日 至 平成29年10月26日	自 平成29年10月27日 至 平成30年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年10月26日現在	平成30年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成29年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,090,416,133
合計	1,090,416,133

（平成30年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	769,222,652
合計	769,222,652

(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)

（平成29年10月26日現在）

（単位：円）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	25,330,679,092	-		25,429,566,170	98,887,078
	米ドル	10,763,362,410	-		10,859,095,220	95,732,810
	加ドル	528,688,030	-		523,358,090	5,329,940
	メキシコペソ	229,535,042	-		222,652,810	6,882,232
	ユーロ	10,424,444,500	-		10,441,946,740	17,502,240
	英ポンド	1,741,030,763	-		1,742,425,200	1,394,437
	スイスフラン	36,833,797	-		36,655,230	178,567
	スウェーデンクローナ	193,707,955	-		193,052,970	654,985
	ノルウェークローネ	80,787,933	-		80,042,750	745,183
	デンマーククローネ	168,256,068	-		169,863,900	1,607,832
	ポーランドズロチ	159,361,282	-		160,813,410	1,452,128
	豪ドル	567,807,419	-		562,156,270	5,651,149
	シンガポールドル	59,054,952	-		59,121,160	66,208
	マレーシアリンギット	219,268,421	-		225,603,190	6,334,769
南アフリカランド	158,540,520	-		152,779,230	5,761,290	
合計		25,330,679,092	-		25,429,566,170	98,887,078

(平成30年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	24,558,872,960	-		24,329,653,640	229,219,320
	米ドル	10,966,235,039	-		10,965,771,870	463,169
	加ドル	459,678,639	-		467,942,660	8,264,021
	メキシコペソ	205,498,855	-		204,640,020	858,835
	ユーロ	9,811,796,484	-		9,603,928,590	207,867,894
	英ポンド	1,640,076,901	-		1,632,914,200	7,162,701
	スウェーデンクローナ	151,195,334	-		149,079,540	2,115,794
	ノルウェークローネ	73,886,258	-		73,140,870	745,388

	デンマーククローネ	161,826,504	-	159,759,390	2,067,114
	ポーランドズロチ	119,597,310	-	115,427,450	4,169,860
	豪ドル	520,463,981	-	511,688,540	8,775,441
	シンガポールドル	81,104,893	-	80,668,020	436,873
	マレーシアリンギット	232,876,513	-	232,294,470	582,043
	南アフリカランド	134,636,249	-	132,398,020	2,238,229
	合計	24,558,872,960	-	24,329,653,640	229,219,320

(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)

平成29年10月26日現在		平成30年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4881円	1口当たり純資産額	1.4628円
(1万口当たり純資産額)	(14,881円)	(1万口当たり純資産額)	(14,628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-1.25%-19/10/31	600,000.00	591,457.20	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	550,000.00	553,727.35	
		US TREASURY N/B-1.0%-19/11/30	1,100,000.00	1,079,890.90	
		US TREASURY N/B-1.875%-19/12/31	1,800,000.00	1,782,176.40	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/01/31	2,500,000.00	2,457,520.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	1,400,000.00	1,414,847.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/02/29	2,600,000.00	2,552,368.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	800,000.00	784,359.20	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	1,200,000.00	1,174,711.20	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	800,000.00	808,375.20	
		US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	2,400,000.00	2,350,735.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	1,200,000.00	1,182,750.00	
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000.00	430,150.11	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	1,300,000.00	1,265,849.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,200,000.00	3,112,188.80	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	1,110,000.00	1,104,731.94	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,000,000.00	974,766.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,000,000.00	1,966,876.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,600,000.00	1,625,905.60	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	950,000.00	935,323.45	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	2,450,000.00	2,463,876.80	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	1,000,000.00	954,473.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	300,000.00	294,744.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	2,420,000.00	2,368,858.14	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	700,000.00	684,482.40	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000.00	1,113,681.25	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,500,000.00	1,460,068.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,050,000.00	1,990,222.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	2,700,000.00	2,596,060.80	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,350,000.00	2,255,586.40	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,550,000.00	2,428,676.10			
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	1,000,000.00	960,059.00			

