

## 【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2月6日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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】	DCインデックスバランス（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】

DCインデックスバランス（株式20）（以下「ファンド」といいます。）

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位

### （７）【申込期間】

2019年2月7日から2020年2月6日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 12 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<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。

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

# 2. インデックスファンドで構成しています。

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

## <国内株式>

### 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

## <海外株式>

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

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

## <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。

- ※**TOPIX(東証株価指数)**:TOPIXの指数値およびTOPIXの高標は、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の高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	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	10%
短期金融資産	5%

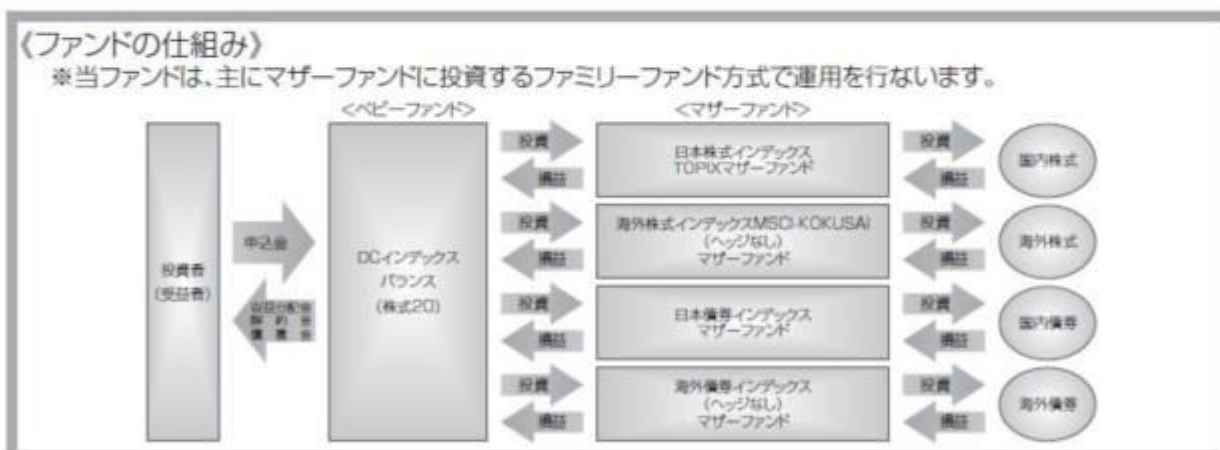
※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

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

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



#### 主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

#### 分配方針

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

#### 信託金限度額

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

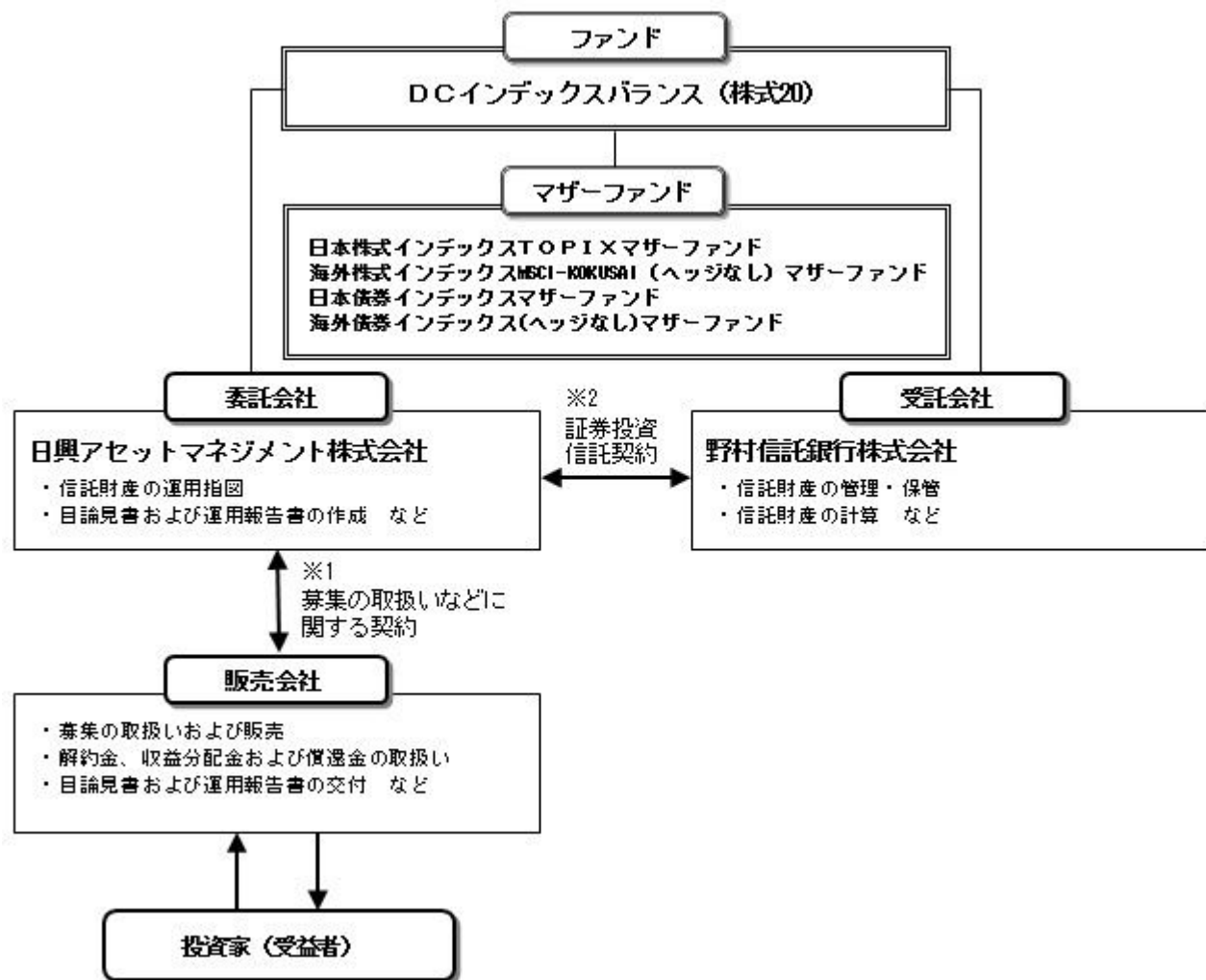
#### (2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2018年11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「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
  - 株式の標準実質組入比率.....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】

### <DCインデックスバランス(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「日本債券インデックスマザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

同じ。)で16)に定めるもの以外のもの

- 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

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

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引
- 10) 資金の借入

#### <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

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

#### <海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 先物取引等
    - 2) スワップ取引
    - 3) 金利先渡取引
    - 4) 為替先渡取引
    - 5) 有価証券の貸付
    - 6) 公社債の空売
    - 7) 公社債の借入
    - 8) 外国為替予約取引

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>

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

### ファンドに係る費用

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

### その他

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

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

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

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

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびコントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</li> <li>・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### < 日本債券インデックスマザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・ 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>



主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

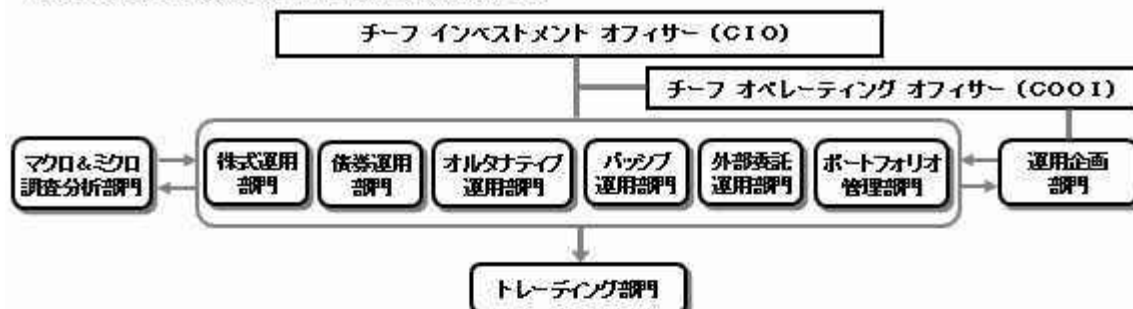
<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

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

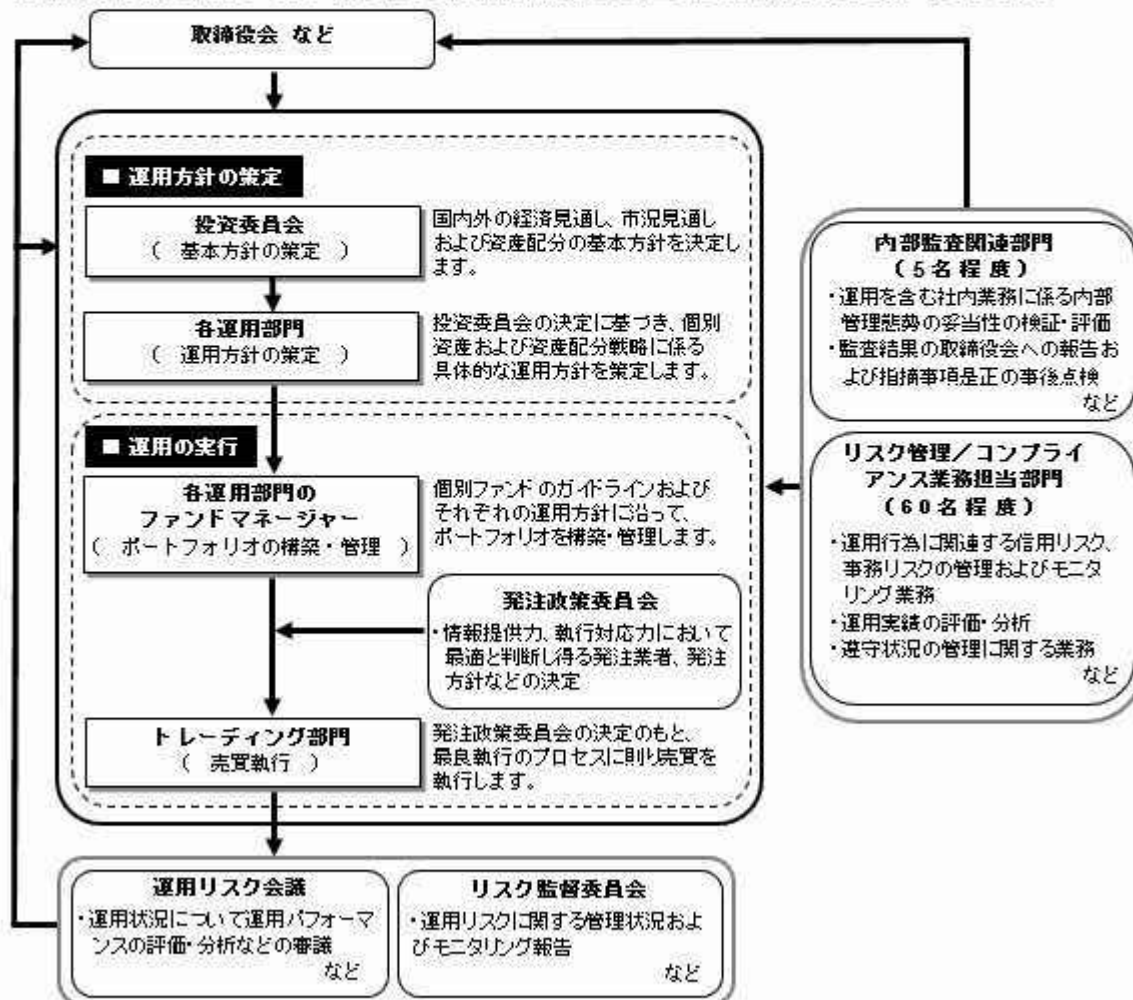
\* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### （3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は2018年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

##### 1) 分配対象額の範囲

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

##### 2) 分配対象額についての分配方針

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

##### 3) 留保益の運用方針

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

## 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

## &lt; DCインデックスバランス（株式20） &gt;

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

はありません。

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

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

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

図をすることができます。

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

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



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

< 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

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

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せん。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

### 価格変動リスク

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

### 流動性リスク

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

### 信用リスク

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

### 為替変動リスク

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

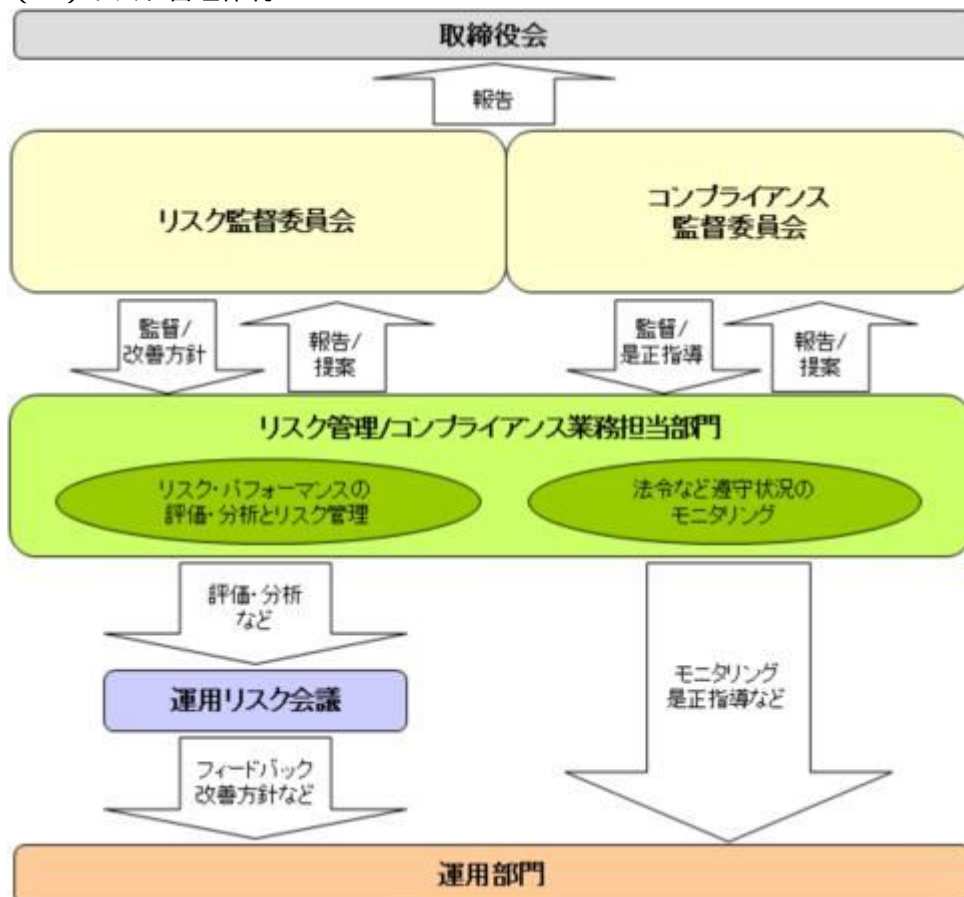
### < その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項  
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項  
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項  
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響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。

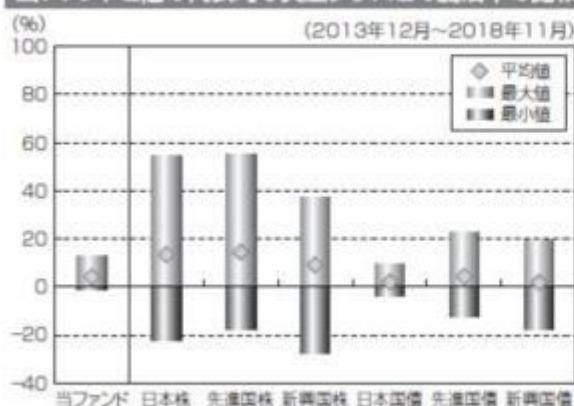
### 法令など遵守状況のモニタリング

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11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	4.1%	13.4%	14.5%	9.1%	2.0%	4.3%	1.8%
最大値	12.9%	54.4%	54.8%	37.2%	9.3%	22.7%	19.3%
最小値	-0.8%	-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12月から2018年11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)

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グローバルレディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

### 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

**MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）**

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

**NOMURA-BPI国債**

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

**FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）**

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

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

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

**4【手数料等及び税金】****（1）【申込手数料】**

ありません。

**（2）【換金（解約）手数料】**

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

**（3）【信託報酬等】**

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.1836%（税抜0.17%）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
0.17%	0.04%	0.10%	0.03%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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カ

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。

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

##### １）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

##### ２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

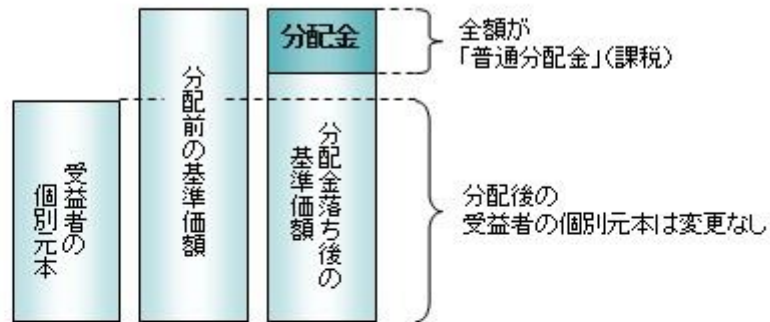
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

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

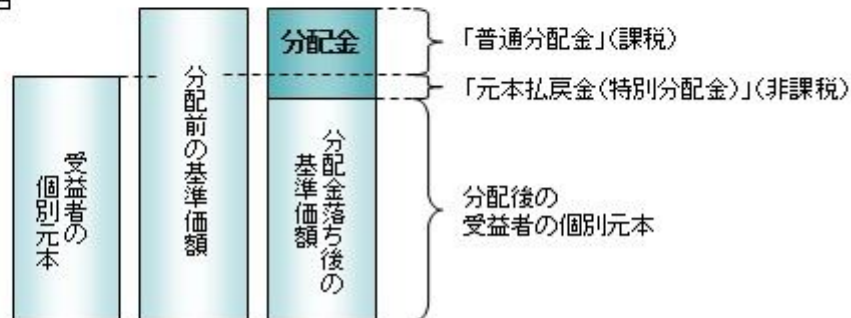


## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年2月6日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【DCインデックスバランス（株式20）】

以下の運用状況は2018年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	3,887,737,183	95.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		203,503,312	4.97
合計（純資産総額）		4,091,240,495	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	1,903,598,927	1.3850	2,636,663,685	1.3917	2,649,238,626	64.75

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	411,385,572	1.4991	616,730,425	1.5074	620,122,611	15.16
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	181,070,299	2.2425	406,064,900	2.2575	408,766,199	9.99
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	85,624,897	2.4451	209,368,228	2.4480	209,609,747	5.12

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.03
合計	95.03

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第7計算期間末 (2009年11月 6日)	658	659	1.1229	1.1239
第8計算期間末 (2010年11月 8日)	730	731	1.1402	1.1412
第9計算期間末 (2011年11月 7日)	812	813	1.1301	1.1311
第10計算期間末 (2012年11月 6日)	907	908	1.1621	1.1631
第11計算期間末 (2013年11月 6日)	1,087	1,088	1.3288	1.3298
第12計算期間末 (2014年11月 6日)	1,377	1,378	1.4209	1.4219
第13計算期間末 (2015年11月 6日)	1,596	1,597	1.4811	1.4821
第14計算期間末 (2016年11月 7日)	1,897	1,898	1.4739	1.4749
第15計算期間末 (2017年11月 6日)	2,786	2,788	1.5734	1.5744
第16計算期間末 (2018年11月 6日)	3,972	3,975	1.5529	1.5539
2017年11月末日	2,825		1.5703	
12月末日	2,914		1.5787	
2018年 1月末日	2,926		1.5765	
2月末日	2,966		1.5644	
3月末日	3,002		1.5587	
4月末日	3,093		1.5715	
5月末日	3,300		1.5661	



6月末日	3,479		1.5674
7月末日	3,620		1.5730
8月末日	3,750		1.5666
9月末日	3,908		1.5817
10月末日	3,967		1.5506
11月末日	4,091		1.5599

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.75
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	1.63
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.80
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	2.92
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	14.43
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	7.01
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	4.31
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.42
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	6.82
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1.24

(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7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	112,641,207	50,706,866
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	113,017,851	58,786,346
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	116,169,305	38,356,384
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	147,565,250	85,574,433
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	176,253,275	138,405,358
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	252,432,163	101,614,168
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	268,579,632	160,353,535
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	366,937,574	157,154,931
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	810,944,162	327,224,124
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1,143,786,634	356,834,525

（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11月30日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	29,565,357,940	99.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		285,742,104	0.96
合計（純資産総額）		29,851,100,044	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	283,560,000	0.95

（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	139,600	6,536.11	912,441,640	6,803.00	949,698,800	3.18
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	860,300	653.28	562,024,210	624.50	537,257,350	1.80
日本	株式	ソニー	電気機器	84,000	5,837.09	490,315,600	5,937.00	498,708,000	1.67

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	51,400	8,632.18	443,694,227	9,526.00	489,636,400	1.64
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	84,100	4,881.44	410,529,184	4,680.00	393,588,000	1.32
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,100	51,599.16	314,754,900	61,600.00	375,760,000	1.26
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	87,100	4,249.27	370,111,928	4,183.00	364,339,300	1.22
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	105,700	2,982.69	315,270,960	3,202.00	338,451,400	1.13
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,678,300	188.67	316,648,930	188.30	316,023,890	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	108,400	2,829.37	306,704,200	2,664.00	288,777,600	0.97
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	85,700	2,848.16	244,087,500	3,123.00	267,641,100	0.90
日本	株式	任天堂	その他製品	7,700	34,817.79	268,097,000	34,610.00	266,497,000	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	86,500	3,156.34	273,023,900	3,062.00	264,863,000	0.89
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,200	21,089.29	236,200,100	23,325.00	261,240,000	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	51,700	4,770.80	246,650,600	4,943.00	255,553,100	0.86
日本	株式	花王	化学	30,400	7,271.60	221,056,936	8,358.00	254,083,200	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	44,800	5,158.99	231,122,881	5,605.00	251,104,000	0.84
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	88,300	2,879.44	254,255,300	2,628.50	232,096,550	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	11,900	17,729.70	210,983,500	19,390.00	230,741,000	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	22,300	9,541.09	212,766,500	10,320.00	230,136,000	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	15,100	13,731.31	207,342,900	15,120.00	228,312,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	13,100	15,608.32	204,469,000	17,315.00	226,826,500	0.76
日本	株式	信越化学工業	化学	21,600	8,492.91	183,446,900	10,135.00	218,916,000	0.73
日本	株式	キヤノン	電気機器	67,400	3,206.48	216,117,100	3,220.00	217,028,000	0.73
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,100	12,634.62	216,052,100	12,610.00	215,631,000	0.72
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	49,400	4,374.62	216,106,600	4,255.00	210,197,000	0.70
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	72,600	2,906.91	211,042,350	2,823.50	204,986,100	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	115,500	1,743.12	201,330,566	1,744.50	201,489,750	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	125,200	1,311.95	164,257,000	1,498.00	187,549,600	0.63
日本	株式	日立製作所	電気機器	56,400	3,258.88	183,800,864	3,288.00	185,443,200	0.62

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.31
		建設業	2.94
		食料品	4.34
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.26
		医薬品	5.18
		石油・石炭製品	0.75
		ゴム製品	0.82
		ガラス・土石製品	0.90