US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	1,700,000.00	1,630,439.40	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,100,000.00	1,059,480.40	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	1,600,000.00	1,522,281.60	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	700,000.00	672,793.10	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,050,000.00	1,943,816.15	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	600,000.00	558,281.40	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	580,000.00	664,904.46	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	1,000,000.00	978,848.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,440,000.00	1,424,419.20	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,780,000.00	1,758,723.66	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,168,827.60	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	2,830,000.00	2,732,387.64	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,000,000.00	2,870,391.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	850,000.00	799,132.60	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	1,900,000.00	1,795,648.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,400,000.00	2,165,344.80	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	4,300,000.00	3,965,068.70	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	700,000.00	656,304.60	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,330,000.00	1,643,302.78	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,200,000.00	2,979,875.20	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	247,898.49	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	489,656.40	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	456,421.68	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	197,485.60	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	403,322.40	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	116,414.10	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	450,000.00	541,503.00	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	268,111.69	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	380,898.35	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	233,601.60	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	213,718.80	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	338,850.75	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	400,000.00	386,976.40	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	700,000.00	631,668.10	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	900,000.00	867,568.50	

		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	750,000.00	691,377.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	890,000.00	932,431.64	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	213,777.40	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	550,000.00	576,414.85	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	120,679.68	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,150,000.00	1,081,494.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,400,000.00	2,044,922.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	422,824.05	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	641,771.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	187,746.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,150,000.00	975,523.15	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	950,000.00	761,577.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	274,277.40	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,550,000.00	1,378,712.60	
米ドル小計			99,550,000.00	96,787,392.16	(10,885,677,996)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	108,285.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	700,000.00	693,434.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000.00	764,527.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	200,000.00	194,478.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	700,000.00	715,974.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	759,750.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	150,000.00	214,108.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	625,771.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	710,000.00	973,488.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	251,558.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	100,000.00	119,689.00	
加ドル小計			4,840,000.00	5,421,063.30	(465,940,390)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	8,500,000.00	8,216,671.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000.00	5,987,326.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	5,421,677.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	6,049,371.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,370,145.37	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	4,499,291.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	2,000,000.00	1,844,508.00	
メキシコペソ小計			34,500,000.00	34,388,991.99	(198,424,483)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	450,000.00	487,282.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	200,000.00	227,257.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	350,000.00	401,655.45	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	420,000.00	465,156.30	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	350,000.00	398,035.75	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	150,000.00	155,338.50	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000.00	546,060.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	150,000.00	148,673.85	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	231,751.48	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	402,661.94	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	550,000.00	831,071.45	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	220,000.00	318,469.80	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	80,000.00	82,644.56	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	300,000.00	306,402.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	400,000.00	425,533.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	620,000.00	681,477.77	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	650,000.00	739,830.13	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	700,000.00	829,189.41	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,200,000.00	1,453,206.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	500,000.00	520,350.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	400,000.00	494,542.16			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	800,000.00	1,074,610.40			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	650,000.00	863,450.25			

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	930,000.00	1,315,883.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	780,000.00	1,013,474.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	400,000.00	558,666.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	150,000.00	223,771.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	150,000.00	158,007.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	100,000.00	111,898.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	450,000.00	471,609.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	800,000.00	849,968.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	250,000.00	263,570.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	550,000.00	587,968.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	250,000.00	275,742.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	300,000.00	323,865.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	300,000.00	321,914.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	500,000.00	539,193.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	500,000.00	540,578.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	200,000.00	221,584.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	570,000.00	760,752.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	900,000.00	981,209.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	250,000.00	265,769.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	500,000.00	516,434.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	500,000.00	532,958.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	650,000.00	669,342.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	200,000.00	200,588.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	400,000.00	407,995.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	560,000.00	832,056.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	200,000.00	284,365.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	350,000.00	573,049.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	220,000.00	350,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	260,000.00	402,150.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	250,000.00	412,505.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	190,000.00	337,615.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	150,000.00	225,286.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	300,000.00	405,117.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	350,000.00	478,275.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	1,100,000.00	1,146,151.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	750,000.00	780,759.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	400,000.00	417,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	200,000.00	208,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,580,000.00	1,648,854.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	800,000.00	867,190.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	750,000.00	830,439.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	950,000.00	1,023,009.97	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	600,000.00	653,946.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	553,591.03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	200,000.00	207,735.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	450,000.00	499,218.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,250,000.00	1,356,552.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	200,000.00	181,240.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	400,000.00	494,420.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	650,000.00	722,823.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	750,000.00	865,413.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	650,000.00	800,647.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	303,901.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	250,000.00	285,735.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	560,000.00	574,893.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	600,000.00	682,323.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	500,000.00	566,146.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	150,000.00	165,621.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	500,000.00	446,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	250,000.00	196,726.25	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000.00	370,584.55	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	107,334.40	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	249,970.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	150,000.00	180,164.70	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	131,360.70	

FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	770,000.00	803,458.81	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	700,000.00	742,689.29	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	430,000.00	456,036.50	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	530,000.00	585,731.62	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	500,000.00	554,331.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	350,000.00	390,159.00	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	1,500,000.00	1,646,162.85	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	200,000.00	277,506.00	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	850,000.00	921,181.97	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	1,150,000.00	1,395,873.45	
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	650,000.00	727,468.30	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	350,000.00	383,069.75	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	400,000.00	405,988.76	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	950,000.00	1,324,486.20	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	800,000.00	836,255.20	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	400,000.00	492,774.96	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	950,000.00	1,129,453.10	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	490,000.00	724,785.36	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	150,000.00	176,667.10	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	600,000.00	971,814.60	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	730,000.00	1,126,597.32	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,010,000.00	1,490,193.89	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	250,000.00	399,608.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	450,000.00	617,961.60	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	320,000.00	516,450.24	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	200,000.00	330,612.00	
IRISH TREASURY -4.5%-20/04/18	600,000.00	644,065.80	
IRISH TREASURY -3.9%-23/03/20	200,000.00	233,946.30	
IRISH TREASURY -5.4%-25/03/13	300,000.00	392,456.43	
IRISH TREASURY -2.4%-30/05/15	100,000.00	113,132.05	
IRISH TREASURY -2.0%-45/02/18	200,000.00	209,229.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.5%-20/07/15	300,000.00	321,578.16	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.25%-21/07/15	300,000.00	330,897.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT -3.75%-23/01/15	270,000.00	316,025.82	
NETHERLANDS GOVERNMENT -1.75%-23/07/15	150,000.00	163,545.30	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	450,000.00	501,234.75	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	151,010.62	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	200,000.00	203,433.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	620,000.00	905,736.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	350,000.00	535,059.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	150,000.00	237,205.65	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	100,000.00	140,973.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	250,000.00	278,627.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	350,000.00	381,631.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	350,000.00	382,309.55	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	733,238.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	298,254.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	350,000.00	525,026.56	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	150,000.00	210,312.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	137,394.00	
	ユーロ小計		61,830,000.00	73,791,491.18 (9,432,766,317)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.75%-20/03/07	390,000.00	411,252.38	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	350,000.00	357,647.36	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	570,000.00	676,416.43	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	300,000.00	325,087.20	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	600,000.00	619,170.00	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	800,000.00	875,360.00	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	200,000.00	198,610.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	187,917.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	270,000.00	387,995.21	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	350,000.00	474,673.50	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	430,000.00	568,020.54	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	400,000.00	554,808.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	260,000.00	356,935.80	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	254,629.40	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	300,000.00	431,155.80	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	620,000.00	938,153.00	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	500,000.00	636,690.00	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	450,000.00	682,690.50	