鉄鋼	0.99
非鉄金属	0.79
金属製品	0.59
機械	5.02
電気機器	12.88
輸送用機器	7.96
精密機器	1.82
その他製品	2.06
電気・ガス業	1.88
陸運業	4.55
海運業	0.17
空運業	0.59
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.48
卸売業	4.92
小売業	5.24
銀行業	6.63
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	2.38
その他金融業	1.20
不動産業	2.40
サービス業	4.80
合計	99.04

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	17	日本円	274,027,560	283,560,000	0.95

(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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
-------	------	---------	---------

出資金	アメリカ	8,237,371	0.01
株式	アメリカ	60,138,217,546	62.15
	カナダ	3,485,270,659	3.60
	モーリシャス	2,478,411	0.00
	ドイツ	3,158,369,920	3.26
	イタリア	623,094,829	0.64
	フランス	3,520,339,041	3.64
	オランダ	1,635,599,588	1.69
	スペイン	1,088,793,124	1.13
	ベルギー	340,966,720	0.35
	オーストリア	78,638,896	0.08
	ルクセンブルク	106,149,254	0.11
	フィンランド	416,055,409	0.43
	アイルランド	1,678,731,734	1.73
	ポルトガル	49,115,354	0.05
	イギリス	5,779,239,478	5.97
	スイス	3,364,850,521	3.48
	スウェーデン	840,023,266	0.87
	ノルウェー	266,475,969	0.28
	デンマーク	605,285,391	0.63
	ケイマン	224,731,538	0.23
	オーストラリア	2,202,006,687	2.28
	バミューダ	223,856,426	0.23
	ニュージーランド	79,350,161	0.08
	香港	983,614,407	1.02
	シンガポール	416,183,702	0.43
	イスラエル	188,065,931	0.19
	ジャージー	409,272,398	0.42
	英ヴァージン諸島	17,345,251	0.02
	アラブ首長国連邦	10,888,859	0.01
	マン島	17,534,080	0.02
	小計	91,950,544,550	95.02
投資証券	アメリカ	1,920,335,917	1.98
	カナダ	18,882,962	0.02
	フランス	113,650,037	0.12
	イギリス	62,654,082	0.06
	オーストラリア	190,832,739	0.20
	香港	56,381,144	0.06
	シンガポール	36,314,225	0.04
	小計	2,399,051,106	2.48
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,409,148,680	2.49
合計（純資産総額）		96,766,981,707	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	1,712,614,057	1.77
	買建	ドイツ	416,663,588	0.43

(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		1,686,338,000	1.74

(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	115,222	24,900.71	2,869,109,783	20,373.53	2,347,479,853	2.43
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	171,084	12,303.54	2,104,940,031	12,503.25	2,139,107,614	2.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	9,665	202,114.35	1,953,435,228	189,899.98	1,835,383,383	1.90
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,811	15,737.76	988,504,673	16,549.59	1,039,496,894	1.07
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	79,760	11,925.43	951,172,713	12,488.50	996,083,414	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	7,362	124,306.26	915,142,691	123,489.40	909,128,970	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	99,181	8,904.81	883,188,563	8,970.93	889,746,622	0.92
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	56,190	17,130.57	962,567,276	15,736.01	884,206,941	0.91
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	7,000	125,242.78	876,699,517	124,201.99	869,413,948	0.90
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	29,850	22,997.08	686,462,852	24,702.41	737,367,207	0.76
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	22,500	30,023.21	675,522,413	32,060.94	721,371,341	0.75
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	225,569	3,025.11	682,371,527	3,181.69	717,692,617	0.74
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	72,883	9,573.95	697,778,737	9,704.27	707,277,039	0.73
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	136,940	4,929.77	675,083,356	5,164.01	707,160,858	0.73

アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	108,390	5,891.57	638,587,904	6,131.91	664,638,679	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	41,822	15,961.72	667,551,242	15,783.67	660,104,939	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	96,567	6,408.09	618,810,094	6,745.79	651,420,848	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	58,879	10,107.37	595,112,094	10,532.28	620,130,432	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	44,741	12,698.95	568,163,926	13,485.90	603,373,077	0.62
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	110,090	5,169.38	569,098,090	5,371.66	591,367,128	0.61
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	109,102	5,044.79	550,397,210	5,412.51	590,516,648	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	169,907	3,406.40	578,771,760	3,468.77	589,369,647	0.61
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	62,963	7,959.23	501,137,541	8,840.44	556,621,109	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	27,000	20,350.33	549,459,078	19,932.14	538,167,785	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	94,602	5,289.13	500,362,717	5,557.76	525,775,268	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	50,743	9,732.10	493,836,256	10,292.00	522,247,159	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	12,952	41,309.62	535,042,228	38,870.28	503,447,908	0.52
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	21,700	23,187.11	503,160,478	22,315.01	484,235,721	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	107,474	4,075.34	437,993,762	4,472.98	480,729,848	0.50
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	16,438	26,717.46	439,181,682	28,953.37	475,935,660	0.49

## 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	6.36
		素材	4.28
		資本財	6.73
		商業・専門サービス	1.10
		運輸	2.02
		自動車・自動車部品	1.22
		耐久消費財・アパレル	1.63
		消費者サービス	1.88
		メディア・娯楽	2.06
		小売	4.83
		食品・生活必需品小売り	1.54

	食品・飲料・タバコ	4.82
	家庭用品・パーソナル用品	2.00
	ヘルスケア機器・サービス	4.99
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.64
	銀行	8.50
	各種金融	4.29
	保険	3.75
	不動産	0.53
	ソフトウェア・サービス	11.25
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.17
	電気通信サービス	2.50
	公益事業	3.18
	半導体・半導体製造装置	2.73
投資証券		2.48
合計		97.51

#### 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 EMINI 1812	買建	110	米ドル	14,766,875	1,675,597,306	15,093,100	1,712,614,057	1.77
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1812	買建	110	ユーロ	3,188,980	411,984,326	3,225,200	416,663,588	0.43

(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	12,350,000.00	1,389,271,450	1,395,732,500	1.44
	ユーロ	買建	2,250,000.00	289,993,620	290,605,500	0.30

(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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況



資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	30,127,846,688	77.81
地方債証券	日本	2,790,375,000	7.21
特殊債券	日本	3,105,347,000	8.02
社債券	日本	2,458,964,000	6.35
	オーストラリア	100,370,000	0.26
	小計	2,559,334,000	6.61
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		135,271,383	0.35
合計（純資産総額）		38,718,174,071	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	102.51	1,025,110,000	0.300	2025/12/20	2.65
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	100.65	613,965,000	100.92	615,648,600	0.100	2026/12/20	1.59
日本	国債証券	第124回利付国債（5年）	560,000,000	100.38	562,161,600	100.37	562,122,400	0.100	2020/6/20	1.45
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	450,000,000	118.75	534,379,500	119.10	535,950,000	1.700	2032/9/20	1.38
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	490,000,000	103.28	506,076,900	103.43	506,846,200	0.500	2024/9/20	1.31
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	505,000,000	100.33	506,686,700	100.31	506,600,850	0.100	2020/3/20	1.31
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	490,000,000	100.54	492,660,700	100.87	494,267,900	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	100.58	492,871,400	0.100	2027/12/20	1.27
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	480,000,000	100.13	480,667,200	100.46	482,217,600	0.100	2028/3/20	1.25
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	473,000,000	101.64	480,761,930	101.49	480,085,540	1.300	2019/12/20	1.24
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	435,000,000	100.04	435,204,450	100.28	436,235,400	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	103.13	433,183,800	0.400	2025/9/20	1.12
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	390,000,000	102.85	401,118,900	103.00	401,711,700	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	103.30	382,210,000	1.300	2021/3/20	0.99
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	370,000,000	102.89	380,711,500	103.09	381,433,000	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	133.74	369,133,440	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	117.66	352,992,000	2.300	2026/6/20	0.91
日本	国債証券	第113回利付国債（20年）	290,000,000	120.96	350,795,600	121.04	351,016,000	2.100	2029/9/20	0.91
日本	国債証券	第120回利付国債（5年）	330,000,000	100.25	330,853,758	100.25	330,853,758	0.200	2019/9/20	0.85

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	326,433,250	0.100	2020/9/20	0.84
日本	国債証券	第60回利付国債（20年）	295,000,000	106.23	313,405,050	106.18	313,231,000	1.400	2022/12/20	0.81
日本	国債証券	第122回利付国債（5年）	300,000,000	100.27	300,822,000	100.25	300,753,000	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	118.16	295,410,000	2.300	2026/9/20	0.76
日本	国債証券	第43回利付国債（30年）	235,000,000	121.08	284,540,350	122.33	287,480,200	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	98.69	281,286,450	0.500	2038/3/20	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債（30年）	208,000,000	129.84	270,067,200	130.23	270,878,400	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	131.71	263,438,000	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	116.86	251,266,200	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	104.69	248,120,040	1.900	2021/3/22	0.64
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	245,000,000	100.80	246,964,900	101.05	247,594,550	0.100	2026/6/20	0.64

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	77.81
地方債証券	7.21
特殊債券	8.02
社債券	6.61
合計	99.65

## 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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	67,972,041,882	45.55
	カナダ	3,006,001,018	2.01
	メキシコ	1,146,875,704	0.77

	ドイツ	10,216,855,252	6.85
	イタリア	13,048,040,363	8.74
	フランス	15,070,357,748	10.10
	オランダ	3,094,460,208	2.07
	スペイン	8,717,232,129	5.84
	ベルギー	3,610,070,302	2.42
	オーストリア	2,169,711,210	1.45
	フィンランド	915,259,515	0.61
	アイルランド	1,147,459,483	0.77
	イギリス	9,712,345,796	6.51
	スウェーデン	551,540,119	0.37
	ノルウェー	351,462,693	0.24
	デンマーク	913,222,688	0.61
	ポーランド	882,715,692	0.59
	オーストラリア	3,138,091,667	2.10
	シンガポール	581,702,838	0.39
	マレーシア	724,211,631	0.49
	南アフリカ	888,372,039	0.60
	小計	147,858,029,977	99.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,373,609,629	0.92
合計（純資産総額）		149,231,639,606	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		85,941,048	0.06
	売建		63,250,076	0.04

(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	11,107.20	1,360,632,471	11,138.23	1,364,433,529	2.125	2021/8/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	13,027.77	1,205,069,129	12,999.84	1,202,486,070	8.000	2021/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,530,000	11,423.89	1,202,936,525	11,414.59	1,201,956,757	3.375	2019/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	10,481.56	1,152,972,075	10,548.27	1,160,310,540	1.250	2023/7/31	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,914.39	1,058,696,375	10,962.26	1,063,339,780	1.875	2022/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,070,000	11,467.33	925,413,930	11,459.36	924,770,465	3.625	2020/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,465.79	897,771,494	11,461.13	897,406,776	3.500	2020/5/15	0.60

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,759.25	876,879,644	10,816.66	881,557,849	1.750	2023/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,119.83	672,749,900	11,150.64	674,613,942	2.125	2021/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,164.31	669,858,798	11,182.33	670,940,131	2.000	2020/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	10,566.45	644,553,524	10,658.64	650,177,339	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	10,856.77	643,806,791	10,932.56	648,301,314	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,052.23	641,029,861	11,121.16	645,027,752	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,760.14	639,152,583	10,845.69	644,234,167	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,905.97	632,546,616	10,958.05	635,567,190	2.000	2023/2/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	15,681.12	616,268,054	15,688.21	616,546,790	4.250	2023/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	11,887.97	608,664,554	11,926.98	610,661,451	3.625	2043/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,460.07	606,684,239	10,495.97	608,766,550	2.875	2043/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,183.88	600,574,725	11,198.95	601,383,993	2.000	2020/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,515.16	601,979,307	12,460.64	599,357,055	8.750	2020/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,148.20	590,854,630	11,177.45	592,405,370	2.250	2021/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,106.98	588,670,377	11,163.94	591,688,872	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	11,302.67	585,478,752	11,311.76	585,949,283	2.625	2020/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	10,515.43	578,348,799	10,581.52	581,983,914	1.375	2023/9/30	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	20,924.78	569,154,234	20,982.23	570,716,896	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,294.63	564,731,538	11,389.10	569,455,379	3.000	2025/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,114.08	566,818,086	11,130.69	567,665,588	1.500	2020/5/31	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,920,000	14,322.80	561,453,931	14,300.01	560,560,598	3.250	2021/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,199.62	559,981,258	11,208.93	560,446,502	1.500	2019/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,220,000	10,608.55	553,766,828	10,695.65	558,313,224	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	99.08
合計	99.08

## 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	450,000.00	51,124,500	51,043,500	0.03
	ユーロ	買建	195,000.00	25,195,993	25,190,100	0.02
	デンマーククローネ	買建	560,800.00	9,711,388	9,707,448	0.01
	米ドル	売建	557,635.34	63,267,381	63,250,076	0.04

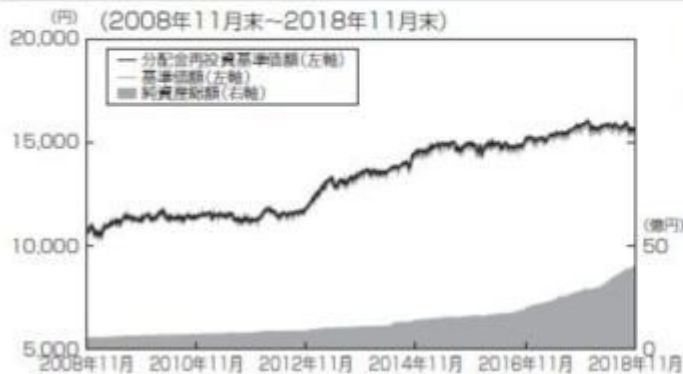
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

## 運用実績

2018年11月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………15,599円

純資産総額……………40.91億円

※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11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年11月	2015年11月	2016年11月	2017年11月	2018年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	130円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15.16%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.12%
日本債券インデックスマザーファンド	64.75%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.99%
現金その他	4.97%

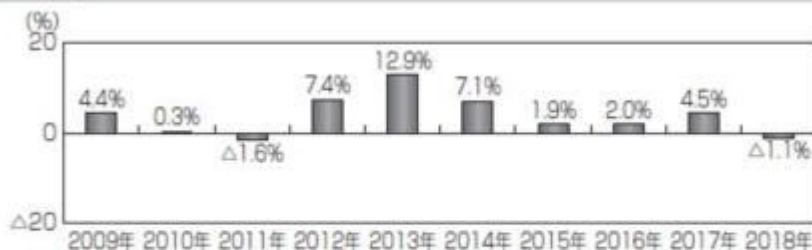
※当ファンドの対純資産総額比です。

## &lt;組入上位銘柄&gt;

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.18%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.80%	
	3 ソニー	電気機器	1.67%	
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	2.43%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.21%	
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.90%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	2025/12/20	2.65%
	2 第345回利付国債(10年)	国債証券	2026/12/20	1.59%
	3 第124回利付国債(5年)	国債証券	2020/8/20	1.45%
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	2021/8/15	0.91%
	2 US TREASURY N/B (クーポン8.000%)	国債証券	2021/11/15	0.81%
	3 US TREASURY N/B (クーポン3.375%)	国債証券	2019/11/15	0.81%

※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11月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## (1) 申込方法

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

## (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

## (3) 取扱時間

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

## (4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

## (5) 申込単位

1円以上1円単位

## (6) 申込代金の支払い

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

## (7) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

## &lt; 解約請求による換金 &gt;

## (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

## (2) 取扱時間

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

## (3) 解約制限

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

## (4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

#### (6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

#### (7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

#### (8) 受付の中止および取消

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

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

### 3【資産管理等の概要】

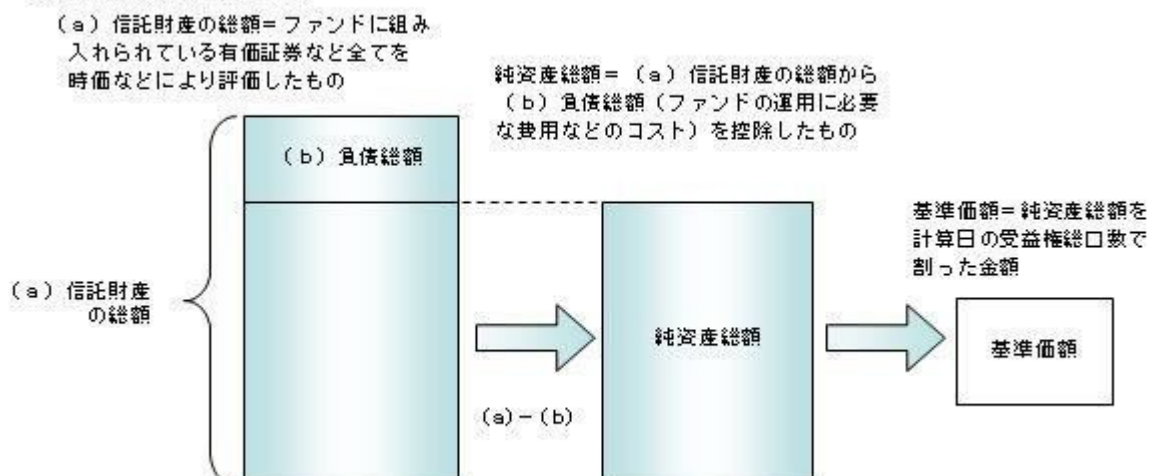
#### (1) 【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債(国内・外国)

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
  - ・金融商品取引業者(第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。)、銀行などの提示する価額(売気配相場を除きます。)
  - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

\*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)



- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
- イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

#### 償還金について

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

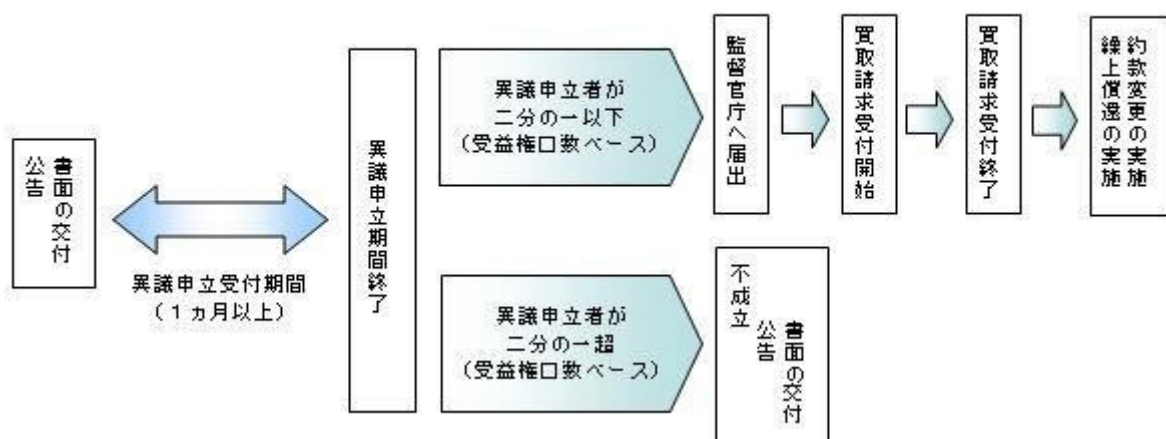
#### 信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 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なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

#### ＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



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

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

関係法人との契約について

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

##### (2) 解約請求権

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

##### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間（平成29年11月7日から平成30年11月6日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DCインデックスバランス（株式20）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 平成29年11月 6日現在	第16期 平成30年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	21,066,619
コール・ローン	142,939,334	184,170,435
親投資信託受益証券	2,650,275,974	3,777,355,781
未収入金	1,631,317	-
流動資産合計	2,794,846,625	3,982,592,835
資産合計	2,794,846,625	3,982,592,835
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,771,195	2,558,147
未払解約金	3,907,238	4,086,039
未払受託者報酬	411,969	584,474
未払委託者報酬	1,922,809	2,727,842
未払利息	169	314
その他未払費用	67,231	95,413
流動負債合計	8,080,611	10,052,229
負債合計	8,080,611	10,052,229
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,771,195,466	2,558,147,575
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,015,570,548	1,414,393,031
（分配準備積立金）	289,693,105	280,336,800
元本等合計	2,786,766,014	3,972,540,606
純資産合計	2,786,766,014	3,972,540,606
負債純資産合計	2,794,846,625	3,982,592,835

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日	自	平成29年11月 7日 至 平成30年11月 6日
営業収益				
受取利息		30		68
有価証券売買等損益		159,239,083		38,552,275
営業収益合計		159,239,113		38,552,207
営業費用				
支払利息		54,515		79,285
受託者報酬		757,767		1,057,600
委託者報酬		3,536,808		4,936,048
その他費用		123,662		184,937
営業費用合計		4,472,752		6,257,870
営業利益又は営業損失（ ）		154,766,361		44,810,077
経常利益又は経常損失（ ）		154,766,361		44,810,077
当期純利益又は当期純損失（ ）		154,766,361		44,810,077
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（ ）		13,022,936		1,374,371
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		610,163,645		1,015,570,548
剰余金増加額又は欠損金減少額		423,648,926		649,135,879
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		423,648,926		649,135,879
剰余金減少額又は欠損金増加額		158,214,253		204,319,543
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		158,214,253		204,319,543
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		1,771,195		2,558,147
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,015,570,548		1,414,393,031

## ( 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15期 平成29年11月 6日現在	第16期 平成30年11月 6日現在
1.	期首元本額	1,287,475,428円	1,771,195,466円
	期中追加設定元本額	810,944,162円	1,143,786,634円
	期中一部解約元本額	327,224,124円	356,834,525円
2.	受益権の総数	1,771,195,466口	2,558,147,575口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第15期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日		第16期 自 平成29年11月 7日 至 平成30年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	32,236,715円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 38,872,110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	87,095,449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 0円
C	信託約款に定める収益調整金	725,877,443円	C 信託約款に定める収益調整金 1,134,056,231円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	172,132,136円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 244,022,837円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	1,017,341,743円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D ) 1,416,951,178円
F	分配対象収益(1万口当たり)	5,743円	F 分配対象収益(1万口当たり) 5,538円
G	分配金額	1,771,195円	G 分配金額 2,558,147円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 6日	第16期 自 平成29年11月 7日 至 平成30年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	第15期 平成29年11月 6日現在	第16期 平成30年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第15期（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

親投資信託受益証券	145,455,738
合計	145,455,738

第16期(平成30年11月6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	37,156,216
合計	37,156,216

(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15期 平成29年11月6日現在		第16期 平成30年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.5734円	1口当たり純資産額	1.5529円
(1万口当たり純資産額)	(15,734円)	(1万口当たり純資産額)	(15,529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	83,139,293	203,549,931	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,856,314,765	2,570,995,949	



海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	177,605,835	398,281,084	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	403,072,955	604,528,817	
合計	2,520,132,848	3,777,355,781	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 貸借対照表

	平成29年11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
（単位：円）		
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	21,355,086
コール・ローン	228,584,154	186,692,299
株式	29,043,675,810	29,104,829,140
派生商品評価勘定	6,351,360	6,667,980
未収入金	4,774,600	-
未収配当金	225,926,812	260,076,213
前払金	-	4,330,000
流動資産合計	29,509,312,736	29,583,950,718
<b>資産合計</b>	29,509,312,736	29,583,950,718
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,368,240
前受金	9,795,000	-
未払金	-	138,312,730
未払解約金	76,594,333	4,407,186
未払利息	271	319
流動負債合計	86,389,604	146,088,475

	平成29年11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
負債合計	86,389,604	146,088,475
純資産の部		
元本等		
元本	18,556,735,435	19,628,127,216
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	10,866,187,697	9,809,735,027
元本等合計	29,422,923,132	29,437,862,243
純資産合計	29,422,923,132	29,437,862,243
負債純資産合計	29,509,312,736	29,583,950,718