		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	924,529.20	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	654,070.40	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	466,012.20	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	300,000.00	316,800.00	
英債券小計			8,670,000.00	11,298,623.92	(1,629,374,555)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	2,100,000.00	2,340,034.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	1,950,000.00	2,204,744.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	2,500,000.00	2,678,760.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	1,850,000.00	2,116,521.36	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,564,326.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	977,130.00	
スウェーデンクローナ小計			10,600,000.00	11,881,516.41	(146,617,912)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	1,400,000.00	1,487,004.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,426,727.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	480,700.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	999,285.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	977,476.00	
ノルウェークローネ小計			5,250,000.00	5,371,194.20	(72,349,985)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000.00	1,888,655.40	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	2,450,000.00	2,710,853.46	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	558,132.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	3,949,120.24	
デンマーククローネ小計			7,050,000.00	9,106,761.60	(155,998,826)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,000,000.00	1,072,100.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,132,450.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	800,000.00	819,520.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	800,000.00	771,120.00	
ポーランドズロチ小計			3,600,000.00	3,795,190.00	(112,527,383)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	1,000,000.00	1,036,374.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000.00	1,059,979.33	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	300,000.00	339,094.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	342,346.74	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	900,000.00	920,749.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	200,000.00	210,319.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	180,000.00	201,850.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	800,000.00	934,709.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	250,000.00	264,499.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	613,027.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	440,734.69	
豪ドル小計			5,900,000.00	6,363,685.60	(506,231,189)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	300,000.00	299,075.84	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	100,320.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	429,800.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	145,650.00	
シンガポールドル小計			950,000.00	974,845.84	(79,371,948)
マレーシアリングgit	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	1,000,000.00	1,010,906.10	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	500,497.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	1,400,000.00	1,413,832.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,000,000.00	1,013,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	591,580.88	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,279,994.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	600,000.00	572,481.39	
マレーシアリングgit小計			7,350,000.00	7,382,292.52	(199,026,606)
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%-20/01/15	1,500,000.00	1,509,129.67	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	6,000,000.00	6,379,763.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-36/03/31	2,100,000.00	1,443,136.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%-37/01/31	2,000,000.00	1,718,491.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-48/02/28	6,550,000.00	5,612,407.12	
			18,150,000.00	16,662,927.99	

南アフリカランド小計		(128,304,545)	
合計		24,012,612,135	(24,012,612,135)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 81銘柄	100.0%	45.5%
加ドル	国債証券 11銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 138銘柄	100.0%	39.3%
英ポンド	国債証券 22銘柄	100.0%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 11銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
マレーシアリングット	国債証券 7銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年10月31日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)】

【純資産額計算書】

資産総額	632,659,393円
負債総額	403,726円
純資産総額(-)	632,255,667円
発行済口数	449,419,768口
1口当たり純資産額(/)	1.4068円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	29,841,411,379円
負債総額	714,869,361円
純資産総額(-)	29,126,542,018円
発行済口数	19,578,425,662口
1口当たり純資産額(/)	1.4877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	91,552,008,030円
負債総額	101,339,209円
純資産総額(-)	91,450,668,821円
発行済口数	38,219,446,200口
1口当たり純資産額(/)	2.3928円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	6,893,868,633円
負債総額	89,689,402円
純資産総額（ - ）	6,804,179,231円
発行済口数	4,343,832,068口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5664円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	38,518,187,903円
負債総額	114,091,237円
純資産総額（ - ）	38,404,096,666円
発行済口数	27,710,561,666口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3859円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	148,297,809,695円
負債総額	144,028,561円
純資産総額（ - ）	148,153,781,134円
発行済口数	66,223,440,730口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2372円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	24,784,492,963円
負債総額	103,763,422円
純資産総額（ - ）	24,680,729,541円
発行済口数	16,840,609,767口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4655円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2018年10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（2018年10月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役・監査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。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後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、代表取締役若干名を選定します。