## 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11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
1. 期首	平成28年11月 8日	平成29年11月 7日
期首元本額	21,614,291,321円	18,556,735,435円
期首からの追加設定元本額	1,876,867,251円	3,092,609,803円
期首からの一部解約元本額	4,934,423,137円	2,021,218,022円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	268,600,121円	403,072,955円
DCインデックスバランス(株式40)	842,883,256円	1,172,259,377円
DCインデックスバランス(株式60)	1,628,235,422円	2,257,628,335円
DCインデックスバランス(株式80)	1,772,214,419円	2,375,984,509円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,242,601,594円	1,491,372,908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	3,707,983,912円	3,341,745,524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	4,593,260円	3,526,022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）	52,613,017円	50,973,871円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	39,783,177円	42,918,064円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	60,796,114円	74,096,214円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	65,446,430円	64,755,008円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,178,393,256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）	9,778,573円	931,845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）	30,641,917円	- 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	253,585,146円	262,766,698円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	737,069,541円	782,978,350円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,071,286,651円	1,136,373,427円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,094,920,867円	1,106,668,521円
計	18,556,735,435円	19,628,127,216円
2. 受益権の総数	18,556,735,435口	19,628,127,216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	479,045,000円	423,200,000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11月 8日 至 平成29年11月 6日	自 平成29年11月 7日 至 平成30年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	621,760,680
合計	621,760,680

（平成30年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,100,685,221
合計	1,100,685,221

(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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	281,000,000	-	287,360,000	6,360,000
合計		281,000,000	-	287,360,000	6,360,000

（平成30年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	313,135,000	-	316,445,000	3,310,000
合計		313,135,000	-	316,445,000	3,310,000

（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11月 6日現在		平成30年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.5856円	1口当たり純資産額	1.4998円
(1万口当たり純資産額)	(15,856円)	(1万口当たり純資産額)	(14,998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	3,045.00	1,522,500	
日本水産	16,900	708.00	11,965,200	
マルハニチロ	2,400	4,045.00	9,708,000	
カネコ種苗	500	1,430.00	715,000	
サカタのタネ	2,000	3,670.00	7,340,000	
ホクト	1,400	2,063.00	2,888,200	
ホクリヨウ	200	756.00	151,200	
住石ホールディングス	3,900	122.00	475,800	
日鉄鉱業	400	5,320.00	2,128,000	
三井松島ホールディングス	700	1,828.00	1,279,600	
国際石油開発帝石	67,500	1,290.50	87,108,750	
石油資源開発	2,400	2,495.00	5,988,000	
K & O エナジーグループ	800	1,551.00	1,240,800	
ヒノキヤグループ	400	2,682.00	1,072,800	
ショーボンドホールディングス	1,300	8,040.00	10,452,000	
ミライト・ホールディングス	4,300	1,682.00	7,232,600	
サンヨーホームズ	300	909.00	272,700	
日本アクア	500	338.00	169,000	

ファーストコーポレーション	500	1,091.00	545,500
ベステラ	300	1,433.00	429,900
TATERU	2,100	517.00	1,085,700
スペースバリューホールディングス	2,100	1,007.00	2,114,700
ダイセキ環境ソリューション	400	872.00	348,800
第一カッター興業	200	2,293.00	458,600
安藤・間	10,800	799.00	8,629,200
東急建設	4,900	1,056.00	5,174,400
コムシスホールディングス	6,000	3,030.00	18,180,000
ミサワホーム	1,400	843.00	1,180,200
高松コンストラクショングループ	1,000	2,926.00	2,926,000
東建コーポレーション	500	7,550.00	3,775,000
ソネック	200	750.00	150,000
ヤマウラ	700	863.00	604,100
大成建設	13,800	5,120.00	70,656,000
大林組	41,600	1,050.00	43,680,000
清水建設	42,400	949.00	40,237,600
飛鳥建設	1,200	1,710.00	2,052,000
長谷工コーポレーション	17,300	1,450.00	25,085,000
松井建設	1,500	825.00	1,237,500
銭高組	200	5,560.00	1,112,000
鹿島建設	32,500	1,530.00	49,725,000
不動テトラ	1,100	1,727.00	1,899,700
大末建設	500	1,189.00	594,500
鉄建建設	900	2,852.00	2,566,800
西松建設	3,000	2,725.00	8,175,000
三井住友建設	10,000	739.00	7,390,000
大豊建設	900	3,425.00	3,082,500
前田建設工業	9,900	1,274.00	12,612,600
ナカノフドー建設	1,100	650.00	715,000
奥村組	2,300	3,650.00	8,395,000
東鉄工業	1,700	2,834.00	4,817,800
イチケン	300	2,232.00	669,600
富士ピー・エス	400	544.00	217,600
浅沼組	500	3,255.00	1,627,500
戸田建設	16,100	781.00	12,574,100
熊谷組	2,000	3,095.00	6,190,000
青木あすなろ建設	700	1,009.00	706,300
北野建設	300	3,795.00	1,138,500
植木組	200	2,433.00	486,600
矢作建設工業	1,900	782.00	1,485,800
ピーエス三菱	1,500	653.00	979,500

日本ハウスホールディングス	2,700	511.00	1,379,700
大東建託	5,000	15,225.00	76,125,000
新日本建設	1,700	1,090.00	1,853,000
N I P P O	3,700	1,889.00	6,989,300
東亜道路工業	300	3,610.00	1,083,000
前田道路	4,400	2,194.00	9,653,600
日本道路	400	6,030.00	2,412,000
東亜建設工業	1,200	1,634.00	1,960,800
若築建設	700	1,485.00	1,039,500
東洋建設	5,100	445.00	2,269,500
五洋建設	16,600	671.00	11,138,600
福田組	500	4,675.00	2,337,500
住友林業	9,800	1,665.00	16,317,000
日本基礎技術	1,500	363.00	544,500
巴コーポレーション	1,800	413.00	743,400
大和ハウス工業	38,400	3,417.00	131,212,800
ライト工業	2,700	1,478.00	3,990,600
積水ハウス	42,500	1,683.00	71,527,500
日特建設	1,300	750.00	975,000
北陸電気工事	700	1,025.00	717,500
ユアテック	2,200	881.00	1,938,200
四電工	200	2,551.00	510,200
中電工	1,800	2,408.00	4,334,400
関電工	6,300	1,170.00	7,371,000
きんでん	9,200	1,897.00	17,452,400
東京エネシス	1,400	980.00	1,372,000
トーエネック	400	3,115.00	1,246,000
住友電設	1,000	1,870.00	1,870,000
日本電設工業	2,400	2,250.00	5,400,000
協和エクシオ	5,400	2,931.00	15,827,400
新日本空調	1,200	1,795.00	2,154,000
九電工	2,800	4,415.00	12,362,000
三機工業	3,200	1,114.00	3,564,800
日揮	12,000	2,115.00	25,380,000
中外炉工業	400	2,410.00	964,000
ヤマト	1,300	636.00	826,800
太平電業	900	2,732.00	2,458,800
高砂熱学工業	3,500	1,986.00	6,951,000
三晃金属工業	200	2,982.00	596,400
朝日工業社	300	3,265.00	979,500
明星工業	2,500	829.00	2,072,500
大気社	1,900	3,260.00	6,194,000



ダイダン	900	2,616.00	2,354,400
日比谷総合設備	1,300	1,969.00	2,559,700
東芝プラントシステム	3,000	2,311.00	6,933,000
OSJBホールディングス	6,300	287.00	1,808,100
東洋エンジニアリング	1,700	834.00	1,417,800
千代田化工建設	10,100	418.00	4,221,800
新興プランテック	2,500	1,145.00	2,862,500
日本製粉	4,100	1,858.00	7,617,800
日清製粉グループ本社	14,000	2,243.00	31,402,000
日東富士製粉	100	5,250.00	525,000
昭和産業	1,100	2,897.00	3,186,700
鳥越製粉	1,100	947.00	1,041,700
中部飼料	1,500	1,466.00	2,199,000
フィード・ワン	8,300	195.00	1,618,500
東洋精糖	200	1,168.00	233,600
日本甜菜製糖	700	1,935.00	1,354,500
三井製糖	1,000	3,035.00	3,035,000
塩水港精糖	1,400	244.00	341,600
日新製糖	600	2,292.00	1,375,200
森永製菓	3,100	4,480.00	13,888,000
中村屋	300	4,395.00	1,318,500
江崎グリコ	3,700	5,160.00	19,092,000
名糖産業	600	1,498.00	898,800
井村屋グループ	500	3,100.00	1,550,000
不二家	700	2,450.00	1,715,000
山崎製パン	10,200	2,188.00	22,317,600
第一屋製パン	200	1,099.00	219,800
モロゾフ	200	5,450.00	1,090,000
亀田製菓	800	5,350.00	4,280,000
寿スピリッツ	1,300	4,225.00	5,492,500
カルビー	5,700	3,635.00	20,719,500
森永乳業	2,500	2,995.00	7,487,500
六甲バター	900	2,434.00	2,190,600
ヤクルト本社	9,200	8,150.00	74,980,000
明治ホールディングス	8,800	7,690.00	67,672,000
雪印メグミルク	3,000	2,667.00	8,001,000
プリマハム	1,800	2,340.00	4,212,000
日本ハム	5,400	4,020.00	21,708,000
林兼産業	500	683.00	341,500
丸大食品	1,300	1,859.00	2,416,700
S Foods	1,100	4,600.00	5,060,000
伊藤ハム米久ホールディングス	8,000	738.00	5,904,000

サッポロホールディングス	4,600	2,393.00	11,007,800
アサヒグループホールディングス	26,000	5,151.00	133,926,000
キリンホールディングス	56,200	2,692.00	151,290,400
宝ホールディングス	9,300	1,619.00	15,056,700
オエノンホールディングス	3,600	385.00	1,386,000
養命酒製造	400	2,333.00	933,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,500	3,025.00	28,737,500
サントリー食品インターナショナル	8,300	4,345.00	36,063,500
ダイドーグループホールディングス	700	5,760.00	4,032,000
伊藤園	4,100	4,915.00	20,151,500
キーコーヒー	1,200	1,997.00	2,396,400
ユニカフェ	400	1,252.00	500,800
ジャパンフーズ	200	1,236.00	247,200
日清オイリオグループ	1,600	3,425.00	5,480,000
不二製油グループ本社	3,000	3,210.00	9,630,000
かどや製油	200	5,990.00	1,198,000
J - オイルミルズ	600	3,830.00	2,298,000
キッコーマン	8,200	5,940.00	48,708,000
味の素	28,600	1,848.00	52,852,800
キューピー	6,900	2,666.00	18,395,400
ハウス食品グループ本社	4,700	3,655.00	17,178,500
カゴメ	5,000	3,155.00	15,775,000
焼津水産化学工業	600	1,017.00	610,200
アリアケジャパン	1,100	9,960.00	10,956,000
ピエトロ	200	1,648.00	329,600
エバラ食品工業	300	2,147.00	644,100
ニチレイ	6,400	2,603.00	16,659,200
東洋水産	6,400	3,920.00	25,088,000
イトアンド	400	1,642.00	656,800
大冷	200	1,823.00	364,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	650.00	260,000
日清食品ホールディングス	5,300	7,090.00	37,577,000
永谷園ホールディングス	700	2,759.00	1,931,300
一正蒲鉾	500	973.00	486,500
フジッコ	1,400	2,410.00	3,374,000
ロック・フィールド	1,300	1,681.00	2,185,300
日本たばこ産業	71,700	2,846.00	204,058,200
ケンコーマヨネーズ	700	2,528.00	1,769,600
わらべや日洋ホールディングス	800	1,871.00	1,496,800
なとり	700	1,795.00	1,256,500
イフジ産業	200	737.00	147,400
ピクルスコーポレーション	300	2,243.00	672,900

北の達人コーポレーション	4,900	556.00	2,724,400
ユーグレナ	5,000	667.00	3,335,000
ミヨシ油脂	500	1,269.00	634,500
理研ビタミン	600	3,525.00	2,115,000
片倉工業	1,500	1,239.00	1,858,500
ゲンゼ	900	4,680.00	4,212,000
東洋紡	5,100	1,622.00	8,272,200
ユニチカ	3,600	588.00	2,116,800
富士紡ホールディングス	600	3,420.00	2,052,000
倉敷紡績	1,100	2,808.00	3,088,800
シキボウ	600	1,150.00	690,000
日本毛織	4,000	908.00	3,632,000
ダイトウボウ	2,600	94.00	244,400
トーア紡コーポレーション	500	548.00	274,000
ダイドーリミテッド	1,500	367.00	550,500
帝国繊維	1,400	2,571.00	3,599,400
帝人	9,900	1,954.00	19,344,600
東レ	94,100	814.80	76,672,680
サカイオーベックス	300	2,269.00	680,700
住江織物	300	2,686.00	805,800
日本フェルト	700	471.00	329,700
イチカワ	200	1,542.00	308,400
日東製網	200	1,533.00	306,600
アツギ	1,000	1,041.00	1,041,000
ダイニック	500	840.00	420,000
セーレン	3,000	1,641.00	4,923,000
ソトー	500	967.00	483,500
東海染工	200	1,138.00	227,600
小松マテーレ	2,000	912.00	1,824,000
ワコールホールディングス	3,500	3,040.00	10,640,000
ホギメディカル	1,500	3,185.00	4,777,500
レナウン	3,600	116.00	417,600
クラウディアホールディングス	300	508.00	152,400
T S Iホールディングス	4,500	782.00	3,519,000
マツオカコーポレーション	400	3,225.00	1,290,000
ワールド	1,300	2,354.00	3,060,200
三陽商会	800	1,925.00	1,540,000
ナイガイ	500	493.00	246,500
オンワードホールディングス	7,500	689.00	5,167,500
ルックホールディングス	500	1,174.00	587,000
キムラタン	7,000	32.00	224,000
ゴールドウイン	1,100	10,060.00	11,066,000

デサント	3,000	2,713.00	8,139,000
キング	700	496.00	347,200
ヤマトインターナショナル	800	456.00	364,800
特種東海製紙	800	4,225.00	3,380,000
王子ホールディングス	54,600	742.00	40,513,200
日本製紙	5,800	1,944.00	11,275,200
三菱製紙	2,000	578.00	1,156,000
北越コーポレーション	8,000	545.00	4,360,000
中越パルプ工業	500	1,536.00	768,000
巴川製紙所	400	1,164.00	465,600
大王製紙	5,900	1,441.00	8,501,900
阿波製紙	300	563.00	168,900
レンゴー	12,500	859.00	10,737,500
トモク	800	1,989.00	1,591,200
ザ・パック	900	3,380.00	3,042,000
クラレ	20,400	1,585.00	32,334,000
旭化成	86,300	1,257.50	108,522,250
共和レザー	800	868.00	694,400
昭和電工	8,100	5,050.00	40,905,000
住友化学	95,400	599.00	57,144,600
住友精化	600	5,660.00	3,396,000
日産化学	7,500	5,660.00	42,450,000
ラサ工業	400	1,878.00	751,200
クレハ	1,100	7,480.00	8,228,000
多木化学	200	8,600.00	1,720,000
テイカ	1,000	2,282.00	2,282,000
石原産業	2,300	1,388.00	3,192,400
片倉コープアグリ	400	1,217.00	486,800
日東エフシー	800	784.00	627,200
日本曹達	1,900	2,947.00	5,599,300
東ソー	18,700	1,546.00	28,910,200
トクヤマ	3,500	2,674.00	9,359,000
セントラル硝子	2,600	2,578.00	6,702,800
東亜合成	7,600	1,211.00	9,203,600
大阪ソーダ	1,300	2,755.00	3,581,500
関東電化工業	2,900	1,052.00	3,050,800
デンカ	4,800	3,685.00	17,688,000
信越化学工業	21,400	9,808.00	209,891,200
日本カーバイド工業	400	1,897.00	758,800
堺化学工業	800	2,616.00	2,092,800
第一稀元素化学工業	1,000	1,137.00	1,137,000
エア・ウォーター	9,900	1,832.00	18,136,800

大陽日酸	10,000	1,918.00	19,180,000
日本化学工業	400	3,165.00	1,266,000
東邦アセチレン	200	1,515.00	303,000
日本パーカラライジング	6,600	1,419.00	9,365,400
高压ガス工業	1,900	847.00	1,609,300
四国化成工業	2,000	1,195.00	2,390,000
戸田工業	300	2,637.00	791,100
ステラ ケミファ	700	3,460.00	2,422,000
保土谷化学工業	400	2,810.00	1,124,000
日本触媒	2,000	6,720.00	13,440,000
大日精化工業	1,000	3,350.00	3,350,000
カネカ	3,200	4,815.00	15,408,000
三菱瓦斯化学	12,400	1,806.00	22,394,400
三井化学	11,000	2,811.00	30,921,000
J S R	12,200	1,797.00	21,923,400
東京応化工業	2,100	3,120.00	6,552,000
大阪有機化学工業	1,100	1,425.00	1,567,500
三菱ケミカルホールディングス	81,000	929.20	75,265,200
K Hネオケム	1,800	3,335.00	6,003,000
ダイセル	18,800	1,258.00	23,650,400
住友ベークライト	2,100	4,195.00	8,809,500
積水化学工業	26,500	1,832.00	48,548,000
日本ゼオン	10,900	1,146.00	12,491,400
アイカ工業	3,700	3,345.00	12,376,500
宇部興産	6,100	2,492.00	15,201,200
積水樹脂	2,000	2,043.00	4,086,000
タキロンシーアイ	2,600	599.00	1,557,400
旭有機材	800	2,000.00	1,600,000
日立化成	5,600	1,773.00	9,928,800
ニチバン	600	2,239.00	1,343,400
リケンテクノス	3,300	508.00	1,676,400
大倉工業	600	2,156.00	1,293,600
積水化成成品工業	1,800	975.00	1,755,000
群栄化学工業	300	3,105.00	931,500
タイガースポリマー	700	694.00	485,800
ミライアル	400	1,036.00	414,400
ダイキアクシス	400	1,368.00	547,200
ダイキョーニシカワ	2,500	1,107.00	2,767,500
竹本容器	200	2,932.00	586,400
森六ホールディングス	700	2,922.00	2,045,400
日本化薬	7,700	1,381.00	10,633,700
カーリットホールディングス	1,300	932.00	1,211,600

日本精化	1,000	1,102.00	1,102,000
扶桑化学工業	1,200	2,365.00	2,838,000
トリケミカル研究所	300	4,650.00	1,395,000
A D E K A	6,000	1,714.00	10,284,000
日油	4,700	3,540.00	16,638,000
新日本理化	2,300	205.00	471,500
ハリマ化成グループ	1,000	985.00	985,000
花王	30,000	7,647.00	229,410,000
第一工業製薬	500	2,515.00	1,257,500
石原ケミカル	300	2,097.00	629,100
日華化学	400	1,172.00	468,800
ニイタカ	200	1,732.00	346,400
三洋化成工業	800	5,510.00	4,408,000
有機合成薬品工業	1,000	258.00	258,000
大日本塗料	1,400	1,137.00	1,591,800
日本ペイントホールディングス	10,000	3,685.00	36,850,000
関西ペイント	13,600	1,700.00	23,120,000
神東塗料	1,000	193.00	193,000
中国塗料	4,000	935.00	3,740,000
日本特殊塗料	900	2,248.00	2,023,200
藤倉化成	1,600	627.00	1,003,200
太陽ホールディングス	1,000	4,015.00	4,015,000
D I C	5,500	3,295.00	18,122,500
サカタインクス	2,700	1,137.00	3,069,900
東洋インキ S C ホールディングス	2,500	2,710.00	6,775,000
T & K T O K A	900	1,052.00	946,800
富士フイルムホールディングス	25,700	4,861.00	124,927,700
資生堂	24,600	7,575.00	186,345,000
ライオン	17,300	2,055.00	35,551,500
高砂香料工業	800	3,655.00	2,924,000
マンダム	2,800	3,170.00	8,876,000
ミルボン	1,500	4,095.00	6,142,500
ファンケル	2,800	5,220.00	14,616,000
コーセー	2,100	17,600.00	36,960,000
コタ	600	1,476.00	885,600
シーズ・ホールディングス	1,500	5,860.00	8,790,000
シーボン	200	2,682.00	536,400
ポーラ・オルビスホールディングス	5,300	3,140.00	16,642,000
ノエビアホールディングス	800	4,970.00	3,976,000
アジュバンコスメジャパン	300	990.00	297,000
エステー	900	2,104.00	1,893,600
アグロ カネショウ	500	2,328.00	1,164,000

コニシ	2,200	1,641.00	3,610,200	
長谷川香料	1,500	2,147.00	3,220,500	
星光P M C	800	930.00	744,000	
小林製薬	3,500	7,370.00	25,795,000	
荒川化学工業	1,100	1,556.00	1,711,600	
メック	900	1,482.00	1,333,800	
日本高純度化学	300	2,282.00	684,600	
タカラバイオ	3,300	2,815.00	9,289,500	
J C U	1,600	2,239.00	3,582,400	
新田ゼラチン	800	774.00	619,200	
O A T アグリオ	200	2,782.00	556,400	
デクセリアルズ	3,200	1,022.00	3,270,400	
アース製薬	900	5,270.00	4,743,000	
北興化学工業	1,300	573.00	744,900	
大成ラミック	400	3,020.00	1,208,000	
クミアイ化学工業	5,100	691.00	3,524,100	
日本農薬	3,000	610.00	1,830,000	
アキレス	900	2,249.00	2,024,100	
有沢製作所	1,900	950.00	1,805,000	
日東電工	9,400	6,292.00	59,144,800	
レック	1,300	2,236.00	2,906,800	
三光合成	1,000	402.00	402,000	
きもと	2,200	227.00	499,400	
藤森工業	1,100	3,345.00	3,679,500	
前澤化成工業	900	1,095.00	985,500	
ウェーブロックホールディングス	300	886.00	265,800	
J S P	700	2,310.00	1,617,000	
エフピコ	1,000	5,890.00	5,890,000	
天馬	900	2,020.00	1,818,000	
信越ポリマー	2,200	880.00	1,936,000	
東リ	3,100	301.00	933,100	
ニフコ	5,000	2,774.00	13,870,000	
バルカー	1,000	2,677.00	2,677,000	
ユニ・チャーム	26,300	3,172.00	83,423,600	
協和発酵キリン	15,500	2,203.00	34,146,500	
武田薬品工業	48,900	4,628.00	226,309,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	114,100	1,736.50	198,134,650	
大日本住友製薬	9,200	2,773.00	25,511,600	
塩野義製薬	16,200	7,274.00	117,838,800	
田辺三菱製薬	12,900	1,680.00	21,672,000	
わかもと製薬	1,500	294.00	441,000	
あすか製薬	1,500	1,236.00	1,854,000	