・監査役会

当社の監査役会は5名以内の監査役で構成され、監査役の任期は選任後4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を任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2018年10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、2018年10月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	809	173,268

株式投資信託	766	147,679
単位型	244	8,771
追加型	522	138,907
公社債投資信託	43	25,589
単位型	29	541
追加型	14	25,047

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	(単位：百万円)			
	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	16,761	3	14,024
金銭の信託	3	152		-
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	3	2,799	3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	2,3	385	2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	93	1	68
器具備品	1	190	1	122
有形固定資産合計		283		191
無形固定資産				
ソフトウェア		138		99

無形固定資産合計	138	99
投資その他の資産		
投資有価証券	11,783	14,103
関係会社株式	23,203	25,769
関係会社長期貸付金	60	-
長期差入保証金	782	490
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	3	589	3	3,804
未払金		4,043		5,874
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		91
未払手数料	3	3,499	3	5,124
その他未払金		445		651
未払費用	3	4,229	3	4,634
未払法人税等		1,808		2,185
未払消費税等	4	538	4	788
賞与引当金		2,077		2,286
役員賞与引当金		168		198
その他	3	62		41
流動負債合計		13,517		19,813
固定負債				
退職給付引当金		1,259		1,316
その他		-		318
固定負債合計		1,259		1,634
負債合計		14,777		21,448
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		34,015		39,959
利益剰余金合計		34,015		39,959
自己株式		672		786

株主資本合計	55,926	61,756
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511
負債純資産合計	71,252	83,959

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355
退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175
一般管理費計	14,394	15,664

営業利益	6,380	9,526
------	-------	-------

(単位：百万円)

	第58期		第59期	
	(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)		(自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	
営業外収益				
受取利息		19		26
受取配当金	1	1,644	1	1,120
有価証券償還益		-		1
時効成立分配金・償還金		22		1
為替差益		177		79
その他		36		41
営業外収益合計		1,899		1,272
営業外費用				
支払利息	1	223	1	223
有価証券償還損		7		-
デリバティブ費用	1	146	1	295
時効成立後支払分配金・償還金		2		0
支払源泉所得税		155		-
長期差入保証金償却額		-		212
その他		73		34
営業外費用合計		608		767
経常利益		7,670		10,030
特別利益				
投資有価証券売却益		174		199
特別利益合計		174		199
特別損失				
投資有価証券売却損		120		133
固定資産処分損		13		7
役員退職一時金		-		117
損害賠償損失		-		81
特別損失合計		134		340
税引前当期純利益		7,710		9,890
法人税、住民税及び事業税		2,137		3,217
過年度法人税等	2	115		-
法人税等調整額		104		307
法人税等合計		2,147		2,910
当期純利益		5,562		6,979

(3) 【株主資本等変動計算書】

第58期（自 平成28年 4月 1日 至 平成29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	資本剰余	その他利益剰余金	利益剰余金		

		準備金	金合計	繰越利益 剰余金	合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						170	170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				1,495
当期純利益				5,562
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						自己株式	株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				
		資本 準備金	資本剰余 金合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926	
当期変動額								
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036	
当期純利益				6,979	6,979		6,979	
自己株式の取得						113	113	
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）								
当期変動額合計				5,943	5,943	113	5,830	
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756	

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額 金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	282	266	548	56,475

当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30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 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(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>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 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 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 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 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>
<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</p>	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(貸借対照表関係)

第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,260百万円</p> <p>器具備品 612百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,243百万円</p> <p>金銭の信託 152百万円</p> <p>未収収益 619百万円</p> <p>その他 20百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 177百万円</p> <p>未払手数料 144百万円</p> <p>未払費用 251百万円</p> <p>その他 61百万円</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,189百万円</p> <p>未収収益 592百万円</p> <p>その他 345百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 419百万円</p> <p>未払手数料 376百万円</p> <p>未払費用 677百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務546百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。	1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 1,550百万円	受取配当金 979百万円
デリバティブ収益 347百万円	デリバティブ収益 407百万円
支払利息 58百万円	支払利息 213百万円
2 過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。	

(株主資本等変動計算書関係)

第58期(自平成28年4月1日至平成29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)	814,100	305,000	-	1,119,100

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	1,762,200	-	72,600	1,689,600	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	1,848,000	2,890,800	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	33,000	4,404,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	-

(注)1 平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,890,800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、平成28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いません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年5月30日取締役会	普通株式	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年5月25日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30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）	1,119,100	182,600	-	1,301,700

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
平成28年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

(注) 1 平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2)108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,686,200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、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(リース取引関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
オペレーティング・リース取引	オペレーティング・リース取引

解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円	1年内	866百万円
1年超	1,787百万円	1年超	923百万円
合計	2,653百万円	合計	1,790百万円

（金融商品関係）

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損

益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ペースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

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

平成29年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	16,761	16,761	-
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	-
(3) 未収収益	2,799	2,799	-
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,777	11,777	-
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	-
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	-
(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	35	35	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	-
デリバティブ取引計	34	34	-

(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うち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万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うち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万円は流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及

び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

- 3 子会社株式（貸借対照表計上額20,310百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	16,761	-	-	-
未収委託者報酬	10,757	-	-	-
未収収益	2,799	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735
合計	30,328	616	907	735

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、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、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

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

平成30年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-
(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(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	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

(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うち8百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万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、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

（有価証券関係）

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	20,310
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	6,299	5,590	708
	小計	6,299	5,590	708
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	5,478	5,780	302
	小計	5,478	5,780	302
合計		11,777	11,370	406

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

(デリバティブ取引関係)

第58期(平成29年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,729	-	35	35
	買建	-	-	-	-
合計		1,729	-	35	35

(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 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資	2,993	-	11
	豪ドル	有価証券	77	-	2
	シンガポールドル		1,639	-	20
	香港ドル		205	-	2
	人民元		1,946	-	6
	ユーロ		57	-	0
合計			6,920	-	1

(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59期(平成30年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,422	-	14	14
	買建	-	-	-	-
合計		2,422	-	14	14

(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 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資 有価証券			
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポールドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
	合計		9,192	-	336

(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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,030	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827

(退職給付関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	190
退職給付の支払額	72
退職給付債務の期末残高	1,190

(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	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69

貸借対照表に計上された負債の額	1,259
-----------------	-------

退職給付引当金	1,259
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,259
-----------------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	23
----------------	----

確定給付制度に係る退職給付費用	177
-----------------	-----

(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、213百万円でありました。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	1,190
-------------	-------

勤務費用	130
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	66
--------------	----

退職給付の支払額	76
----------	----

退職給付債務の期末残高	1,313
-------------	-------

(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	1,313
--------	-------

未積立退職給付債務	1,313
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	2
-------------	---

貸借対照表に計上された負債の額	1,316
-----------------	-------

退職給付引当金	1,316
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,316
-----------------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	0
----------------	---

確定給付制度に係る退職給付費用	132
-----------------	-----

(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、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24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	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	平成25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。	平成30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	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31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

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	174,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	-
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
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

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22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

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28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
-----------------------------	---	---

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 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59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24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	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	平成25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。	平成30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	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31日まで

	平成28年度ストックオプション(2)
--	--------------------

付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員	31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
付与日	平成29年4月27日	
権利確定条件	平成31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	
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39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

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
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

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22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

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28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