日本新薬	3,300	6,640.00	21,912,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,838.00	567,600	
中外製薬	12,900	6,800.00	87,720,000	
科研製薬	2,200	5,700.00	12,540,000	
エーザイ	14,800	10,040.00	148,592,000	
ロート製薬	6,300	3,540.00	22,302,000	
小野薬品工業	29,200	2,674.00	78,080,800	
久光製薬	3,700	6,630.00	24,531,000	
持田製薬	900	9,150.00	8,235,000	
参天製薬	23,500	1,724.00	40,514,000	
扶桑薬品工業	400	2,696.00	1,078,400	
日本ケミファ	200	4,165.00	833,000	
ツムラ	3,800	3,660.00	13,908,000	
日医工	3,000	1,570.00	4,710,000	
キッセイ薬品工業	2,200	3,395.00	7,469,000	
生化学工業	2,400	1,670.00	4,008,000	
栄研化学	2,200	2,505.00	5,511,000	
日水製薬	500	1,238.00	619,000	
鳥居薬品	700	2,382.00	1,667,400	
JCRファーマ	900	5,620.00	5,058,000	
東和薬品	600	8,690.00	5,214,000	
富士製薬工業	900	1,754.00	1,578,600	
沢井製薬	2,500	5,870.00	14,675,000	
ゼリア新薬工業	2,500	2,025.00	5,062,500	
第一三共	35,400	4,293.00	151,972,200	
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,687.00	8,598,400	
大幸薬品	600	1,890.00	1,134,000	
ダイト	700	3,460.00	2,422,000	
大塚ホールディングス	23,600	5,575.00	131,570,000	
大正製薬ホールディングス	2,800	12,290.00	34,412,000	
ペプチドリーム	5,700	4,065.00	23,170,500	
日本コークス工業	10,400	111.00	1,154,400	
昭和シェル石油	11,600	2,163.00	25,090,800	
ニチレキ	1,600	1,059.00	1,694,400	
ユシロ化学工業	700	1,430.00	1,001,000	
ビーピー・カストロール	500	1,475.00	737,500	
富士石油	3,000	426.00	1,278,000	
MORESCO	400	1,611.00	644,400	
出光興産	9,600	5,140.00	49,344,000	
JXTGホールディングス	210,700	761.20	160,384,840	
コスモエネルギーホールディングス	3,600	4,365.00	15,714,000	
横浜ゴム	7,200	2,321.00	16,711,200	



東洋ゴム工業	6,400	1,676.00	10,726,400
ブリヂストン	38,000	4,366.00	165,908,000
住友ゴム工業	11,100	1,652.00	18,337,200
藤倉ゴム工業	1,100	544.00	598,400
オカモト	900	5,260.00	4,734,000
フコク	500	930.00	465,000
ニッタ	1,400	4,080.00	5,712,000
住友理工	2,400	1,059.00	2,541,600
三ツ星ベルト	1,600	2,671.00	4,273,600
バンドー化学	2,400	1,318.00	3,163,200
日東紡績	1,800	2,356.00	4,240,800
A G C	12,500	3,760.00	47,000,000
日本板硝子	5,800	1,007.00	5,840,600
石塚硝子	200	2,205.00	441,000
日本山村硝子	500	1,712.00	856,000
日本電気硝子	5,300	2,909.00	15,417,700
オハラ	500	2,401.00	1,200,500
住友大阪セメント	2,500	4,335.00	10,837,500
太平洋セメント	7,800	3,320.00	25,896,000
日本ヒューム	1,300	910.00	1,183,000
日本コンクリート工業	2,900	304.00	881,600
三谷セキサン	600	2,613.00	1,567,800
アジアパイルホールディングス	1,800	645.00	1,161,000
東海カーボン	11,200	1,848.00	20,697,600
日本カーボン	600	6,750.00	4,050,000
東洋炭素	700	3,140.00	2,198,000
ノリタケカンパニーリミテド	700	5,720.00	4,004,000
T O T O	9,500	4,180.00	39,710,000
日本碍子	15,100	1,680.00	25,368,000
日本特殊陶業	10,400	2,543.00	26,447,200
ダントーホールディングス	1,300	128.00	166,400
M A R U W A	400	6,810.00	2,724,000
品川リフラクトリーズ	300	4,190.00	1,257,000
黒崎播磨	300	7,130.00	2,139,000
ヨータイ	1,100	741.00	815,100
イソライト工業	600	520.00	312,000
東京窯業	1,600	412.00	659,200
ニッカトー	600	1,080.00	648,000
フジインコーポレーテッド	1,100	2,539.00	2,792,900
クニミネ工業	400	993.00	397,200
エーアンドエーマテリアル	300	1,052.00	315,600
ニチアス	3,400	2,388.00	8,119,200

ニチハ	1,700	2,484.00	4,222,800
新日鐵住金	54,800	2,203.00	120,724,400
神戸製鋼所	22,400	1,004.00	22,489,600
合同製鐵	600	2,131.00	1,278,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	33,100	2,198.00	72,753,800
日新製鋼	3,000	1,556.00	4,668,000
東京製鐵	6,600	887.00	5,854,200
共英製鋼	1,400	2,293.00	3,210,200
大和工業	2,600	3,040.00	7,904,000
東京鐵鋼	500	1,478.00	739,000
大阪製鐵	800	1,913.00	1,530,400
淀川製鋼所	1,600	2,484.00	3,974,400
丸一鋼管	4,300	3,275.00	14,082,500
モリ工業	400	3,110.00	1,244,000
大同特殊鋼	2,000	4,640.00	9,280,000
日本高周波鋼業	500	693.00	346,500
日本冶金工業	10,200	308.00	3,141,600
山陽特殊製鋼	1,500	2,806.00	4,209,000
愛知製鋼	700	4,070.00	2,849,000
日立金属	13,200	1,394.00	18,400,800
日本金属	300	1,546.00	463,800
大平洋金属	800	3,325.00	2,660,000
新日本電工	7,400	270.00	1,998,000
栗本鐵工所	600	1,716.00	1,029,600
虹技	200	1,694.00	338,800
日本鑄鉄管	100	1,381.00	138,100
三菱製鋼	900	1,996.00	1,796,400
日亜鋼業	1,900	327.00	621,300
日本精線	200	3,600.00	720,000
エンビプロ・ホールディングス	300	660.00	198,000
シンニッタン	1,900	368.00	699,200
新家工業	300	1,741.00	522,300
大紀アルミニウム工業所	2,100	681.00	1,430,100
日本軽金属ホールディングス	33,400	251.00	8,383,400
三井金属鉱業	3,300	3,255.00	10,741,500
東邦亜鉛	700	3,920.00	2,744,000
三菱マテリアル	8,100	3,240.00	26,244,000
住友金属鉱山	16,800	3,728.00	62,630,400
DOWAホールディングス	2,900	3,540.00	10,266,000
古河機械金属	2,000	1,491.00	2,982,000
エス・サイエンス	5,600	74.00	414,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,400	2,089.00	2,924,600

東邦チタニウム	2,200	1,427.00	3,139,400
U A C J	1,900	2,394.00	4,548,600
C Kサンエツ	200	2,962.00	592,400
古河電気工業	3,500	3,200.00	11,200,000
住友電気工業	45,800	1,588.00	72,730,400
フジクラ	14,800	499.00	7,385,200
昭和電線ホールディングス	1,500	678.00	1,017,000
タツタ電線	2,500	572.00	1,430,000
カナレ電気	200	2,021.00	404,200
平河ビューテック	500	1,448.00	724,000
リョービ	1,500	3,340.00	5,010,000
アーレスティ	1,500	740.00	1,110,000
アサヒホールディングス	2,300	2,394.00	5,506,200
稲葉製作所	700	1,385.00	969,500
宮地エンジニアリンググループ	400	2,722.00	1,088,800
トーカロ	3,200	975.00	3,120,000
アルファC o	400	1,354.00	541,600
S U M C O	13,500	1,620.00	21,870,000
川田テクノロジーズ	300	6,500.00	1,950,000
R S Technologies	300	4,660.00	1,398,000
東洋製罐グループホールディングス	7,800	2,346.00	18,298,800
ホッカンホールディングス	600	1,789.00	1,073,400
コロナ	700	1,138.00	796,600
横河ブリッジホールディングス	2,300	1,845.00	4,243,500
駒井ハルテック	200	2,136.00	427,200
高田機工	100	2,768.00	276,800
三和ホールディングス	12,600	1,307.00	16,468,200
文化シャッター	3,600	783.00	2,818,800
三協立山	1,700	1,290.00	2,193,000
アルインコ	1,000	1,034.00	1,034,000
東洋シャッター	300	624.00	187,200
L I X I Lグループ	18,100	1,475.00	26,697,500
日本フィルコン	1,000	587.00	587,000
ノーリツ	2,700	1,657.00	4,473,900
長府製作所	1,200	2,349.00	2,818,800
リンナイ	2,200	8,390.00	18,458,000
ダイニチ工業	700	732.00	512,400
日東精工	1,700	638.00	1,084,600
三洋工業	200	2,090.00	418,000
岡部	2,500	971.00	2,427,500
ジーテクト	1,400	1,623.00	2,272,200
中国工業	200	602.00	120,400

東プレ	2,300	2,391.00	5,499,300
高周波熱錬	2,400	1,009.00	2,421,600
東京製綱	800	1,265.00	1,012,000
サンコール	700	744.00	520,800
モリテック スチール	1,000	502.00	502,000
パイオラックス	2,000	2,568.00	5,136,000
エイチワン	1,200	1,149.00	1,378,800
日本発條	12,200	1,011.00	12,334,200
中央発條	100	3,555.00	355,500
アドバネクス	200	1,867.00	373,400
立川ブラインド工業	500	1,129.00	564,500
三益半導体工業	1,000	1,538.00	1,538,000
日本ドライケミカル	300	1,245.00	373,500
日本製鋼所	3,700	2,633.00	9,742,100
三浦工業	5,300	2,705.00	14,336,500
タクマ	4,500	1,428.00	6,426,000
ツガミ	2,800	1,097.00	3,071,600
オークマ	1,600	5,960.00	9,536,000
東芝機械	1,400	2,218.00	3,105,200
アマダホールディングス	18,900	1,110.00	20,979,000
アイダエンジニアリング	3,400	978.00	3,325,200
滝澤鉄工所	400	1,641.00	656,400
F U J I	3,700	1,622.00	6,001,400
牧野フライス製作所	1,400	4,890.00	6,846,000
オーエスジー	6,000	2,378.00	14,268,000
ダイジェット工業	200	1,881.00	376,200
旭ダイヤモンド工業	3,200	745.00	2,384,000
D M G 森精機	7,800	1,780.00	13,884,000
ソディック	2,700	899.00	2,427,300
ディスコ	1,700	17,980.00	30,566,000
日東工器	700	2,482.00	1,737,400
日進工具	400	2,374.00	949,600
パンチ工業	900	693.00	623,700
富士ダイス	500	816.00	408,000
豊和工業	700	878.00	614,600
O K K	500	1,086.00	543,000
東洋機械金属	900	643.00	578,700
津田駒工業	300	2,088.00	626,400
島精機製作所	1,700	3,555.00	6,043,500
オプトラン	1,200	2,239.00	2,686,800
N C ホールディングス	500	600.00	300,000
フリーー	1,000	914.00	914,000

ヤマシンフィルタ	2,100	791.00	1,661,100
日阪製作所	1,500	1,083.00	1,624,500
やまびこ	2,400	1,259.00	3,021,600
平田機工	600	7,320.00	4,392,000
ペガサスミシン製造	1,200	932.00	1,118,400
タツモ	400	1,116.00	446,400
ナブテスコ	6,700	2,826.00	18,934,200
三井海洋開発	1,300	3,220.00	4,186,000
レオン自動機	1,200	1,950.00	2,340,000
S M C	3,600	37,190.00	133,884,000
新川	900	530.00	477,000
ホソカワミクロン	400	5,540.00	2,216,000
ユニオンツール	500	3,910.00	1,955,000
オイレス工業	1,700	1,926.00	3,274,200
日精エー・エス・ビー機械	400	3,960.00	1,584,000
サトーホールディングス	1,500	3,190.00	4,785,000
技研製作所	800	3,900.00	3,120,000
日本エアージェット	400	717.00	286,800
カワタ	200	1,770.00	354,000
日精樹脂工業	1,000	1,082.00	1,082,000
オカダアイヨン	400	1,633.00	653,200
ワイエイシイホールディングス	500	790.00	395,000
小松製作所	56,000	3,136.00	175,616,000
住友重機械工業	7,100	3,585.00	25,453,500
日立建機	4,900	3,145.00	15,410,500
日工	300	2,457.00	737,100
巴工業	500	2,231.00	1,115,500
井関農機	1,200	1,978.00	2,373,600
T O W A	1,100	814.00	895,400
丸山製作所	300	1,645.00	493,500
北川鉄工所	600	2,698.00	1,618,800
ローツェ	500	1,876.00	938,000
タカキタ	400	678.00	271,200
クボタ	66,400	1,793.00	119,055,200
荏原実業	400	1,881.00	752,400
三菱化工機	400	1,724.00	689,600
月島機械	2,400	1,262.00	3,028,800
帝国電機製作所	900	1,540.00	1,386,000
新東工業	2,900	1,008.00	2,923,200
澁谷工業	1,100	3,805.00	4,185,500
アイチ コーポレーション	2,100	655.00	1,375,500
小森コーポレーション	3,400	1,249.00	4,246,600

鶴見製作所	1,000	1,979.00	1,979,000
住友精密工業	200	3,455.00	691,000
酒井重工業	200	3,390.00	678,000
荏原製作所	5,500	3,290.00	18,095,000
石井鐵工所	200	1,753.00	350,600
西島製作所	1,300	931.00	1,210,300
北越工業	1,300	1,239.00	1,610,700
ダイキン工業	16,900	13,215.00	223,333,500
オルガノ	500	3,230.00	1,615,000
トーヨーカネツ	500	2,599.00	1,299,500
栗田工業	6,700	2,848.00	19,081,600
椿本チエイン	1,600	4,255.00	6,808,000
大同工業	600	1,073.00	643,800
木村化工機	1,000	404.00	404,000
アネスト岩田	1,900	1,115.00	2,118,500
ダイフク	6,800	5,080.00	34,544,000
サムコ	400	1,134.00	453,600
加藤製作所	600	3,375.00	2,025,000
油研工業	200	2,161.00	432,200
タダノ	6,000	1,214.00	7,284,000
フジテック	4,500	1,355.00	6,097,500
C K D	3,400	1,349.00	4,586,600
キトー	900	1,892.00	1,702,800
平和	3,500	2,601.00	9,103,500
理想科学工業	1,100	2,129.00	2,341,900
S A N K Y O	3,100	4,250.00	13,175,000
日本金銭機械	1,400	1,103.00	1,544,200
マースグループホールディングス	800	2,305.00	1,844,000
福島工業	800	5,300.00	4,240,000
オーイズミ	600	548.00	328,800
ダイコク電機	600	1,589.00	953,400
竹内製作所	2,100	2,421.00	5,084,100
アマノ	3,600	2,353.00	8,470,800
J U K I	1,700	1,523.00	2,589,100
サンデンホールディングス	1,500	1,280.00	1,920,000
蛇の目マシン工業	1,100	600.00	660,000
マックス	1,900	1,534.00	2,914,600
グローリー	3,400	2,749.00	9,346,600
新晃工業	1,200	1,601.00	1,921,200
大和冷機工業	1,800	1,225.00	2,205,000
セガサミーホールディングス	12,300	1,606.00	19,753,800
日本ピストンリング	500	2,095.00	1,047,500

リケン	600	5,660.00	3,396,000
T P R	1,700	2,704.00	4,596,800
ツバキ・ナカシマ	1,900	2,040.00	3,876,000
ホシザキ	3,600	9,180.00	33,048,000
大豊工業	1,000	1,084.00	1,084,000
日本精工	25,400	1,102.00	27,990,800
N T N	26,600	376.00	10,001,600
ジェイテクト	11,900	1,384.00	16,469,600
不二越	1,200	4,710.00	5,652,000
日本トムソン	3,700	687.00	2,541,900
T H K	7,700	2,642.00	20,343,400
ユーシン精機	1,000	1,308.00	1,308,000
前澤給装工業	500	1,843.00	921,500
イーグル工業	1,500	1,372.00	2,058,000
前澤工業	900	395.00	355,500
日本ピラー工業	1,200	1,518.00	1,821,600
キッツ	5,000	906.00	4,530,000
マキタ	15,100	4,160.00	62,816,000
日立造船	9,800	413.00	4,047,400
三菱重工業	20,700	4,272.00	88,430,400
I H I	9,500	4,135.00	39,282,500
スター精密	2,100	1,636.00	3,435,600
日清紡ホールディングス	6,900	1,145.00	7,900,500
イビデン	7,600	1,608.00	12,220,800
コニカミノルタ	27,000	1,076.00	29,052,000
ブラザー工業	16,100	2,122.00	34,164,200
ミネベアミツミ	23,000	1,745.00	40,135,000
日立製作所	55,700	3,488.00	194,281,600
三菱電機	123,800	1,473.50	182,419,300
富士電機	8,000	3,650.00	29,200,000
東洋電機製造	500	1,608.00	804,000
安川電機	14,400	3,470.00	49,968,000
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,756.00	2,985,200
明電舎	2,400	1,638.00	3,931,200
オリジン電気	400	1,632.00	652,800
山洋電気	600	4,590.00	2,754,000
デンヨー	1,100	1,716.00	1,887,600
東芝テック	1,500	3,410.00	5,115,000
芝浦メカトロニクス	200	3,510.00	702,000
マブチモーター	3,400	4,075.00	13,855,000
日本電産	14,900	14,405.00	214,634,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	2,176.00	1,523,200

トレックス・セミコンダクター	400	1,386.00	554,400
東光高岳	600	1,654.00	992,400
ダブル・スコープ	1,800	1,092.00	1,965,600
ダイヘン	1,400	2,774.00	3,883,600
ヤーマン	1,800	1,928.00	3,470,400
JVCケンウッド	9,100	322.00	2,930,200
ミマキエンジニアリング	1,100	1,020.00	1,122,000
第一精工	500	1,499.00	749,500
日新電機	2,900	893.00	2,589,700
大崎電気工業	2,500	809.00	2,022,500
オムロン	13,100	4,715.00	61,766,500
日東工業	2,000	2,012.00	4,024,000
I D E C	1,700	2,488.00	4,229,600
不二電機工業	200	1,337.00	267,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,500	2,421.00	10,894,500
サクサホールディングス	300	2,041.00	612,300
メルコホールディングス	500	3,820.00	1,910,000
テクノメディカ	300	2,018.00	605,400
日本電気	16,000	3,455.00	55,280,000
富士通	11,900	6,991.00	83,192,900
沖電気工業	5,400	1,532.00	8,272,800
岩崎通信機	600	800.00	480,000
電気興業	700	2,796.00	1,957,200
サンケン電気	1,400	2,752.00	3,852,800
ナカヨ	300	1,551.00	465,300
アイホン	700	1,525.00	1,067,500
ルネサスエレクトロニクス	12,800	643.00	8,230,400
セイコーエプソン	15,400	1,870.00	28,798,000
ワコム	9,000	607.00	5,463,000
アルバック	2,800	3,965.00	11,102,000
アクセル	500	637.00	318,500
E I Z O	1,100	3,950.00	4,345,000
ジャパンディスプレイ	29,500	105.00	3,097,500
日本信号	3,200	1,028.00	3,289,600
京三製作所	2,700	534.00	1,441,800
能美防災	1,600	2,393.00	3,828,800
ホーチキ	800	1,308.00	1,046,400
星和電機	500	476.00	238,000
エレコム	1,100	2,662.00	2,928,200
パナソニック	141,400	1,179.00	166,710,600
シャープ	12,300	1,784.00	21,943,200
アンリツ	8,000	1,825.00	14,600,000



富士通ゼネラル	3,800	1,632.00	6,201,600
ソニー	83,000	6,090.00	505,470,000
T D K	6,500	10,020.00	65,130,000
帝国通信工業	500	1,222.00	611,000
タムラ製作所	4,800	582.00	2,793,600
アルプス電気	11,400	2,598.00	29,617,200
池上通信機	400	1,306.00	522,400
パイオニア	21,200	96.00	2,035,200
日本電波工業	1,200	541.00	649,200
鈴木	600	762.00	457,200
日本トリム	200	6,160.00	1,232,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,379.00	1,427,400
フォスター電機	1,500	1,661.00	2,491,500
クラリオン	1,100	2,473.00	2,720,300
S M K	400	2,561.00	1,024,400
ヨコオ	900	1,276.00	1,148,400
ホシデン	3,700	944.00	3,492,800
ヒロセ電機	1,800	11,810.00	21,258,000
日本航空電子工業	2,800	1,474.00	4,127,200
T O A	1,300	1,168.00	1,518,400
マクセルホールディングス	2,700	1,571.00	4,241,700
古野電気	1,600	1,314.00	2,102,400
ユニデンホールディングス	400	2,650.00	1,060,000
アルパイン	2,100	1,872.00	3,931,200
スミダコーポレーション	1,100	1,485.00	1,633,500
アイコム	700	2,445.00	1,711,500
リオン	600	2,217.00	1,330,200
本多通信工業	1,100	641.00	705,100
船井電機	1,300	617.00	802,100
横河電機	12,400	2,171.00	26,920,400
新電元工業	400	4,680.00	1,872,000
アズビル	8,000	2,241.00	17,928,000
東亜ディーケーケー	600	1,101.00	660,600
日本光電工業	5,400	3,250.00	17,550,000
チノー	400	1,299.00	519,600
共和電業	1,300	412.00	535,600
日本電子材料	500	794.00	397,000
堀場製作所	2,500	5,510.00	13,775,000
アドバンテスト	8,400	2,450.00	20,580,000
小野測器	600	747.00	448,200
エスベック	1,100	2,030.00	2,233,000
キーエンス	6,100	61,430.00	374,723,000

日置電機	600	4,170.00	2,502,000
シスメックス	9,700	7,898.00	76,610,600
日本マイクロニクス	2,000	758.00	1,516,000
メガチップス	1,000	2,341.00	2,341,000
O B A R A G R O U P	700	4,705.00	3,293,500
澤藤電機	200	1,981.00	396,200
原田工業	400	822.00	328,800
コーセル	1,700	1,206.00	2,050,200
イリソ電子工業	1,100	5,130.00	5,643,000
オブテックスグループ	2,200	2,261.00	4,974,200
千代田インテグレ	500	2,260.00	1,130,000
アイ・オー・データ機器	500	1,287.00	643,500
レーザーテック	2,600	3,460.00	8,996,000
スタンレー電気	8,800	3,390.00	29,832,000
岩崎電気	500	1,535.00	767,500
ウシオ電機	7,500	1,322.00	9,915,000
岡谷電機産業	900	461.00	414,900
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	795.00	874,500
日本セラミック	1,200	2,982.00	3,578,400
遠藤照明	600	837.00	502,200
古河電池	900	826.00	743,400
双信電機	600	431.00	258,600
山一電機	900	1,243.00	1,118,700
図研	800	1,850.00	1,480,000
日本電子	2,400	1,858.00	4,459,200
カシオ計算機	11,000	1,744.00	19,184,000
ファナック	11,800	21,205.00	250,219,000
日本シイエムケイ	3,200	758.00	2,425,600
エンプラス	600	3,210.00	1,926,000
大真空	500	1,181.00	590,500
ローム	6,000	8,290.00	49,740,000
浜松ホトニクス	8,900	3,810.00	33,909,000
三井ハイテック	1,400	1,240.00	1,736,000
新光電気工業	4,100	825.00	3,382,500
京セラ	18,900	6,278.00	118,654,200
太陽誘電	5,500	2,550.00	14,025,000
村田製作所	13,000	18,885.00	245,505,000
ユーシン	2,000	768.00	1,536,000
双葉電子工業	2,000	1,748.00	3,496,000
北陸電気工業	500	1,181.00	590,500
ニチコン	3,900	930.00	3,627,000
日本ケミコン	900	2,754.00	2,478,600