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 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58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金 641		賞与引当金 700
	その他 224		その他 314
	小計 865		小計 1,014
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損 96		投資有価証券評価損 96
	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 385		退職給付引当金 402
	固定資産減価償却費 119		固定資産減価償却費 111
	その他 63		その他 211
	小計 2,095		小計 2,253
	繰延税金資産小計 2,961		繰延税金資産小計 3,268
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,530		繰延税金資産合計 1,838
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 0		その他有価証券評価差額金 -
	小計 0		小計 -
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 123		その他有価証券評価差額金 180
	繰延ヘッジ利益 117		繰延ヘッジ利益 152
	小計 241		小計 333
	繰延税金負債合計 242		繰延税金負債合計 333
	繰延税金資産の純額 1,288		繰延税金資産の純額 1,504
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 30.9% (調整)		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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%		
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.3%		
	過年度法人税等 1.5%		
	海外子会社の留保利益の影響額等 0.2%		
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.9%		

(関連当事者情報)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	312,000 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル貨建) (注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社 短期貸付 金	385 (SGD 4,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	4,422 (注4)	関係会社 短期貸付 金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	3	未収収益	3
							-	増資の 引受 (注5)	1,501 (SGD 20,000 千)	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入 (米ドル貨建) (注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社 短期借入 金	-
							借入金利息 (米ドル貨建) (注7)	48 (USD 453 千)	未払費用	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額65百万円 (SGD800千) の内訳は、貸付505百万円 (SGD6,600千) 及び返済439百万円 (SGD5,800千) であります。
- 融資枠5,000百万円、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。
- 資金の貸付に係る取引金額 4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。
- 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の借入に係る取引金額 5,549百万円 (USD 50,000千) は、返済であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成28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	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円

営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	159 (SGD 2,000千)(注2)	関係会社短期貸付金	550 (SGD 6,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13 (SGD 162千)	未収収益	8 (SGD 110千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	12	未収収益	3
						-	増資の引受(注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受(注5)	100	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。
- 融資枠5,000百万円、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 Asset Management International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引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）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成29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	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	288円29銭	319円40銭
1株当たり当期純利益金額	28円38銭	35円64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いません。

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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	5,562	6,979
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)	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,009	195,794
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	平成21年度ストックオプション(1) 1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株	平成21年度ストックオプション(1) 1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,686,200株、平成28年度ストックオプション(1) 3,618,000株、平成28年度ストックオプション(2) 3,877,000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58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	56,475	62,511
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)	56,475	62,511
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)	195,893	195,711

(重要な後発事象)

新株予約権(ストックオプション)の付与

当社は平成30年3月15日付の臨時株主総会及び平成30年3月20日開催の取締役会の決議に基づき、平成30年4月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員36名に付与いたしました。

新株予約権の数	4,422個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 4,422,000株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金694円
新株予約権の行使期間	平成32年4月27日から平成40年4月30日まで

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

第60期中間会計期間 (2018年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	24,039
有価証券	19
未収委託者報酬	14,192
未収収益	920
関係会社短期貸付金	743
その他	2
流動資産合計	42,379

固定資産		
有形固定資産	1	160
無形固定資産		96
投資その他の資産		
投資有価証券		11,639
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		463
繰延税金資産		1,450
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,324
固定資産合計		39,580
資産合計		81,960

(単位：百万円)

第60期中間会計期間
(2018年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		6,326
未払費用		3,919
未払法人税等		1,899
未払消費税等	3	627
賞与引当金		1,452
役員賞与引当金		60
その他		548
流動負債合計		14,835

固定負債

退職給付引当金		1,355
その他		450
固定負債合計		1,805

負債合計

16,640

純資産の部

株主資本

資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		42,692
利益剰余金合計		42,692

自己株式 833

株主資本合計 64,442

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		729
繰延ヘッジ損益		147

評価・換算差額等合計	876
純資産合計	65,319
負債純資産合計	81,960

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第60期中間会計期間
(自 2018年4月1日
至 2018年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		40,168
その他営業収益		1,608
営業収益合計		41,776
営業費用及び一般管理費	1	36,000
営業利益		5,776
営業外収益	2	842
営業外費用	3	441
経常利益		6,177
特別利益	4	98
特別損失	5	144
税引前中間純利益		6,131
法人税等	6	1,758
中間純利益		4,373