K O A	1,900	1,677.00	3,186,300	
市光工業	1,900	808.00	1,535,200	
小糸製作所	7,400	5,580.00	41,292,000	
ミツバ	2,300	963.00	2,214,900	
S C R E E Nホールディングス	2,100	6,070.00	12,747,000	
キャノン電子	1,100	2,120.00	2,332,000	
キャノン	66,600	3,250.00	216,450,000	代用有価証券 10,000株
リコー	37,200	1,145.00	42,594,000	
象印マホービン	2,300	1,207.00	2,776,100	
M U T O Hホールディングス	200	2,249.00	449,800	
東京エレクトロン	8,200	15,605.00	127,961,000	
トヨタ紡織	4,300	1,930.00	8,299,000	
芦森工業	300	1,938.00	581,400	
ユニプレス	2,400	2,141.00	5,138,400	
豊田自動織機	10,000	5,610.00	56,100,000	
モリタホールディングス	2,200	2,083.00	4,582,600	
三櫻工業	1,600	667.00	1,067,200	
デンソー	27,500	5,144.00	141,460,000	
東海理化電機製作所	3,300	2,148.00	7,088,400	
三井E & Sホールディングス	4,500	1,392.00	6,264,000	
川崎重工業	9,600	2,725.00	26,160,000	
名村造船所	3,800	558.00	2,120,400	
サノヤスホールディングス	1,700	222.00	377,400	
日本車輛製造	500	2,515.00	1,257,500	
三菱ロジスネクスト	1,500	1,291.00	1,936,500	
近畿車輛	200	2,260.00	452,000	
日産自動車	145,900	1,032.50	150,641,750	
いすゞ自動車	39,200	1,552.00	60,838,400	
トヨタ自動車	138,000	6,630.00	914,940,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	15,500	1,101.00	17,065,500	
三菱自動車工業	45,900	725.00	33,277,500	
エフテック	900	1,151.00	1,035,900	
レシップホールディングス	500	749.00	374,500	
G M B	300	1,155.00	346,500	
ファルテック	200	986.00	197,200	
武蔵精密工業	2,900	1,742.00	5,051,800	
日産車体	2,400	969.00	2,325,600	
新明和工業	5,800	1,415.00	8,207,000	
極東開発工業	2,500	1,651.00	4,127,500	
日信工業	2,300	1,575.00	3,622,500	
トビー工業	1,000	2,678.00	2,678,000	

ティラド	500	2,669.00	1,334,500
曙ブレーキ工業	7,000	238.00	1,666,000
タチエス	2,100	1,620.00	3,402,000
N O K	6,600	1,693.00	11,173,800
フタバ産業	3,500	684.00	2,394,000
K Y B	1,100	2,891.00	3,180,100
大同メタル工業	2,000	889.00	1,778,000
プレス工業	6,100	534.00	3,257,400
ミクニ	1,600	645.00	1,032,000
太平洋工業	2,600	1,593.00	4,141,800
ケーヒン	2,800	2,082.00	5,829,600
河西工業	1,500	1,028.00	1,542,000
アイシン精機	10,200	4,330.00	44,166,000
マツダ	38,800	1,229.50	47,704,600
今仙電機製作所	1,200	1,038.00	1,245,600
本田技研工業	104,400	3,317.00	346,294,800
スズキ	22,700	5,505.00	124,963,500
S U B A R U	38,400	2,947.00	113,164,800
安永	600	1,820.00	1,092,000
ヤマハ発動機	17,500	2,321.00	40,617,500
ショーワ	2,900	1,540.00	4,466,000
T B K	1,500	450.00	675,000
エクセディ	1,700	2,900.00	4,930,000
豊田合成	4,000	2,410.00	9,640,000
愛三工業	1,900	871.00	1,654,900
盟和産業	200	1,148.00	229,600
日本プラスト	1,000	909.00	909,000
ヨロズ	1,200	1,625.00	1,950,000
エフ・シー・シー	2,200	2,924.00	6,432,800
シマノ	5,000	15,010.00	75,050,000
テイ・エス テック	2,900	3,450.00	10,005,000
ジャムコ	600	2,887.00	1,732,200
テルモ	17,500	6,355.00	111,212,500
クリエートメディック	400	1,136.00	454,400
日機装	4,000	1,324.00	5,296,000
島津製作所	15,900	2,885.00	45,871,500
J M S	1,200	572.00	686,400
長野計器	1,000	984.00	984,000
ブイ・テクノロジー	300	14,790.00	4,437,000
東京計器	800	1,057.00	845,600
愛知時計電機	200	3,915.00	783,000
インターアクション	700	2,174.00	1,521,800

オーバル	1,200	272.00	326,400
東京精密	2,200	2,888.00	6,353,600
マニー	1,500	5,090.00	7,635,000
ニコン	21,600	1,995.00	43,092,000
トプコン	6,700	1,595.00	10,686,500
オリンパス	18,500	3,760.00	69,560,000
理研計器	1,100	2,307.00	2,537,700
タムロン	1,100	1,901.00	2,091,100
H O Y A	24,900	6,700.00	166,830,000
シード	500	1,742.00	871,000
ノーリツ鋼機	1,000	2,448.00	2,448,000
エー・アンド・デイ	1,100	830.00	913,000
朝日インテック	4,500	4,755.00	21,397,500
シチズン時計	13,500	674.00	9,099,000
リズム時計工業	400	1,971.00	788,400
大研医器	1,000	769.00	769,000
メニコン	1,700	2,534.00	4,307,800
シンシア	200	564.00	112,800
松風	600	1,255.00	753,000
セイコーホールディングス	1,900	2,858.00	5,430,200
ニプロ	8,600	1,433.00	12,323,800
中本パックス	400	1,831.00	732,400
スノーピーク	400	1,513.00	605,200
パラマウントベッドホールディングス	1,400	4,665.00	6,531,000
トランザクション	700	838.00	586,600
S H O - B I	400	391.00	156,400
ニホンフラッシュ	500	2,007.00	1,003,500
前田工織	1,400	2,517.00	3,523,800
永大産業	1,600	472.00	755,200
アートネイチャー	1,300	667.00	867,100
バンダイナムコホールディングス	12,800	4,155.00	53,184,000
アイフィスジャパン	300	740.00	222,000
共立印刷	2,100	268.00	562,800
S H O E I	600	4,605.00	2,763,000
フランスベッドホールディングス	1,700	949.00	1,613,300
パイロットコーポレーション	2,200	5,690.00	12,518,000
萩原工業	700	1,683.00	1,178,100
トッパン・フォームズ	2,600	992.00	2,579,200
フジシールインターナショナル	2,800	3,415.00	9,562,000
タカラトミー	5,200	1,301.00	6,765,200
廣済堂	1,200	453.00	543,600
エステールホールディングス	300	709.00	212,700

アーク	4,900	99.00	485,100
タカノ	500	900.00	450,000
プロネクサス	1,100	1,073.00	1,180,300
ホクシン	1,100	153.00	168,300
ウッドワン	400	1,224.00	489,600
大建工業	900	2,097.00	1,887,300
凸版印刷	17,400	1,622.00	28,222,800
大日本印刷	17,400	2,567.00	44,665,800
図書印刷	1,200	827.00	992,400
共同印刷	400	2,602.00	1,040,800
N I S S H A	2,600	1,886.00	4,903,600
光村印刷	100	2,234.00	223,400
宝印刷	700	1,793.00	1,255,100
アシックス	12,300	1,485.00	18,265,500
ツツミ	400	2,159.00	863,600
小松ウオール工業	400	2,126.00	850,400
ヤマハ	7,400	5,260.00	38,924,000
河合楽器製作所	400	4,125.00	1,650,000
クリナップ	1,100	658.00	723,800
ピジョン	7,500	5,030.00	37,725,000
兼松サステック	100	1,819.00	181,900
キングジム	1,000	888.00	888,000
リンテック	2,900	2,729.00	7,914,100
イトーキ	2,300	606.00	1,393,800
任天堂	7,600	35,340.00	268,584,000
三菱鉛筆	2,000	2,003.00	4,006,000
タカラスタンダード	2,500	1,762.00	4,405,000
コクヨ	5,900	1,772.00	10,454,800
ナカバヤシ	1,200	599.00	718,800
グローブライド	600	2,794.00	1,676,400
オカムラ	4,300	1,598.00	6,871,400
美津濃	1,200	2,660.00	3,192,000
東京電力ホールディングス	99,000	576.00	57,024,000
中部電力	38,000	1,585.50	60,249,000
関西電力	50,600	1,709.00	86,475,400
中国電力	17,200	1,371.00	23,581,200
北陸電力	12,200	976.00	11,907,200
東北電力	29,100	1,425.00	41,467,500
四国電力	11,200	1,282.00	14,358,400
九州電力	25,600	1,317.00	33,715,200
北海道電力	11,700	673.00	7,874,100
沖縄電力	2,300	2,011.00	4,625,300

電源開発	9,900	2,855.00	28,264,500
エフオン	800	1,103.00	882,400
イーレックス	2,200	962.00	2,116,400
東京瓦斯	24,300	2,708.00	65,804,400
大阪瓦斯	24,100	2,045.00	49,284,500
東邦瓦斯	6,100	3,985.00	24,308,500
北海道瓦斯	700	1,410.00	987,000
広島ガス	2,700	351.00	947,700
西部瓦斯	1,400	2,467.00	3,453,800
静岡ガス	3,800	968.00	3,678,400
メタウォーター	600	3,030.00	1,818,000
SBSホールディングス	1,200	1,446.00	1,735,200
東武鉄道	13,100	3,110.00	40,741,000
相鉄ホールディングス	4,300	3,365.00	14,469,500
東京急行電鉄	33,700	1,850.00	62,345,000
京浜急行電鉄	17,000	1,689.00	28,713,000
小田急電鉄	19,900	2,336.00	46,486,400
京王電鉄	6,900	5,980.00	41,262,000
京成電鉄	9,300	3,435.00	31,945,500
富士急行	1,700	2,980.00	5,066,000
東日本旅客鉄道	22,000	9,970.00	219,340,000
西日本旅客鉄道	11,100	7,557.00	83,882,700
東海旅客鉄道	11,100	21,320.00	236,652,000
西武ホールディングス	15,800	2,029.00	32,058,200
鴻池運輸	2,000	1,720.00	3,440,000
西日本鉄道	3,400	2,800.00	9,520,000
ハマキョウレックス	1,000	3,705.00	3,705,000
サカイ引越センター	600	5,810.00	3,486,000
近鉄グループホールディングス	11,700	4,355.00	50,953,500
阪急阪神ホールディングス	15,700	3,750.00	58,875,000
南海電気鉄道	5,300	2,691.00	14,262,300
京阪ホールディングス	5,200	4,435.00	23,062,000
神戸電鉄	300	3,950.00	1,185,000
名古屋鉄道	9,400	2,725.00	25,615,000
山陽電気鉄道	900	2,421.00	2,178,900
日本通運	4,600	7,170.00	32,982,000
ヤマトホールディングス	20,600	2,837.50	58,452,500
山九	3,200	5,580.00	17,856,000
丸運	700	316.00	221,200
丸全昭和運輸	900	2,895.00	2,605,500
センコーグループホールディングス	6,500	868.00	5,642,000
トナミホールディングス	300	6,180.00	1,854,000

ニッコンホールディングス	4,400	2,840.00	12,496,000
日本石油輸送	200	2,817.00	563,400
福山通運	1,500	4,405.00	6,607,500
セイノーホールディングス	8,800	1,578.00	13,886,400
エスライン	400	1,235.00	494,000
神奈川中央交通	300	3,730.00	1,119,000
日立物流	2,600	2,920.00	7,592,000
丸和運輸機関	600	3,590.00	2,154,000
C & F ロジホールディングス	1,200	1,350.00	1,620,000
九州旅客鉄道	9,800	3,410.00	33,418,000
S Gホールディングス	11,100	2,668.00	29,614,800
日本郵船	9,800	1,924.00	18,855,200
商船三井	7,000	2,801.00	19,607,000
川崎汽船	3,600	1,649.00	5,936,400
N S ユナイテッド海運	600	2,853.00	1,711,800
明治海運	1,300	396.00	514,800
飯野海運	5,600	508.00	2,844,800
共栄タンカー	100	1,883.00	188,300
乾汽船	1,100	1,001.00	1,101,100
日本航空	21,500	3,920.00	84,280,000
A N Aホールディングス	21,400	3,859.00	82,582,600
パスコ	200	1,215.00	243,000
トランコム	300	6,300.00	1,890,000
日新	1,000	2,149.00	2,149,000
三菱倉庫	4,100	2,668.00	10,938,800
三井倉庫ホールディングス	1,400	1,905.00	2,667,000
住友倉庫	4,400	1,364.00	6,001,600
澁澤倉庫	700	1,599.00	1,119,300
東陽倉庫	2,100	310.00	651,000
日本トランスシティ	2,600	468.00	1,216,800
ケイヒン	200	1,440.00	288,000
中央倉庫	700	1,056.00	739,200
川西倉庫	300	1,623.00	486,900
安田倉庫	1,000	869.00	869,000
東洋埠頭	400	1,518.00	607,200
宇徳	1,000	534.00	534,000
上組	7,200	2,313.00	16,653,600
サンリツ	300	700.00	210,000
キムラユニティー	300	1,133.00	339,900
キューソー流通システム	300	2,577.00	773,100
近鉄エクスプレス	2,200	1,815.00	3,993,000
東海運	700	303.00	212,100



エーアイティー	800	1,083.00	866,400
内外トランスライン	400	1,692.00	676,800
日本コンセプト	300	1,112.00	333,600
NEC ネットエスアイ	1,400	2,490.00	3,486,000
システナ	4,300	1,377.00	5,921,100
デジタルアーツ	700	5,640.00	3,948,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,800	3,295.00	5,931,000
キューブシステム	700	817.00	571,900
エイジア	300	1,325.00	397,500
コア	500	1,401.00	700,500
ソリトンシステムズ	700	954.00	667,800
ソフトクリエイティブホールディングス	500	1,628.00	814,000
T I S	4,000	5,200.00	20,800,000
ネオス	400	1,190.00	476,000
電算システム	500	2,298.00	1,149,000
グリー	6,500	473.00	3,074,500
コーエーテクモホールディングス	2,500	1,820.00	4,550,000
三菱総合研究所	500	3,940.00	1,970,000
ボルテージ	300	669.00	200,700
電算	200	2,096.00	419,200
A G S	700	761.00	532,700
ファインデックス	1,000	675.00	675,000
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,825.00	547,500
ブレインパッド	300	5,050.00	1,515,000
K L a b	2,200	1,090.00	2,398,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	800	2,386.00	1,908,800
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,743.00	348,600
ネクソン	30,900	1,315.00	40,633,500
アイスタイル	3,100	1,096.00	3,397,600
エムアップ	400	2,228.00	891,200
エイチーム	800	1,916.00	1,532,800
テクノスジャパン	1,000	917.00	917,000
コロプラ	3,500	730.00	2,555,000
オルトプラス	800	456.00	364,800
ブロードリーフ	6,000	656.00	3,936,000
クロス・マーケティンググループ	400	472.00	188,800
デジタルハーツホールディングス	600	1,412.00	847,200
メディアドゥホールディングス	400	2,346.00	938,400
じげん	1,300	706.00	917,800
ブイキューブ	700	524.00	366,800
サイバーリンクス	200	1,082.00	216,400
ディー・エル・イー	800	282.00	225,600

フィックスターズ	1,200	1,234.00	1,480,800
VOYAGE GROUP	700	1,560.00	1,092,000
オブティム	300	3,590.00	1,077,000
セレス	400	2,090.00	836,000
ベリサーブ	100	6,080.00	608,000
ティーガイア	1,200	2,459.00	2,950,800
セック	200	4,840.00	968,000
日本アジアグループ	1,300	397.00	516,100
豆蔵ホールディングス	800	970.00	776,000
テクマトリックス	900	1,872.00	1,684,800
プロシップ	200	2,505.00	501,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,400	236.00	6,938,400
GMOペイメントゲートウェイ	2,000	5,680.00	11,360,000
ザッパラス	600	384.00	230,400
システムリサーチ	200	3,745.00	749,000
インターネットイニシアティブ	2,000	2,377.00	4,754,000
さくらインターネット	1,500	548.00	822,000
ヴィンクス	400	1,325.00	530,000
GMOクラウド	300	3,130.00	939,000
SRAホールディングス	600	3,095.00	1,857,000
Minor iソリューションズ	300	1,537.00	461,100
システムインテグレータ	200	2,102.00	420,400
朝日ネット	1,000	508.00	508,000
eBASE	400	1,537.00	614,800
アバント	300	1,364.00	409,200
アドソル日進	400	2,100.00	840,000
フリービット	800	878.00	702,400
コムチュア	700	3,495.00	2,446,500
サイバーコム	200	1,730.00	346,000
アステリア	600	932.00	559,200
マークライنز	400	1,676.00	670,400
メディカル・データ・ビジョン	1,100	1,724.00	1,896,400
gumi	1,400	667.00	933,800
ショーケース・ティービー	300	994.00	298,200
モバイルファクトリー	400	1,383.00	553,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,393.00	696,500
PCIホールディングス	200	2,985.00	597,000
パイブドHD	200	1,037.00	207,400
アイビーシー	200	1,302.00	260,400
ネオジャパン	200	927.00	185,400
PR TIMES	100	2,073.00	207,300
ランドコンピュータ	200	1,080.00	216,000

オープンドア	600	2,589.00	1,553,400
マイネット	400	1,120.00	448,000
アカツキ	400	5,500.00	2,200,000
ベネフィットジャパン	100	759.00	75,900
U b i c o mホールディングス	200	1,013.00	202,600
L I N E	3,700	3,510.00	12,987,000
カナミックネットワーク	200	2,043.00	408,600
チェンジ	100	4,735.00	473,500
シンクロ・フード	500	752.00	376,000
オークネット	600	1,189.00	713,400
A O I T Y O H o l d i n g s	1,300	1,272.00	1,653,600
マクロミル	1,500	2,148.00	3,222,000
ビーグリー	200	1,341.00	268,200
オロ	100	5,050.00	505,000
ソルクシーズ	500	855.00	427,500
フェイス	500	1,252.00	626,000
ハイマックス	200	1,801.00	360,200
野村総合研究所	7,700	5,110.00	39,347,000
サイバネットシステム	1,000	631.00	631,000
C E ホールディングス	300	770.00	231,000
日本システム技術	200	2,003.00	400,600
インテージホールディングス	1,600	997.00	1,595,200
東邦システムサイエンス	400	843.00	337,200
ソースネクスト	2,300	1,181.00	2,716,300
F I G	1,100	437.00	480,700
フォーカスシステムズ	800	924.00	739,200
クレスコ	400	3,365.00	1,346,000
フジ・メディア・ホールディングス	12,600	1,738.00	21,898,800
オービック	4,200	9,980.00	41,916,000
ジャストシステム	1,700	2,323.00	3,949,100
T D C ソフト	1,100	1,005.00	1,105,500
ヤフー	79,100	327.00	25,865,700
トレンドマイクロ	6,500	6,580.00	42,770,000
インフォメーション・ディベロプメント	400	1,483.00	593,200
日本オラクル	2,000	7,480.00	14,960,000
アルファシステムズ	400	2,760.00	1,104,000
フューチャー	1,700	1,669.00	2,837,300
C A C H o l d i n g s	900	1,013.00	911,700
ソフトバンク・テクノロジー	500	2,060.00	1,030,000
トーセ	300	968.00	290,400
オービックビジネスコンサルタント	600	9,460.00	5,676,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,500	1,997.00	10,983,500

アイティフォー	1,500	809.00	1,213,500	
東計電算	200	3,315.00	663,000	
エクスネット	200	926.00	185,200	
大塚商会	6,600	3,960.00	26,136,000	
サイボウズ	1,400	713.00	998,200	
ソフトブレーン	1,000	577.00	577,000	
電通国際情報サービス	800	4,075.00	3,260,000	
デジタルガレージ	2,400	3,315.00	7,956,000	
E Mシステムズ	1,000	1,185.00	1,185,000	
ウェザーニューズ	400	3,365.00	1,346,000	
C I J	900	750.00	675,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,040.00	204,000	
日本エンタープライズ	1,500	233.00	349,500	
WOWOW	600	3,305.00	1,983,000	
スカラ	1,000	947.00	947,000	
I M A G I C A G R O U P	1,000	576.00	576,000	
ネットワンシステムズ	4,300	2,354.00	10,122,200	
システムソフト	3,000	128.00	384,000	
アルゴグラフィックス	500	4,240.00	2,120,000	
マーベラス	1,800	945.00	1,701,000	
エイベックス	2,100	1,526.00	3,204,600	
日本ユニシス	3,800	2,428.00	9,226,400	
兼松エレクトロニクス	700	3,775.00	2,642,500	
東京放送ホールディングス	8,000	2,064.00	16,512,000	
日本テレビホールディングス	11,100	1,800.00	19,980,000	
朝日放送グループホールディングス	1,200	775.00	930,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,300	2,124.00	7,009,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	9,200	515.00	4,738,000	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,620.00	2,620,000	
日本BS放送	400	1,225.00	490,000	
ビジョン	400	3,780.00	1,512,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	500	1,060.00	530,000	
ワイヤレスゲート	600	581.00	348,600	
コネクシオ	900	1,573.00	1,415,700	
クロップス	200	804.00	160,800	
日本電信電話	83,100	4,288.00	356,332,800	
K D D I	107,200	2,433.00	260,817,600	
光通信	1,400	18,800.00	26,320,000	
N T T ドコモ	87,300	2,526.00	220,519,800	
エムティーアイ	1,400	597.00	835,800	
G M O インターネット	4,400	1,685.00	7,414,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	300	557.00	167,100	

カドカワ	3,500	1,157.00	4,049,500
学研ホールディングス	400	5,970.00	2,388,000
ゼンリン	2,400	2,781.00	6,674,400
昭文社	600	563.00	337,800
インプレスホールディングス	1,200	168.00	201,600
アイネット	700	1,579.00	1,105,300
松竹	800	11,090.00	8,872,000
東宝	8,000	3,660.00	29,280,000
東映	500	12,370.00	6,185,000
エヌ・ティ・ティ・データ	32,300	1,378.00	44,509,400
ピー・シー・エー	200	1,875.00	375,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,167.00	433,400
D T S	1,300	4,080.00	5,304,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,600	4,005.00	22,428,000
シーイーシー	1,300	2,422.00	3,148,600
カプコン	5,200	2,388.00	12,417,600
アイ・エス・ビー	300	2,361.00	708,300
ジャステック	700	1,110.00	777,000
S C S K	3,200	4,650.00	14,880,000
日本システムウエア	400	2,307.00	922,800
アイネス	1,500	1,250.00	1,875,000
T K C	1,000	4,045.00	4,045,000
富士ソフト	1,800	5,010.00	9,018,000
N S D	2,000	2,398.00	4,796,000
コナミホールディングス	5,000	4,750.00	23,750,000
福井コンピュータホールディングス	400	1,764.00	705,600
J B C Cホールディングス	1,000	1,548.00	1,548,000
ミロク情報サービス	1,200	2,414.00	2,896,800
ソフトバンクグループ	50,800	8,575.00	435,610,000
ハウスイ	100	965.00	96,500
高千穂交易	500	1,093.00	546,500
伊藤忠食品	300	5,200.00	1,560,000
エレマテック	600	2,345.00	1,407,000
J A L U X	300	2,761.00	828,300
あらた	700	4,500.00	3,150,000
トーメンデバイス	200	2,520.00	504,000
東京エレクトロン デバイス	400	2,030.00	812,000
フィールズ	1,100	886.00	974,600
双日	67,400	413.00	27,836,200
アルフレッサ ホールディングス	13,600	3,010.00	40,936,000
横浜冷凍	3,200	919.00	2,940,800
神栄	200	1,092.00	218,400

ラサ商事	600	943.00	565,800
ラクーンホールディングス	800	617.00	493,600
アルコニックス	1,300	1,387.00	1,803,100
神戸物産	1,800	2,891.00	5,203,800
あい ホールディングス	2,000	2,167.00	4,334,000
ディーブイエックス	500	1,279.00	639,500
ダイワボウホールディングス	1,100	6,550.00	7,205,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,400	1,705.00	5,797,000
ラクト・ジャパン	300	6,890.00	2,067,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,220.00	2,806,000
八洲電機	900	813.00	731,700
メディアスホールディングス	700	856.00	599,200
U K Cホールディングス	800	2,322.00	1,857,600
ジューテックホールディングス	300	1,040.00	312,000
大光	300	702.00	210,600
O C H Iホールディングス	400	1,257.00	502,800
T O K A Iホールディングス	6,400	934.00	5,977,600
黒谷	200	501.00	100,200
C o m i n i x	200	858.00	171,600
三洋貿易	600	1,822.00	1,093,200
ビューティガレージ	200	1,725.00	345,000
ウイン・パートナーズ	800	1,174.00	939,200
ミタチ産業	300	792.00	237,600
シップヘルスケアホールディングス	2,500	4,110.00	10,275,000
明治電機工業	400	2,129.00	851,600
デリカフーズホールディングス	200	1,486.00	297,200
スターティアホールディングス	300	625.00	187,500
コメダホールディングス	2,800	2,243.00	6,280,400
富士興産	500	619.00	309,500
協栄産業	200	1,723.00	344,600
小野建	1,100	1,652.00	1,817,200
佐島電機	900	1,014.00	912,600
エコートレーディング	300	651.00	195,300
伯東	800	1,368.00	1,094,400
コンドーテック	900	1,031.00	927,900
中山福	700	562.00	393,400
ナガイレーベン	1,800	2,553.00	4,595,400
三菱食品	1,300	3,000.00	3,900,000
松田産業	900	1,426.00	1,283,400
第一興商	1,800	5,340.00	9,612,000
メディバルホールディングス	13,200	2,551.00	33,673,200
S P K	300	2,366.00	709,800

萩原電気ホールディングス	500	3,015.00	1,507,500
アズワン	900	8,390.00	7,551,000
スズデン	400	1,340.00	536,000
シモジマ	800	1,025.00	820,000
ドウシシャ	1,100	2,007.00	2,207,700
小津産業	300	1,926.00	577,800
高速	700	1,105.00	773,500
たけびし	400	1,550.00	620,000
リックス	300	1,666.00	499,800
丸文	1,100	781.00	859,100
ハピネット	1,000	1,777.00	1,777,000
橋本総業ホールディングス	200	1,407.00	281,400
日本ライフライン	3,800	1,714.00	6,513,200
タカショー	600	479.00	287,400
エクセル	400	1,944.00	777,600
マルカキカイ	400	2,319.00	927,600
I D O M	4,100	380.00	1,558,000
日本エム・ディ・エム	700	1,422.00	995,400
進和	700	2,338.00	1,636,600
エスケイジャパン	300	911.00	273,300
ダイトロン	600	1,675.00	1,005,000
シークス	1,600	1,600.00	2,560,000
田中商事	400	666.00	266,400
オーハシテクニカ	700	1,422.00	995,400
白銅	400	1,797.00	718,800
伊藤忠商事	89,500	2,088.00	186,876,000
丸紅	120,200	894.40	107,506,880
高島	200	1,964.00	392,800
長瀬産業	6,800	1,683.00	11,444,400
蝶理	800	1,881.00	1,504,800
豊田通商	13,600	4,075.00	55,420,000
三共生興	2,100	450.00	945,000
兼松	4,900	1,482.00	7,261,800
ツカモトコーポレーション	200	1,153.00	230,600
三井物産	100,400	1,905.50	191,312,200
日本紙パルプ商事	700	4,525.00	3,167,500
日立ハイテクノロジーズ	3,700	4,180.00	15,466,000
カメイ	1,600	1,336.00	2,137,600
東都水産	200	2,112.00	422,400
O U Gホールディングス	200	2,646.00	529,200
スターゼン	500	4,510.00	2,255,000
山善	4,800	1,201.00	5,764,800

椿本興業	300	3,495.00	1,048,500
住友商事	72,100	1,758.00	126,751,800
内田洋行	600	2,725.00	1,635,000
三菱商事	85,600	3,204.00	274,262,400
第一実業	600	3,860.00	2,316,000
キャノンマーケティングジャパン	3,500	2,132.00	7,462,000
西華産業	700	1,842.00	1,289,400
佐藤商事	1,100	1,081.00	1,189,100
菱洋エレクトロ	1,200	1,678.00	2,013,600
東京産業	1,200	629.00	754,800
ユアサ商事	1,300	3,625.00	4,712,500
神鋼商事	300	2,883.00	864,900
小林産業	800	310.00	248,000
阪和興業	2,100	3,765.00	7,906,500
正栄食品工業	600	4,400.00	2,640,000
カナデン	1,200	1,252.00	1,502,400
菱電商事	1,000	1,571.00	1,571,000
フルサト工業	700	1,874.00	1,311,800
岩谷産業	2,700	3,870.00	10,449,000
すてきナイスグループ	500	1,163.00	581,500
昭光通商	500	834.00	417,000
ニチモウ	200	1,579.00	315,800
極東貿易	400	1,967.00	786,800
イワキ	1,500	542.00	813,000
三愛石油	3,300	1,262.00	4,164,600
稲畑産業	2,900	1,634.00	4,738,600
G S Iクレオス	300	1,491.00	447,300
明和産業	1,100	436.00	479,600
ワキタ	2,600	1,226.00	3,187,600
東邦ホールディングス	3,600	3,050.00	10,980,000
サンゲツ	3,700	2,209.00	8,173,300
ミツウロコグループホールディングス	1,700	734.00	1,247,800
シナネンホールディングス	500	2,673.00	1,336,500
伊藤忠エネクス	2,700	1,091.00	2,945,700
サンリオ	3,800	2,193.00	8,333,400
サンワテクノス	800	1,363.00	1,090,400
リョーサン	1,300	3,525.00	4,582,500
新光商事	1,100	1,731.00	1,904,100
トーヨー	600	2,332.00	1,399,200
三信電気	1,000	1,991.00	1,991,000
東陽テクニカ	1,400	917.00	1,283,800
モスフードサービス	1,600	3,070.00	4,912,000



加賀電子	1,200	2,436.00	2,923,200
ソーダニッカ	1,300	681.00	885,300
立花エレテック	900	1,800.00	1,620,000
フォーバル	500	1,033.00	516,500
PALTAC	2,200	5,610.00	12,342,000
三谷産業	1,500	324.00	486,000
太平洋興発	500	905.00	452,500
西本Wismettacホールディングス	300	5,140.00	1,542,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,257.00	125,700
国際紙パルプ商事	2,200	334.00	734,800
ヤマタネ	600	1,845.00	1,107,000
丸紅建材リース	100	2,166.00	216,600
日鉄住金物産	900	5,250.00	4,725,000
泉州電業	400	2,573.00	1,029,200
トラスコ中山	2,500	2,660.00	6,650,000
オートバックスセブン	4,800	1,775.00	8,520,000
モリト	900	841.00	756,900
加藤産業	1,900	3,560.00	6,764,000
イノテック	800	1,248.00	998,400
イエローハット	1,200	2,858.00	3,429,600
JKホールディングス	1,100	703.00	773,300
日伝	1,000	1,794.00	1,794,000
北沢産業	1,000	250.00	250,000
杉本商事	700	1,876.00	1,313,200
因幡電機産業	1,700	4,670.00	7,939,000
バイテックホールディングス	600	2,327.00	1,396,200
東テク	400	2,769.00	1,107,600
ミスミグループ本社	15,300	2,362.00	36,138,600
アルテック	1,000	272.00	272,000
タキヒヨー	400	1,948.00	779,200
蔵王産業	200	1,453.00	290,600
スズケン	5,500	5,950.00	32,725,000
ジェコス	800	1,100.00	880,000
ルネサスイーストン	1,100	459.00	504,900
ローソン	3,100	7,310.00	22,661,000
サンエー	900	4,730.00	4,257,000
カワチ薬品	900	2,092.00	1,882,800
エービーシー・マート	1,900	6,330.00	12,027,000
ハードオフコーポレーション	500	936.00	468,000
アスクル	1,100	3,015.00	3,316,500
ゲオホールディングス	1,900	1,700.00	3,230,000
アダストリア	1,700	1,978.00	3,362,600

ジーフット	700	753.00	527,100
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	755.00	151,000
くらコーポレーション	700	6,820.00	4,774,000
キャンドウ	600	1,666.00	999,600
パルグループホールディングス	600	3,300.00	1,980,000
エディオン	5,200	1,123.00	5,839,600
サーラコーポレーション	2,500	664.00	1,660,000
ワッツ	400	855.00	342,000
ハローズ	500	2,465.00	1,232,500
あみやき亭	300	4,065.00	1,219,500
ひらまつ	2,500	470.00	1,175,000
大黒天物産	300	4,035.00	1,210,500
ハニーズホールディングス	1,200	904.00	1,084,800
ファーマライズホールディングス	300	632.00	189,600
アルペン	900	1,952.00	1,756,800
ハブ	400	910.00	364,000
クオールホールディングス	1,800	2,057.00	3,702,600
ジーンズ	800	6,760.00	5,408,000
ビックカメラ	6,500	1,501.00	9,756,500
D C Mホールディングス	6,500	1,102.00	7,163,000
ペッパーフードサービス	1,000	3,205.00	3,205,000
Monotaro	7,700	2,584.00	19,896,800
東京一番フーズ	400	628.00	251,200
D Dホールディングス	300	2,386.00	715,800
きちり	400	799.00	319,600
アークランドサービスホールディングス	900	2,258.00	2,032,200
J . フロント リテイリング	15,600	1,571.00	24,507,600
ドトール・日レスホールディングス	2,100	2,094.00	4,397,400
マツモトキヨシホールディングス	5,100	4,210.00	21,471,000
ブロンコビリー	600	2,968.00	1,780,800
Z O Z O	13,200	2,705.00	35,706,000
トレジャー・ファクトリー	400	705.00	282,000
物語コーポレーション	400	10,170.00	4,068,000
ココカラファイン	1,400	6,540.00	9,156,000
三越伊勢丹ホールディングス	22,800	1,385.00	31,578,000
H a m e e	300	1,691.00	507,300
ウエルシアホールディングス	3,200	5,980.00	19,136,000
クリエイトSDホールディングス	1,800	2,930.00	5,274,000
丸善C H I ホールディングス	1,400	347.00	485,800
ミサワ	300	465.00	139,500
ティーライフ	200	991.00	198,200
エー・ピーカンパニー	300	661.00	198,300

チムニー	400	2,800.00	1,120,000
シュッピン	800	1,366.00	1,092,800
ネクステージ	1,900	1,087.00	2,065,300
ジョイフル本田	3,600	1,597.00	5,749,200
鳥貴族	400	2,163.00	865,200
キリン堂ホールディングス	500	1,607.00	803,500
ホットランド	700	1,426.00	998,200
すかいらーくホールディングス	11,400	1,764.00	20,109,600
綿半ホールディングス	500	2,576.00	1,288,000
ヨシックス	200	2,613.00	522,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,500	1,261.00	4,413,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	904.00	452,000
B E E N O S	300	1,748.00	524,400
あさひ	1,000	1,393.00	1,393,000
日本調剤	400	3,365.00	1,346,000
コスモス薬品	600	23,100.00	13,860,000
トーエル	600	854.00	512,400
一六堂	300	447.00	134,100
オンリー	200	1,049.00	209,800
セブン&アイ・ホールディングス	51,100	4,986.00	254,784,600
薬王堂	500	3,435.00	1,717,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,300	1,208.00	3,986,400
ツルハホールディングス	2,700	12,130.00	32,751,000
サンマルクホールディングス	1,000	2,732.00	2,732,000
フェリシモ	300	1,282.00	384,600
トリドールホールディングス	1,500	2,081.00	3,121,500
T O K Y O B A S E	1,100	624.00	686,400
ジャパンミート	500	2,078.00	1,039,000
サツドラホールディングス	200	1,988.00	397,600
デファクトスタンダード	100	711.00	71,100
ダイユー・リックホールディングス	700	1,053.00	737,100
バロックジャパンリミテッド	1,000	1,015.00	1,015,000
クスリのアオキホールディングス	1,000	8,070.00	8,070,000
力の源ホールディングス	400	949.00	379,600
スシローグローバルホールディングス	1,400	6,070.00	8,498,000
L I X I L ビバ	1,000	1,814.00	1,814,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	514.00	668,200
はるやまホールディングス	600	909.00	545,400
ノジマ	2,200	2,626.00	5,777,200
カッパ・クリエイト	1,700	1,432.00	2,434,400
ライトオン	1,000	943.00	943,000

ジーンズメイト	400	613.00	245,200
良品計画	1,700	29,070.00	49,419,000
三城ホールディングス	1,500	485.00	727,500
アドヴァン	1,900	1,074.00	2,040,600
アルビス	500	2,976.00	1,488,000
コナカ	1,500	507.00	760,500
ハウス オブ ローゼ	200	1,917.00	383,400
G - 7ホールディングス	400	2,502.00	1,000,800
イオン北海道	1,200	797.00	956,400
コジマ	1,800	484.00	871,200
ヒマラヤ	400	976.00	390,400
コーナン商事	1,600	2,755.00	4,408,000
エコス	500	2,057.00	1,028,500
ワタミ	1,600	1,361.00	2,177,600
マルシェ	400	802.00	320,800
ドンキホーテホールディングス	7,900	6,920.00	54,668,000
西松屋チェーン	2,700	1,015.00	2,740,500
ゼンショーホールディングス	5,800	2,207.00	12,800,600
幸楽苑ホールディングス	800	1,915.00	1,532,000
ハークスレイ	300	1,065.00	319,500
サイゼリヤ	2,000	2,167.00	4,334,000
V Tホールディングス	4,200	482.00	2,024,400
魚力	300	1,440.00	432,000
ポブラ	300	596.00	178,800
フジ・コーポレーション	200	2,055.00	411,000
ユナイテッドアローズ	1,400	3,970.00	5,558,000
ハイデイ日高	1,600	2,238.00	3,580,800
京都きもの友禅	800	469.00	375,200
コロワイド	4,100	2,776.00	11,381,600
ピーシーデポコーポレーション	1,600	546.00	873,600
壱番屋	900	4,265.00	3,838,500
P L A N T	300	1,146.00	343,800
スギホールディングス	2,700	5,280.00	14,256,000
ヴィア・ホールディングス	1,600	725.00	1,160,000
スクロール	1,900	476.00	904,400
ヨンドシーホールディングス	1,400	2,370.00	3,318,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,400	14,240.00	48,416,000
木曽路	1,500	2,554.00	3,831,000
S R Sホールディングス	1,500	991.00	1,486,500
千趣会	2,300	310.00	713,000
タカキュー	1,000	196.00	196,000
ケーヨー	2,300	561.00	1,290,300

上新電機	1,400	2,766.00	3,872,400
日本瓦斯	2,300	3,490.00	8,027,000
ロイヤルホールディングス	2,200	2,625.00	5,775,000
東天紅	100	1,476.00	147,600
いなげや	1,400	1,604.00	2,245,600
鳥忠	2,800	3,010.00	8,428,000
チヨダ	1,300	2,019.00	2,624,700
ライフコーポレーション	900	2,790.00	2,511,000
リンガーハット	1,500	2,305.00	3,457,500
MrMaxHD	1,700	511.00	868,700
テンアライド	1,200	428.00	513,600
AOKIホールディングス	2,400	1,536.00	3,686,400
オークワ	1,700	1,127.00	1,915,900
コメリ	1,900	2,916.00	5,540,400
青山商事	2,300	3,565.00	8,199,500
しまむら	1,400	9,450.00	13,230,000
はせがわ	700	465.00	325,500
高島屋	9,600	1,837.00	17,635,200
松屋	2,500	1,103.00	2,757,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,300	1,843.00	11,610,900
近鉄百貨店	500	3,540.00	1,770,000
パルコ	1,200	1,233.00	1,479,600
丸井グループ	10,300	2,461.00	25,348,300
アクシアル リテイリング	1,000	3,780.00	3,780,000
イオン	46,900	2,661.00	124,800,900
イズミ	2,500	6,350.00	15,875,000
平和堂	2,500	2,912.00	7,280,000
フジ	1,500	2,171.00	3,256,500
ヤオコー	1,400	6,220.00	8,708,000
ゼビオホールディングス	1,500	1,609.00	2,413,500
ケーズホールディングス	12,700	1,094.00	13,893,800
Olympicグループ	700	765.00	535,500
日産東京販売ホールディングス	1,800	347.00	624,600
Genky DrugStores	500	3,690.00	1,845,000
総合メディカルホールディングス	1,100	2,536.00	2,789,600
ブックオフグループホールディングス	700	743.00	520,100
アインホールディングス	1,600	8,830.00	14,128,000
元気寿司	300	5,310.00	1,593,000
ヤマダ電機	37,100	536.00	19,885,600
アークランドサカモト	2,100	1,500.00	3,150,000
ニトリホールディングス	5,300	14,605.00	77,406,500
愛眼	1,000	323.00	323,000

ケーユーホールディングス	600	938.00	562,800	
吉野家ホールディングス	4,300	1,814.00	7,800,200	
松屋フーズホールディングス	600	3,650.00	2,190,000	
サガミホールディングス	1,600	1,346.00	2,153,600	
関西スーパーマーケット	900	1,036.00	932,400	
王将フードサービス	900	6,920.00	6,228,000	
プレナス	1,400	1,802.00	2,522,800	
ミニストップ	900	2,092.00	1,882,800	
アークス	2,300	2,749.00	6,322,700	
パローホールディングス	2,600	2,488.00	6,468,800	
藤久	100	1,002.00	100,200	
ベルク	600	5,920.00	3,552,000	
大庄	700	1,688.00	1,181,600	
ファーストリテイリング	1,600	58,440.00	93,504,000	
サンドラッグ	4,600	4,175.00	19,205,000	
サクスパー ホールディングス	1,100	1,099.00	1,208,900	
ヤマザワ	300	1,614.00	484,200	
やまや	200	2,660.00	532,000	
ベルーナ	3,000	1,120.00	3,360,000	
島根銀行	300	1,170.00	351,000	
じもとホールディングス	8,400	146.00	1,226,400	
めぶきフィナンシャルグループ	63,400	348.00	22,063,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,700	1,961.00	3,333,700	
九州フィナンシャルグループ	20,100	512.00	10,291,200	
ゆうちょ銀行	34,500	1,322.00	45,609,000	
富山第一銀行	2,900	435.00	1,261,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	77,800	532.00	41,389,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,800	1,135.00	8,853,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	5,700	883.00	5,033,100	
三十三フィナンシャルグループ	1,100	2,026.00	2,228,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,100	4,105.00	8,620,500	
新生銀行	9,000	1,776.00	15,984,000	
あおぞら銀行	6,800	3,935.00	26,758,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	850,500	677.40	576,128,700	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	134,000	614.10	82,289,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	23,900	4,597.00	109,868,300	
三井住友フィナンシャルグループ	86,100	4,463.00	384,264,300	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	43,300	741.00	32,085,300	
群馬銀行	24,400	528.00	12,883,200	
武蔵野銀行	1,800	3,095.00	5,571,000	
千葉興業銀行	3,400	460.00	1,564,000	

筑波銀行	5,300	255.00	1,351,500
七十七銀行	3,800	2,398.00	9,112,400
青森銀行	900	3,100.00	2,790,000
秋田銀行	800	2,627.00	2,101,600
山形銀行	1,400	2,364.00	3,309,600
岩手銀行	800	4,280.00	3,424,000
東邦銀行	10,900	413.00	4,501,700
東北銀行	600	1,272.00	763,200
みちのく銀行	800	1,789.00	1,431,200
ふくおかフィナンシャルグループ	9,900	2,905.00	28,759,500
静岡銀行	30,700	1,013.00	31,099,100
十六銀行	1,600	2,635.00	4,216,000
スルガ銀行	12,500	507.00	6,337,500
八十二銀行	22,100	492.00	10,873,200
山梨中央銀行	1,500	1,745.00	2,617,500
大垣共立銀行	1,900	2,598.00	4,936,200
福井銀行	1,000	2,064.00	2,064,000
北國銀行	1,300	4,185.00	5,440,500
清水銀行	500	1,936.00	968,000
富山銀行	200	3,770.00	754,000
滋賀銀行	2,400	2,699.00	6,477,600
南都銀行	1,400	2,615.00	3,661,000
百五銀行	11,000	419.00	4,609,000
京都銀行	4,400	5,220.00	22,968,000
紀陽銀行	4,300	1,716.00	7,378,800
ほくほくフィナンシャルグループ	8,100	1,458.00	11,809,800
広島銀行	18,100	711.00	12,869,100
山陰合同銀行	7,200	905.00	6,516,000
中国銀行	7,900	1,030.00	8,137,000
鳥取銀行	400	1,573.00	629,200
伊予銀行	16,200	680.00	11,016,000
百十四銀行	1,300	2,997.00	3,896,100
四国銀行	1,700	1,277.00	2,170,900
阿波銀行	2,000	3,125.00	6,250,000
大分銀行	800	3,820.00	3,056,000
宮崎銀行	800	2,990.00	2,392,000
佐賀銀行	700	2,139.00	1,497,300
十八銀行	800	3,195.00	2,556,000
沖縄銀行	1,100	3,875.00	4,262,500
琉球銀行	2,800	1,316.00	3,684,800
セブン銀行	41,300	360.00	14,868,000
みずほフィナンシャルグループ	1,659,100	195.70	324,685,870

高知銀行	500	993.00	496,500
山口フィナンシャルグループ	15,200	1,203.00	18,285,600
長野銀行	400	1,699.00	679,600
名古屋銀行	1,000	3,640.00	3,640,000
北洋銀行	18,400	345.00	6,348,000
愛知銀行	400	4,435.00	1,774,000
中京銀行	500	2,271.00	1,135,500
大光銀行	400	2,021.00	808,400
愛媛銀行	1,700	1,187.00	2,017,900
トマト銀行	500	1,342.00	671,000
京葉銀行	5,400	836.00	4,514,400
栃木銀行	6,300	334.00	2,104,200
北日本銀行	400	2,499.00	999,600
東和銀行	2,100	960.00	2,016,000
福島銀行	1,200	616.00	739,200
大東銀行	600	923.00	553,800
トモニホールディングス	9,400	445.00	4,183,000
フィデアホールディングス	12,000	153.00	1,836,000
池田泉州ホールディングス	13,000	356.00	4,628,000
F P G	3,900	1,238.00	4,828,200
マーキュリアインベストメント	500	865.00	432,500
S B Iホールディングス	14,600	3,170.00	46,282,000
ジャフコ	2,000	4,395.00	8,790,000
大和証券グループ本社	97,900	652.30	63,860,170
野村ホールディングス	224,000	538.50	120,624,000
岡三証券グループ	10,400	567.00	5,896,800
丸三証券	3,700	897.00	3,318,900
東洋証券	4,500	228.00	1,026,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,600	613.00	8,949,800
光世証券	300	1,090.00	327,000
水戸証券	3,600	335.00	1,206,000
いちよし証券	2,600	964.00	2,506,400
松井証券	6,000	1,212.00	7,272,000
だいこう証券ビジネス	500	518.00	259,000
マネックスグループ	11,500	494.00	5,681,000
カブドットコム証券	9,100	408.00	3,712,800
極東証券	1,600	1,351.00	2,161,600
岩井コスモホールディングス	1,200	1,464.00	1,756,800
藍澤証券	2,300	733.00	1,685,900
マネーパートナーズグループ	1,500	383.00	574,500
かんぽ生命保険	4,600	2,783.00	12,801,800
S O M P Oホールディングス	24,000	4,855.00	116,520,000