(3) 中間株主資本等変動計算書

第60期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
中間純利益				4,373	4,373		4,373
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計				2,733	2,733	47	2,685
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	42,692	42,692	833	64,442

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	

当期首残高	408	346	754	62,511
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,640
中間純利益				4,373
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	321	198	122	122
当中間期変動額合計	321	198	122	2,808
当中間期末残高	729	147	876	65,319

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(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>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</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> <p>(1) ヘッジ会計の方法 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 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 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 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>
<p>5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1)消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2)税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

（表示方法の変更）

<p>第60期中間会計期間 (自 2018年 4月 1日 至 2018年 9月30日)</p>
<p>（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用） 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年 2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。</p>

（中間貸借対照表関係）

<p>第60期中間会計期間 (2018年 9月30日)</p>
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,899百万円</p> <p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>

4 保証債務

当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務516百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務36百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	34百万円
無形固定資産	19百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	13百万円
受取配当金	824百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	181百万円
デリバティブ費用	165百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	98百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	144百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第60期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,301,700	64,000	-	1,365,700

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	108,900	1,386,000	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	-	108,900	-

2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	287,100	2,399,100	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	-	3,877,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	-	4,422,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	396,000	15,811,000	-

(注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 2009年度ストックオプション(1)及び2011年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 2009年度ストックオプション(1)1,386,000株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,399,100株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	866百万円
1年超	7,125百万円
合計	7,991百万円

(金融商品関係)

第60期中間会計期間(2018年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

2018年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,039	24,039	-
(2) 未収委託者報酬	14,192	14,192	-
(3) 未収収益	920	920	-
(4) 関係会社短期貸付金	743	743	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	11,642	11,642	-
(6) 未払金	(6,326)	(6,326)	-
(7) 未払費用	(3,919)	(3,919)	-
(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	(190)	(190)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	29	29	-
デリバティブ取引計	(160)	(160)	-

(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は、貸借対照表上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37百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、8百万円は、流動負債のその他に含まれております。

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

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

(有価証券関係)

第60期中間会計期間(2018年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 其他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が	投資信託	8,029	6,865	1,163

取得原価を超えるもの	小計	8,029	6,865	1,163
中間貸借対照表計上額が	投資信託	3,612	3,725	113
取得原価を超えないもの	小計	3,612	3,725	113
合計		11,642	10,591	1,050

(注) 1 減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。

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

(デリバティブ取引関係)

第60期中間会計期間(2018年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,572	-	190	190
	合計	2,572	-	190	190

(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 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,752	-	2
	豪ドル		62	-	1
	シンガポールドル		955	-	5
	ユーロ		79	-	0
	香港ドル		586	-	7
	人民元		2,020	-	28
	合計		6,456	-	29

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,011百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,743百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	848百万円

(ストックオプション等関係)

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

当中間会計期間において、ストックオプションを付与しておりますが、当該ストックオプションの付与による影響が当社の財政状態、経営成績等にとって重要でないと認められるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

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

[関連情報]

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
1株当たり純資産額	333円86銭
1株当たり中間純利益金額	22円34銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
中間純利益(百万円)	4,373
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	4,373
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,706
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1)1,386,000株、 2009年度ストックオプション(2)108,900株、 2011年度ストックオプション(1)2,399,100株、 2016年度ストックオプション(1)3,618,000株、 2016年度ストックオプション(2)3,877,000株、 2017年度ストックオプション(1)4,422,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期中間会計期間 (2018年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	65,319
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	65,319
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,647

(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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当

該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であつて、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 (2018年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社北九州銀行	10,000百万円	
株式会社きらやか銀行	22,700百万円	
株式会社第三銀行 1	37,461百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
株式会社琉球銀行	54,127百万円	
ソニー生命保険株式会社 1	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

1 募集の取扱いを行いません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15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

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
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

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平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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平成30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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

2. 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

平成30年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成29年10月27日から平成30年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成30年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月5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

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
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

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。