アニコム ホールディングス	900	3,665.00	3,298,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	31,900	3,488.00	111,267,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	10,000	2,723.00	27,230,000
第一生命ホールディングス	69,100	2,253.00	155,682,300
東京海上ホールディングス	44,200	5,535.00	244,647,000
T & Dホールディングス	37,800	1,893.50	71,574,300
アドバンスクリエイト	300	2,083.00	624,900
全国保証	3,400	4,190.00	14,246,000
ジェイリース	300	615.00	184,500
イントラスト	400	461.00	184,400
日本モーゲージサービス	200	1,263.00	252,600
アルヒ	1,100	1,875.00	2,062,500
クレディセゾン	8,600	1,830.00	15,738,000
芙蓉総合リース	1,400	6,340.00	8,876,000
興銀リース	2,300	2,789.00	6,414,700
東京センチュリー	2,500	5,690.00	14,225,000
日本証券金融	5,400	640.00	3,456,000
アイフル	18,800	307.00	5,771,600
リコーリース	1,000	3,675.00	3,675,000
イオンフィナンシャルサービス	7,800	2,266.00	17,674,800
アコム	24,700	435.00	10,744,500
ジャックス	1,300	2,256.00	2,932,800
オリエントコーポレーション	33,500	174.00	5,829,000
日立キャピタル	2,900	3,005.00	8,714,500
アプラスフィナンシャル	6,400	101.00	646,400
オリックス	81,500	1,809.00	147,433,500
三菱UFJリース	27,500	583.00	16,032,500
九州リースサービス	600	714.00	428,400
日本取引所グループ	33,000	2,076.00	68,508,000
イー・ギャランティ	1,200	971.00	1,165,200
アサックス	500	582.00	291,000
N E C キャピタルソリューション	500	1,759.00	879,500
いちご	15,600	385.00	6,006,000
日本駐車場開発	14,900	158.00	2,354,200
ヒューリック	25,500	1,021.00	26,035,500
三栄建築設計	500	1,625.00	812,500
スター・マイカ	600	1,638.00	982,800
野村不動産ホールディングス	8,100	2,175.00	17,617,500
三重交通グループホールディングス	2,500	539.00	1,347,500
サムティ	1,700	1,545.00	2,626,500
ディア・ライフ	1,600	547.00	875,200
コーセーアールイー	400	862.00	344,800

エー・ディー・ワークス	19,100	37.00	706,700
日本商業開発	800	1,721.00	1,376,800
プレサンスコーポレーション	1,900	1,340.00	2,546,000
ユニゾホールディングス	1,900	2,243.00	4,261,700
THEグローバル社	600	727.00	436,200
日本管理センター	800	1,226.00	980,800
サンセイランディック	300	1,146.00	343,800
エストラスト	200	781.00	156,200
フージャースホールディングス	2,800	676.00	1,892,800
オープンハウス	2,000	4,565.00	9,130,000
東急不動産ホールディングス	33,000	646.00	21,318,000
飯田グループホールディングス	10,200	2,070.00	21,114,000
イーランド	200	736.00	147,200
ムゲンエステート	900	668.00	601,200
ファーストブラザーズ	300	1,299.00	389,700
ハウズドゥ	500	1,416.00	708,000
シーアールイー	400	1,015.00	406,000
プロパティエージェント	100	1,001.00	100,100
ケイアイスター不動産	300	1,988.00	596,400
アグレ都市デザイン	200	707.00	141,400
グッドコムアセット	200	1,519.00	303,800
パーク24	7,100	2,917.00	20,710,700
パラカ	300	1,988.00	596,400
三井不動産	64,800	2,574.50	166,827,600
三菱地所	85,600	1,819.00	155,706,400
平和不動産	2,300	2,019.00	4,643,700
東京建物	13,400	1,234.00	16,535,600
ダイビル	3,600	1,126.00	4,053,600
京阪神ビルディング	2,200	875.00	1,925,000
住友不動産	27,500	4,045.00	111,237,500
大京	1,900	2,965.00	5,633,500
テーオーシー	2,800	800.00	2,240,000
東京楽天地	200	4,935.00	987,000
レオパレス21	15,600	500.00	7,800,000
スターツコーポレーション	1,700	2,434.00	4,137,800
フジ住宅	1,600	868.00	1,388,800
空港施設	1,400	587.00	821,800
明和地所	700	628.00	439,600
ゴールドクレスト	1,000	1,824.00	1,824,000
日本エスリード	500	1,515.00	757,500
日神不動産	1,800	530.00	954,000
日本エスコン	2,200	690.00	1,518,000

タカラレーベン	5,800	329.00	1,908,200
サンヨーハウジング名古屋	700	1,005.00	703,500
イオンモール	6,100	2,075.00	12,657,500
ファースト住建	500	1,220.00	610,000
カチタス	1,400	2,790.00	3,906,000
トーセイ	1,700	1,039.00	1,766,300
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,700	1,678.00	12,920,600
サンフロンティア不動産	1,700	1,152.00	1,958,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	901.00	991,100
インテリックス	400	798.00	319,200
ランドビジネス	700	545.00	381,500
グランディハウス	1,100	435.00	478,500
日本空港ビルデング	3,900	4,520.00	17,628,000
日本工営	800	2,636.00	2,108,800
L I F U L L	4,100	792.00	3,247,200
ジェイエシーリクルートメント	1,000	2,087.00	2,087,000
日本M&Aセンター	8,800	2,806.00	24,692,800
メンバーズ	400	1,144.00	457,600
中広	200	743.00	148,600
タケエイ	1,200	829.00	994,800
E・Jホールディングス	200	1,249.00	249,800
トラスト・テック	600	3,370.00	2,022,000
コシダカホールディングス	3,200	1,362.00	4,358,400
アルトナー	200	838.00	167,600
パソナグループ	1,100	1,303.00	1,433,300
C D S	300	1,242.00	372,600
リンクアンドモチベーション	2,200	1,076.00	2,367,200
G C A	1,200	906.00	1,087,200
エス・エム・エス	4,400	1,975.00	8,690,000
パーソルホールディングス	11,800	2,165.00	25,547,000
リニカル	700	1,619.00	1,133,300
クックパッド	3,800	411.00	1,561,800
エスクリ	300	726.00	217,800
アイ・ケイ・ケイ	600	724.00	434,400
学情	500	1,456.00	728,000
スタジオアリス	600	2,552.00	1,531,200
シミックホールディングス	700	2,175.00	1,522,500
N J S	300	1,791.00	537,300
総合警備保障	4,700	4,765.00	22,395,500
カカクコム	8,900	2,221.00	19,766,900
アイロムグループ	500	1,923.00	961,500
セントケア・ホールディング	700	619.00	433,300

サイネックス	200	753.00	150,600
ルネサンス	700	2,294.00	1,605,800
ディップ	1,900	2,434.00	4,624,600
オプトホールディング	700	2,348.00	1,643,600
新日本科学	1,700	517.00	878,900
ツクイ	2,800	1,008.00	2,822,400
キャリアデザインセンター	300	1,588.00	476,400
エムスリー	24,900	1,928.00	48,007,200
ツカダ・グローバルホールディング	800	615.00	492,000
プラス	100	672.00	67,200
アウトソーシング	6,200	1,507.00	9,343,400
ウェルネット	1,200	1,097.00	1,316,400
ワールドホールディングス	300	2,868.00	860,400
ディー・エヌ・エー	6,400	1,951.00	12,486,400
博報堂D Yホールディングス	16,400	1,904.00	31,225,600
ぐるなび	1,700	906.00	1,540,200
エスアールジータカミヤ	1,200	671.00	805,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	1,047.00	1,047,000
ファンコミュニケーションズ	3,300	653.00	2,154,900
ライク	500	1,704.00	852,000
ビジネス・ブレークスルー	500	394.00	197,000
WDBホールディングス	500	3,130.00	1,565,000
ティア	600	815.00	489,000
C D G	100	1,460.00	146,000
バリューコマース	800	1,529.00	1,223,200
インフォマート	6,500	1,390.00	9,035,000
J Pホールディングス	3,400	307.00	1,043,800
エコナックホールディングス	2,300	114.00	262,200
E P Sホールディングス	1,800	2,246.00	4,042,800
レッグス	300	1,142.00	342,600
プレステージ・インターナショナル	2,200	1,303.00	2,866,600
アミューズ	700	2,865.00	2,005,500
ドリームインキュベータ	400	1,846.00	738,400
クイック	700	1,574.00	1,101,800
T A C	700	256.00	179,200
ケネディクス	11,100	596.00	6,615,600
電通	14,400	5,380.00	77,472,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,683.00	841,500
ぴあ	300	5,240.00	1,572,000
イオンファンタジー	400	3,650.00	1,460,000
シーティーエス	1,300	743.00	965,900
みらかホールディングス	3,300	2,848.00	9,398,400

アルプス技研	1,000	2,238.00	2,238,000
ダイオーズ	300	1,330.00	399,000
日本空調サービス	1,300	769.00	999,700
オリエンタルランド	14,000	10,530.00	147,420,000
ダスキン	3,200	2,401.00	7,683,200
明光ネットワークジャパン	1,500	1,013.00	1,519,500
ファルコホールディングス	700	1,661.00	1,162,700
秀英予備校	300	486.00	145,800
田谷	200	649.00	129,800
ラウンドワン	3,700	1,330.00	4,921,000
リゾートトラスト	5,000	1,810.00	9,050,000
ビー・エム・エル	1,500	3,020.00	4,530,000
ワタベウェディング	200	801.00	160,200
りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,235.00	2,593,500
リソー教育	2,000	1,251.00	2,502,000
早稲田アカデミー	200	2,228.00	445,600
ユー・エス・エス	14,400	2,031.00	29,246,400
東京個別指導学院	400	1,382.00	552,800
サイバーエージェント	7,300	5,210.00	38,033,000
楽天	55,200	888.00	49,017,600
クリーク・アンド・リバー社	700	991.00	693,700
テー・オー・ダブリュー	1,100	836.00	919,600
セントラルスポーツ	400	3,880.00	1,552,000
フルキャストホールディングス	1,200	2,124.00	2,548,800
エン・ジャパン	1,300	4,375.00	5,687,500
リソルホールディングス	100	4,095.00	409,500
テクノプロ・ホールディングス	2,200	5,800.00	12,760,000
アトラ	300	521.00	156,300
インターワークス	200	843.00	168,600
アイ・アールジャパンホールディングス	400	1,300.00	520,000
K e e P e r 技研	400	1,121.00	448,400
ファーストロジック	200	837.00	167,400
三機サービス	200	1,897.00	379,400
G u n o s y	700	2,920.00	2,044,000
デザインワン・ジャパン	200	494.00	98,800
イー・ガーディアン	600	2,712.00	1,627,200
リブセンス	700	354.00	247,800
ジャパンマテリアル	3,200	1,362.00	4,358,400
ベクトル	1,400	2,000.00	2,800,000
ウチヤマホールディングス	600	483.00	289,800
ライクキッズネクスト	300	1,118.00	335,400
キャリアリンク	500	424.00	212,000

I B J	800	613.00	490,400
アサンテ	500	2,205.00	1,102,500
N・フィールド	800	1,753.00	1,402,400
バリューHR	300	2,196.00	658,800
M&Aキャピタルパートナーズ	300	4,770.00	1,431,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,304.00	652,000
E R Iホールディングス	300	949.00	284,700
アビスト	200	3,675.00	735,000
シグマクシス	600	1,223.00	733,800
ウィルグループ	800	977.00	781,600
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	1,600	471.00	753,600
日本ビューホテル	400	1,279.00	511,600
リクルートホールディングス	84,700	3,010.00	254,947,000
エラン	400	2,798.00	1,119,200
土木管理総合試験所	500	616.00	308,000
日本郵政	96,900	1,338.00	129,652,200
ベルシステム24ホールディングス	2,000	1,549.00	3,098,000
鎌倉新書	900	1,082.00	973,800
一蔵	100	725.00	72,500
L I T A L I C O	300	2,046.00	613,800
グローバルグループ	200	1,417.00	283,400
エボラブルアジア	300	2,247.00	674,100
アトラエ	200	1,979.00	395,800
ストライク	300	3,020.00	906,000
ソラスト	2,900	1,215.00	3,523,500
セラク	300	787.00	236,100
インソース	400	2,060.00	824,000
アイモバイル	300	715.00	214,500
キャリアインデックス	400	1,373.00	549,200
M S - J a p a n	500	1,722.00	861,000
船場	200	1,056.00	211,200
グレイステクノロジー	300	2,739.00	821,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	700	1,704.00	1,192,800
フルテック	100	1,138.00	113,800
グリーンズ	300	1,442.00	432,600
ツナグ・ソリューションズ	100	832.00	83,200
日総工産	300	2,451.00	735,300
キュービーネットホールディングス	600	2,064.00	1,238,400
スプリックス	300	2,642.00	792,600
アドバンテッジリスクマネジメント	500	1,051.00	525,500
リログループ	6,500	2,678.00	17,407,000
東祥	700	3,820.00	2,674,000

エイチ・アイ・エス	2,100	3,505.00	7,360,500
ラックランド	200	2,920.00	584,000
共立メンテナンス	1,800	5,080.00	9,144,000
イチネンホールディングス	1,200	1,494.00	1,792,800
建設技術研究所	800	1,524.00	1,219,200
スペース	800	1,260.00	1,008,000
長大	500	881.00	440,500
燦ホールディングス	300	2,550.00	765,000
スバル興業	100	5,180.00	518,000
東京テアトル	500	1,347.00	673,500
タナベ経営	200	1,767.00	353,400
ナガワ	300	5,610.00	1,683,000
よみうりランド	300	4,150.00	1,245,000
東京都競馬	800	3,505.00	2,804,000
常磐興産	500	1,684.00	842,000
カナモト	1,700	3,855.00	6,553,500
東京ドーム	4,400	998.00	4,391,200
西尾レントオール	1,200	3,660.00	4,392,000
トランス・コスモス	1,300	2,519.00	3,274,700
乃村工藝社	2,800	2,502.00	7,005,600
藤田観光	500	3,000.00	1,500,000
KNT-CTホールディングス	600	1,235.00	741,000
日本管財	1,300	2,046.00	2,659,800
トーカイ	1,100	2,483.00	2,731,300
白洋舎	200	3,005.00	601,000
セコム	12,600	9,049.00	114,017,400
セントラル警備保障	600	4,810.00	2,886,000
丹青社	2,200	1,143.00	2,514,600
メイテック	1,500	4,790.00	7,185,000
応用地質	1,300	1,275.00	1,657,500
船井総研ホールディングス	2,500	2,402.00	6,005,000
進学会ホールディングス	600	560.00	336,000
オオバ	1,000	683.00	683,000
いであ	300	1,079.00	323,700
学究社	400	1,726.00	690,400
ベネッセホールディングス	4,300	3,170.00	13,631,000
イオンディライト	1,500	3,905.00	5,857,500
ナック	800	1,138.00	910,400
ニチイ学館	1,700	1,084.00	1,842,800
ダイセキ	2,000	2,778.00	5,556,000
ステップ	400	1,626.00	650,400
合 計	14,210,300		29,104,829,140

## (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11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	140,338,295	532,995,500
金銭信託	-	169,360,343
コール・ローン	712,070,236	1,480,596,771
出資金	4,692,609	8,528,855
株式	80,952,665,413	89,054,235,192
投資証券	2,108,714,076	2,259,877,763
派生商品評価勘定	31,404,542	36,739,920
未収入金	575,576	44,517,666
未収配当金	54,649,626	61,260,913
差入委託証拠金	199,676,489	265,668,129
流動資産合計	84,204,786,862	93,913,781,052
資産合計		
	84,204,786,862	93,913,781,052
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	454,800	70,072,665
未払金	-	25,305,560
未払解約金	28,488,977	6,830,202
未払利息	846	2,530
流動負債合計	28,944,623	102,210,957
負債合計		
	28,944,623	102,210,957
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	34,958,724,833	38,317,225,037
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	49,217,117,406	55,494,345,058
元本等合計	84,175,842,239	93,811,570,095
純資産合計		
	84,175,842,239	93,811,570,095
負債純資産合計		
	84,204,786,862	93,913,781,052

## 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11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
1.	期首	平成28年11月 8日	平成29年11月 7日
	期首元本額	38,937,887,089円	34,958,724,833円
	期首からの追加設定元本額	2,423,639,335円	6,642,172,570円
	期首からの一部解約元本額	6,402,801,591円	3,283,672,366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）	15,227,006,665円	17,394,970,643円
	DCインデックスバランス（株式20）	58,183,752円	83,139,293円
	DCインデックスバランス（株式40）	180,498,349円	239,509,487円
	DCインデックスバランス（株式60）	358,102,586円	461,502,750円
	DCインデックスバランス（株式80）	389,197,181円	486,117,038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	2,419,472,471円	2,077,599,404円
	日興五大陸株式ファンド	5,837,131,998円	5,393,219,533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	26,855,309円	19,578,773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）	192,874,715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	2,729,057,561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）	5,711,678円	5,284,001円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,323,836円	4,328,393円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,613,469円	7,489,900円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	7,150,949円	6,648,070円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,555,193,719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）	27,374,782円	27,105,667円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	79,964,166円	79,670,246円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	117,000,605円	115,894,010円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	119,108,256円	113,856,935円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,232,945,661円	4,293,346,258円
計	34,958,724,833円	38,317,225,037円
2. 受益権の総数	34,958,724,833口	38,317,225,037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11月 8日 至 平成29年11月 6日	自 平成29年11月 7日 至 平成30年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成29年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	227,211
株式	1,146,432,958
投資証券	23,777,786
合計	1,170,437,955

（平成30年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	369,182
株式	1,376,743,345
投資証券	4,797,712

合計	1,372,314,815
----	---------------

(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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,022,185,279	-	1,048,170,216	25,984,937
合計		1,022,185,279	-	1,048,170,216	25,984,937

(平成30年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,461,737,935	-	2,414,772,125	46,965,810
合計		2,461,737,935	-	2,414,772,125	46,965,810

(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11月 6日現在)

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	690,170,195	-	695,135,000	4,964,805
	米ドル	537,200,690	-	542,463,500	5,262,810
	ユーロ	152,969,505	-	152,671,500	298,005
合計		690,170,195	-	695,135,000	4,964,805

（平成30年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,631,779,935	-	1,645,413,000	13,633,065
	米ドル	1,245,058,300	-	1,257,820,500	12,762,200
	ユーロ	386,721,635	-	387,592,500	870,865
合計		1,631,779,935	-	1,645,413,000	13,633,065

## （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11月 6日現在		平成30年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.4079円	1口当たり純資産額	2.4483円
(1万口当たり純資産額)	(24,079円)	(1万口当たり純資産額)	(24,483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	LINDE PLC	12,580	161.99	2,037,834.20	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	11,893	54.69	650,428.17	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,560	17.11	78,021.60	
	APACHE CORP	8,704	37.58	327,096.32	
	BAKER HUGHES A GE CO	9,345	26.85	250,913.25	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	25.99	252,882.70	
	CHENIERE ENERGY INC	4,830	60.92	294,243.60	
	CHEVRON CORP	43,131	118.94	5,130,001.14	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	83.41	167,237.05	
	CONCHO RESOURCES INC	4,415	141.96	626,753.40	
	CONOCOPHILLIPS	26,560	69.03	1,833,436.80	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	50.34	98,666.40	
	DEVON ENERGY CORPORATION	11,251	33.10	372,408.10	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	2,210	115.99	256,337.90	
	EOG RESOURCES INC	13,152	106.35	1,398,715.20	
	EQT CORP	5,765	35.35	203,792.75	
	EXXON MOBIL CORP	95,671	81.64	7,810,580.44	
	HALLIBURTON CO	19,787	35.75	707,385.25	
	HELMERICH & PAYNE	2,660	63.80	169,708.00	
	HESS CORP	6,650	58.64	389,956.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	3,740	65.19	243,810.60	
	KINDER MORGAN INC	43,680	17.26	753,916.80	
	MARATHON OIL CORP	20,287	18.69	379,164.03	
MARATHON PETROLEUM CORP	15,722	69.76	1,096,766.72		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,671	36.53	316,751.63		

NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	22.50	90,900.00
NOBLE ENERGY INC	10,672	26.93	287,396.96
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	17,421	69.95	1,218,598.95
ONEOK INC	9,560	63.95	611,362.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,120	25.46	155,815.20
PHILLIPS 66	10,105	100.52	1,015,754.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,750	148.28	556,050.00
SCHLUMBERGER LTD	31,181	51.96	1,620,164.76
TARGA RESOURCES CORP	5,430	51.91	281,871.30
TECHNIPFMC PLC	9,351	26.68	249,484.68
VALERO ENERGY CORP	9,832	91.15	896,186.80
WILLIAMS COS INC	27,104	25.72	697,114.88
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,055	157.37	795,505.35
ALBEMARLE CORP	2,320	106.21	246,407.20
AVERY DENNISON CORP	2,270	91.94	208,703.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5,850	25.40	148,590.00
BALL CORP	8,230	47.41	390,184.30
CELANESE CORP	3,270	101.35	331,414.50
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,530	49.49	273,679.70
CHEMOURS CO/THE	3,600	33.26	119,736.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	45.27	127,435.05
DOWDUPONT INC	52,407	57.63	3,020,215.41
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	82.01	247,260.15
ECOLAB INC	5,710	155.97	890,588.70
FMC CORP	2,790	80.49	224,567.10
FREEMPORT-MCMORAN INC	31,648	12.22	386,738.56
INTERNATIONAL PAPER CO	9,000	46.17	415,530.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,865	146.03	272,345.95
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,340	93.49	686,216.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,455	174.83	254,377.65
MOSAIC CO/THE	8,490	32.22	273,547.80
NEWMONT MINING CORP	11,050	32.39	357,909.50
NUCOR CORP	6,919	61.36	424,549.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,490	96.44	240,135.60
PPG INDUSTRIES INC	5,794	106.45	616,771.30

SEALED AIR CORP	3,966	33.84	134,209.44
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,857	404.12	750,450.84
STEEL DYNAMICS INC	5,580	40.84	227,887.20
VULCAN MATERIALS CO	3,063	100.59	308,107.17
WESTLAKE CHEMICAL CORP	790	74.51	58,862.90
WESTROCK CO	6,049	45.37	274,443.13
3M CO	13,446	193.25	2,598,439.50
ACUITY BRANDS INC	890	130.43	116,082.70
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	50.88	135,340.80
AGCO CORP	1,250	56.25	70,312.50
ALLEGION PLC	2,080	88.60	184,288.00
AMETEK INC	5,313	73.51	390,558.63
ARCONIC INC	8,783	20.76	182,335.08
BOEING CO/THE	12,502	361.98	4,525,473.96
CATERPILLAR INC	13,586	126.41	1,717,406.26
CUMMINS INC	3,505	143.83	504,124.15
DEERE & CO	6,860	142.65	978,579.00
DOVER CORP	3,810	84.76	322,935.60
EATON CORP PLC	9,686	73.75	714,342.50
EMERSON ELECTRIC CO	14,430	70.35	1,015,150.50
FASTENAL CO	6,473	52.64	340,738.72
FLOWSERVE CORP	3,265	47.36	154,630.40
FLUOR CORP	2,903	47.33	137,398.99
FORTIVE CORP	6,924	75.10	519,992.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	45.70	144,412.00
GENERAL DYNAMICS CORP	5,752	177.97	1,023,683.44
GENERAL ELECTRIC CO	197,013	9.28	1,828,280.64
HARRIS CORP	2,710	149.55	405,280.50
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	38.46	143,840.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16,856	147.18	2,480,866.08
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	226.27	217,219.20
IDEX CORP	1,910	133.94	255,825.40
ILLINOIS TOOL WORKS	7,040	130.95	921,888.00
INGERSOLL-RAND PLC	5,576	99.14	552,804.64
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,060	76.81	235,038.60



JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,170	58.39	301,876.30
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	34.21	153,945.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	20,244	33.08	669,671.52
L3 TECHNOLOGIES INC	1,891	190.97	361,124.27
LENNOX INTERNATIONAL INC	770	214.35	165,049.50
LOCKHEED MARTIN CORP	5,791	303.21	1,755,889.11
MASCO CORP	6,439	31.42	202,313.38
MIDDLEBY CORP	1,180	112.45	132,691.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,764	279.44	1,051,812.16
OWENS CORNING	2,950	49.35	145,582.50
PACCAR INC	7,894	58.46	461,483.24
PARKER HANNIFIN CORP	3,010	164.10	493,941.00
PENTAIR PLC	3,498	41.85	146,391.30
RAYTHEON COMPANY	6,492	183.06	1,188,425.52
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,973	173.03	514,418.19
ROCKWELL COLLINS INC.	3,873	131.25	508,331.25
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,260	288.34	651,648.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,410	47.62	210,004.20
SMITH (A.O.) CORP	3,020	47.50	143,450.00
SNAP-ON INC	1,430	155.08	221,764.40
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,760	85.91	237,111.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,466	123.78	429,021.48
TEXTRON INC	6,126	54.83	335,888.58
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	347.17	381,887.00
UNITED RENTALS INC	2,020	126.70	255,934.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	17,215	127.25	2,190,608.75
WABCO HOLDINGS INC	1,110	110.48	122,632.80
WABTEC CORP	1,880	84.12	158,145.60
WW GRAINGER INC	1,107	287.06	317,775.42
XYLEM INC	4,168	68.51	285,549.68
CINTAS CORP	2,117	177.67	376,127.39
COPART INC	4,880	50.36	245,756.80
COSTAR GROUP INC	865	360.06	311,451.90
EQUIFAX INC	2,764	103.92	287,234.88
IHS MARKIT LTD	9,063	51.90	470,369.70

MANPOWERGROUP INC	1,447	78.95	114,240.65
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	26.76	198,157.80
REPUBLIC SERVICES INC	5,560	71.96	400,097.60
ROBERT HALF INTL INC	3,075	61.92	190,404.00
ROLLINS INC	2,000	59.43	118,860.00
STERICYCLE INC	1,705	46.77	79,742.85
TRANSUNION	4,100	66.65	273,265.00
VERISK ANALYTICS INC	3,770	116.92	440,788.40
WASTE CONNECTIONS INC	6,026	75.03	452,130.78
WASTE MANAGEMENT INC	9,564	87.78	839,527.92
AMERCO	155	328.86	50,973.30
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,270	35.72	81,084.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,440	88.13	303,167.20
CSX CORP	18,913	69.09	1,306,699.17
DELTA AIR LINES INC	3,615	56.05	202,620.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,367	68.91	300,929.97
FEDEX CORP	5,778	222.61	1,286,240.58
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,820	108.82	198,052.40
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	102.09	220,514.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	33.93	93,307.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	6,500	167.20	1,086,800.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,460	133.75	195,275.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	3,770	51.42	193,853.40
UNION PACIFIC CORP	17,566	148.57	2,609,780.62
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	89.47	153,441.05
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	15,657	106.82	1,672,480.74
XPO LOGISTICS INC	2,720	84.42	229,622.40
APTIV PLC	5,900	76.10	448,990.00
AUTOLIV INC	1,770	84.53	149,618.10
BORGWARNER INC	4,330	39.38	170,515.40
FORD MOTOR COMPANY	84,765	9.53	807,810.45
GENERAL MOTORS CORP	29,215	36.25	1,059,043.75
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	21.65	117,559.50
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	39.21	145,429.89
LEAR CORP	1,660	136.43	226,473.80

TESLA INC	2,900	341.40	990,060.00
DR HORTON INC	8,596	37.36	321,146.56
GARMIN LTD	2,395	64.85	155,315.75
HANESBRANDS INC	7,940	16.54	131,327.60
HASBRO INC	2,748	97.87	268,946.76
LEGGETT & PLATT INC	2,778	37.90	105,286.20
LENNAR CORP-CL A	6,960	44.39	308,954.40
LULULEMON ATHLETICA INC	2,300	142.20	327,060.00
MATTEL INC	7,349	14.26	104,796.74
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	3,490	58.30	203,467.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,628	127.93	208,270.04
NEWELL BRANDS INC	10,026	19.97	200,219.22
NIKE INC -CL B	29,138	77.53	2,259,069.14
NVR INC	70	2,341.54	163,907.80
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	94.50	117,180.00
PULTE GROUP INC	5,660	24.74	140,028.40
PVH CORP	1,600	127.23	203,568.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	136.80	159,372.00
TAPESTRY INC	6,756	42.75	288,819.00
TOLL BROTHERS INC	3,321	33.52	111,319.92
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	23.99	85,404.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	21.46	88,243.52
VF CORP	7,420	86.46	641,533.20
WHIRLPOOL CORP	1,414	116.16	164,250.24
ARAMARK	5,980	35.74	213,725.20
CARNIVAL CORP	9,397	56.86	534,313.42
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	555	469.65	260,655.75
DARDEN RESTAURANTS INC	2,943	106.34	312,958.62
DOMINO'S PIZZA INC	940	260.26	244,644.40
H&R BLOCK INC	4,510	26.99	121,724.90
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,340	72.40	459,016.00
LAS VEGAS SANDS CORP	8,690	55.12	478,992.80
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,683	120.68	806,504.44
MCDONALD'S CORP	17,821	180.39	3,214,730.19
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	5,100	17.99	91,749.00

MGM RESORTS INTERNATIONAL	11,570	27.62	319,563.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,910	46.09	226,301.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,008	105.82	424,126.56
STARBUCKS CORP	31,344	64.48	2,021,061.12
VAIL RESORTS INC	840	254.98	214,183.20
WYNN RESORTS LTD	2,030	109.30	221,879.00
YUM! BRANDS INC	7,324	87.47	640,630.28
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,978	57.30	457,139.40
CHARTER COMMUNICATION-A	3,801	323.35	1,229,053.35
COMCAST CORP-CLASS A	104,174	38.02	3,960,695.48
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	33.20	110,224.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,490	29.98	194,570.20
DISH NETWORK CORP-A	4,769	30.97	147,695.93
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,836	23.13	181,246.68
LIBERTY BROADBAND-C	2,700	83.37	225,099.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,975	25.61	101,799.75
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	25.02	308,271.42
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	4,700	33.68	158,296.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,580	40.65	145,527.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	40.51	80,007.25
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,430	55.13	189,095.90
NEWS CORP - CLASS A	7,570	13.16	99,621.20
OMNICOM GROUP	5,247	75.47	395,991.09
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	6.11	209,267.50
THE WALT DISNEY CO.	33,703	115.45	3,891,011.35
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,619	46.41	492,827.79
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	23,352	46.87	1,094,508.24
VIACOM INC-CLASS B	7,248	32.41	234,907.68
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,748	165.11	288,612.28
AMAZON.COM INC	9,325	1,627.80	15,179,235.00
AUTOZONE INC	622	766.35	476,669.70
BEST BUY CO INC	5,564	71.10	395,600.40
BOOKING HOLDINGS INC	1,093	1,871.12	2,045,134.16
CARMAX INC	4,299	70.54	303,251.46
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,960	114.09	679,976.40

DOLLAR TREE INC	5,366	86.08	461,905.28
EBAY INC	22,297	29.64	660,883.08
EXPEDIA INC	2,912	126.89	369,503.68
GAP INC/THE	5,106	27.76	141,742.56
GENUINE PARTS CO	3,421	98.08	335,531.68
HOME DEPOT INC	26,090	182.19	4,753,337.10
KOHL'S CORP	3,792	79.20	300,326.40
L BRANDS INC	4,858	34.24	166,337.92
LKQ CORP	7,600	27.76	210,976.00
LOWE'S COS INC	18,642	97.07	1,809,578.94
MACY'S INC	6,469	36.75	237,735.75
MERCADOLIBRE INC	990	357.62	354,043.80
NETFLIX INC	9,830	315.44	3,100,775.20
NORDSTROM INC	2,540	67.35	171,069.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,885	327.27	616,903.95
QURATE RETAIL INC	10,830	23.48	254,288.40
ROSS STORES INC	8,362	101.26	846,736.12
TARGET CORP	11,190	85.35	955,066.50
TIFFANY & CO	2,610	116.43	303,882.30
TJX COMPANIES INC	14,203	110.28	1,566,306.84
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	93.85	258,087.50
TRIPADVISOR INC	2,330	53.24	124,049.20
ULTA BEAUTY INC	1,240	285.13	353,561.20
COSTCO WHOLESALE CORP	9,959	234.45	2,334,887.55
KROGER CO	19,240	30.61	588,936.40
SYSCO CORP	10,866	64.56	701,508.96
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19,352	79.97	1,547,579.44
WALMART INC	33,462	102.91	3,443,574.42
ALTRIA GROUP INC	42,838	64.63	2,768,619.94
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12,503	48.10	601,394.30
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,980	47.87	286,262.60
BUNGE LTD	2,857	62.00	177,134.00
CAMPBELL SOUP CO	3,485	37.73	131,489.05
COCA-COLA CO/THE	91,212	48.69	4,441,112.28
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,130	46.18	236,903.40

CONAGRA BRANDS INC	10,810	35.00	378,350.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,750	200.30	751,125.00
GENERAL MILLS INC	13,969	42.97	600,247.93
HERSHEY CO/THE	3,015	106.97	322,514.55
HORMEL FOODS CORP	6,920	44.22	306,002.40
INGREDION INC	1,840	105.67	194,432.80
JM SMUCKER CO/THE	2,720	107.98	293,705.60
KELLOGG CO	6,188	63.15	390,772.20
KRAFT HEINZ CO/THE	14,081	52.39	737,703.59
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,805	146.85	411,914.25
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,440	63.09	280,119.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	33,605	42.71	1,435,269.55
MONSTER BEVERAGE CORP	9,160	54.71	501,143.60
PEPSICO INC	32,051	114.39	3,666,313.89
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	35,248	89.55	3,156,458.40
TYSON FOODS INC-CL A	6,806	62.04	422,244.24
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,200	66.59	346,268.00
CLOROX COMPANY	3,006	156.96	471,821.76
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,480	60.23	1,113,050.40
COTY INC-CL A	10,000	11.06	110,600.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,910	141.81	696,287.10
KIMBERLY-CLARK CORP	7,763	106.87	829,631.81
PROCTER & GAMBLE CO	56,949	91.20	5,193,748.80
ABBOTT LABORATORIES	39,766	70.39	2,799,128.74
ABIOMED INC	940	392.91	369,335.40
AETNA INC	7,439	199.33	1,482,815.87
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,680	228.12	383,241.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,714	88.56	328,911.84
ANTHEM INC	5,806	269.18	1,562,859.08
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,929	62.50	745,562.50
BECTON DICKINSON AND CO	6,077	237.32	1,442,193.64
BOSTON SCIENTIFIC CORP	31,898	36.36	1,159,811.28
CARDINAL HEALTH INC	7,495	52.09	390,414.55
CENTENE CORP	4,440	131.77	585,058.80
CERNER CORP	6,770	56.65	383,520.50

CIGNA CORP	5,600	215.50	1,206,800.00
COOPER COS INC/THE	1,040	258.25	268,580.00
CVS HEALTH CORP	23,097	73.69	1,702,017.93
DANAHER CORP	14,299	101.76	1,455,066.24
DAVITA INC	2,978	68.57	204,201.46
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	34.93	169,480.36
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,680	149.75	700,830.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	12,824	97.45	1,249,698.80
HCA HEALTHCARE INC	6,235	135.36	843,969.60
HENRY SCHEIN INC	3,340	84.73	282,998.20
HOLOGIC INC	5,708	39.99	228,262.92
HUMANA INC	3,175	326.61	1,036,986.75
IDEXX LABORATORIES INC	2,070	201.45	417,001.50
INTUITIVE SURGICAL INC	2,575	507.40	1,306,555.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,535	163.00	413,205.00
MCKESSON CORP	4,754	127.12	604,328.48
MEDTRONIC PLC	30,708	91.61	2,813,159.88
QUEST DIAGNOSTICS	2,876	94.05	270,487.80
RESMED INC	3,240	105.00	340,200.00
STRYKER CORP	7,683	166.33	1,277,913.39
TELEFLEX INC	1,090	258.16	281,394.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	21,740	261.01	5,674,357.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	124.10	224,621.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	120.90	232,611.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	2,860	92.22	263,749.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,502	115.03	517,865.06
ABBVIE INC	34,376	82.58	2,838,770.08
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7,140	65.91	470,597.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,140	123.21	633,299.40
ALKERMES PLC	3,220	37.68	121,329.60
ALLERGAN PLC	7,705	165.47	1,274,946.35
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,800	88.16	158,688.00
AMGEN INC	15,011	189.92	2,850,889.12
BIOGEN INC	4,793	317.15	1,520,099.95
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,880	97.75	379,270.00

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	36,871	52.03	1,918,398.13
CELGENE CORP	16,584	74.27	1,231,693.68
ELI LILLY & CO	22,013	110.14	2,424,511.82
GILEAD SCIENCES INC	29,524	69.58	2,054,279.92
ILLUMINA INC	3,330	324.14	1,079,386.20
INCYTE CORP	3,700	68.97	255,189.00
IQVIA HOLDINGS INC	3,533	121.67	429,860.11
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,400	162.17	227,038.00
JOHNSON & JOHNSON	60,561	142.20	8,611,774.20
MERCK & CO. INC.	60,703	73.12	4,438,603.36
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	605	573.98	347,257.90
MYLAN NV	10,965	31.37	343,972.05
NEKTAR THERAPEUTICS	3,790	40.00	151,600.00
PERRIGO CO PLC	3,009	72.18	217,189.62
PFIZER INC	132,030	43.52	5,745,945.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,840	354.93	653,071.20
SEATTLE GENETICS INC	2,280	57.32	130,689.60
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	22,030	22.85	503,385.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,074	236.52	2,146,182.48
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	115.06	108,156.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,620	174.59	981,195.80
WATERS CORP	1,866	195.88	365,512.08
ZOETIS INC	11,010	92.72	1,020,847.20
BANK OF AMERICA CORP	217,479	28.06	6,102,460.74
BB&T CORP	17,748	49.73	882,608.04
CIT GROUP INC	2,655	47.17	125,236.35
CITIGROUP INC	57,527	67.30	3,871,567.10
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,590	37.73	399,560.70
COMERICA INC	3,950	83.55	330,022.50
EAST WEST BANCORP INC	3,000	54.18	162,540.00
FIFTH THIRD BANCORP	16,209	27.57	446,882.13
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,460	93.02	321,849.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	24,720	14.37	355,226.40
JPMORGAN CHASE & CO	76,900	109.09	8,389,021.00
KEYCORP	24,618	18.49	455,186.82



M & T BANK CORP	3,153	164.70	519,299.10
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	13,444	9.69	130,272.36
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	9,730	15.78	153,539.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10,550	130.58	1,377,619.00
REGIONS FINANCIAL CORP	25,844	17.32	447,618.08
SIGNATURE BANK	1,370	115.22	157,851.40
SUNTRUST BANKS INC	10,557	62.52	660,023.64
SVB FINANCIAL GROUP	1,210	243.58	294,731.80
US BANCORP	35,121	52.34	1,838,233.14
WELLS FARGO & CO	104,500	53.66	5,607,470.00
ZIONS BANCORP NA	4,120	48.66	200,479.20
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,330	114.78	152,657.40
ALLY FINANCIAL INC	9,120	25.55	233,016.00
AMERICAN EXPRESS CO	16,454	105.21	1,731,125.34
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,330	126.81	422,277.30
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	22,752	47.97	1,091,413.44
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	28,780	216.24	6,223,387.20
BLACKROCK INC	2,660	411.00	1,093,260.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11,045	88.05	972,512.25
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,540	112.14	284,835.60
CME GROUP INC	7,650	185.50	1,419,075.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,020	69.18	554,823.60
E*TRADE FINANCIAL CORP	6,050	51.44	311,212.00
EATON VANCE CORP	3,200	44.70	143,040.00
FRANKLIN RESOURCES INC	7,935	30.82	244,556.70
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,098	228.72	1,852,174.56
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	12,610	78.22	986,354.20
INVESCO LTD	10,627	21.72	230,818.44
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	21.53	139,622.05
MOODY'S CORP	3,797	150.99	573,309.03
MORGAN STANLEY	30,065	45.82	1,377,578.30
MSCI INC	2,000	145.08	290,160.00
NASDAQ INC	2,825	88.76	250,747.00
NORTHERN TRUST CORP	4,690	95.49	447,848.10
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,060	79.47	243,178.20

S&P GLOBAL INC	5,592	183.21	1,024,510.32
SCHWAB (CHARLES) CORP	27,284	47.28	1,289,987.52
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,165	53.93	170,688.45
STATE STREET CORP	8,107	71.91	582,974.37
SYNCHRONY FINANCIAL	15,730	26.72	420,305.60
T ROWE PRICE GROUP INC	5,375	97.42	523,632.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	6,280	51.77	325,115.60
VOYA FINANCIAL INC	3,700	44.64	165,168.00
AFLAC INC	17,324	43.71	757,232.04
ALLEGHANY CORP	330	621.66	205,147.80
ALLSTATE CORP	7,983	90.39	721,583.37
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,960	101.99	199,900.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	20,405	44.13	900,472.65
AON PLC	5,607	158.18	886,915.26
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,345	27.83	287,901.35
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,500	75.51	339,795.00
ASSURANT INC	1,110	96.97	107,636.70
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,700	45.90	169,830.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,225	55.90	124,377.50
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,874	42.61	122,461.14
CHUBB LTD	10,575	128.59	1,359,839.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,920	79.18	310,385.60
EVEREST RE GROUP LTD	874	221.35	193,459.90
FNF GROUP	6,671	32.96	219,876.16
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	8,532	45.49	388,120.68
LINCOLN NATIONAL CORP	5,513	64.48	355,478.24
LOEWS CORP	5,785	48.80	282,308.00
MARKEL CORP	320	1,098.75	351,600.00
MARSH & MCLENNAN COS	11,593	85.72	993,751.96
METLIFE INC	19,555	44.59	871,957.45
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,120	48.04	342,044.80
PROGRESSIVE CORP	13,000	69.73	906,490.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9,842	97.82	962,744.44
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,690	144.07	243,478.30
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	123.92	109,917.04

TORCHMARK CORP	2,866	85.87	246,103.42
TRAVELERS COS INC/THE	6,134	126.53	776,135.02
UNUM GROUP	4,788	37.39	179,023.32
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,878	154.44	444,478.32
WR BERKLEY CORP	2,063	76.45	157,716.35
CBRE GROUP INC - A	7,550	41.89	316,269.50
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	6.02	142,674.00
JONES LANG LASALLE INC	1,160	138.00	160,080.00
ACCENTURE PLC-CL A	14,568	158.60	2,310,484.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	16,490	64.34	1,060,966.60
ADOBE INC	11,139	239.89	2,672,134.71
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	68.95	254,425.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,270	205.92	261,518.40
ALPHABET INC-CL A	6,760	1,055.73	7,136,734.80
ALPHABET INC-CL C	7,112	1,040.09	7,397,120.08
ANSYS INC	1,820	153.21	278,842.20
AUTODESK INC	4,880	133.50	651,480.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10,026	141.41	1,417,776.66
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,730	116.58	318,263.40
CADENCE DESIGN SYS INC	6,730	44.95	302,513.50
CDK GLOBAL INC	3,490	57.80	201,722.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,710	111.64	302,544.40
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	103.42	333,839.76
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13,488	69.46	936,876.48
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	91.71	396,187.20
DXC TECHNOLOGY CO	6,523	71.81	468,416.63
ELECTRONIC ARTS INC	7,064	92.69	654,762.16
FACEBOOK INC-A	54,280	148.68	8,070,350.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,285	103.97	757,421.45
FIRST DATA CORP- CLASS-A	12,110	18.40	222,824.00
FISERV INC	9,166	76.71	703,123.86
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,050	197.48	404,834.00
FORTINET INC	3,100	74.87	232,097.00
GARTNER INC	2,050	140.85	288,742.50
GLOBAL PAYMENTS INC	3,620	111.59	403,955.80

GODADDY INC-CLASS A	3,560	73.00	259,880.00
IAC/INTERACTIVECORP	1,650	197.01	325,066.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20,842	120.06	2,502,290.52
INTUIT INC	5,426	214.44	1,163,551.44
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,950	149.72	291,954.00
LEIDOS HOLDINGS INC	3,680	62.57	230,257.60
MASTERCARD INC	20,920	197.98	4,141,741.60
MICROSOFT CORP	165,024	107.51	17,741,730.24
ORACLE CORP	69,403	49.02	3,402,135.06
PAYCHEX INC	7,382	66.28	489,278.96
PAYPAL HOLDINGS INC	25,597	84.05	2,151,427.85
RED HAT INC	3,890	173.31	674,175.90
SABRE CORP	6,100	24.98	152,378.00
SALESFORCE.COM INC	15,920	135.44	2,156,204.80
SERVICENOW INC	4,060	180.41	732,464.60
SPLUNK INC	3,190	101.14	322,636.60
SQUARE INC - A	6,640	75.01	498,066.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,830	49.48	238,988.40
SYMANTEC CORP	13,055	20.02	261,361.10
SYNOPSIS INC	3,207	90.00	288,630.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,700	126.70	342,090.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,826	90.27	345,373.02
TWITTER INC	15,660	34.02	532,753.20
VERISIGN INC	2,670	160.80	429,336.00
VISA INC-CLASS A SHARES	40,362	139.80	5,642,607.60
VMWARE INC	1,555	142.94	222,271.70
WESTERN UNION CO	12,691	18.44	234,022.04
WORKDAY INC-CLASS A	3,300	130.32	430,056.00
WORLDPAY INC-CLASS A	6,570	91.97	604,242.90
ZILLOW GROUP INC - C	2,720	40.45	110,024.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,750	90.00	607,500.00
APPLE INC	111,092	201.59	22,395,036.28
ARISTA NETWORKS INC	1,130	248.96	281,324.80
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	73.99	142,800.70
AVNET INC	2,610	43.18	112,699.80

CDW CORP/DE	3,500	87.71	306,985.00
CISCO SYSTEMS INC	106,140	46.14	4,897,299.60
COGNEX CORP	3,970	45.00	178,650.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,030	24.57	99,017.10
CORNING INC	18,388	33.06	607,907.28
F5 NETWORKS INC	1,335	180.82	241,394.70
FLEX LTD	10,936	8.58	93,830.88
FLIR SYSTEMS INC	3,355	46.99	157,651.45
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	35,585	15.93	566,869.05
HP INC	36,325	24.64	895,048.00
IPG PHOTONICS CORP	730	141.18	103,061.40
JUNIPER NETWORKS INC	7,933	29.82	236,562.06
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4,180	58.34	243,861.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,855	124.03	478,135.65
NETAPP INC	5,836	80.12	467,580.32
PALO ALTO NETWORKS INC	2,050	182.79	374,719.50
SEAGATE TECHNOLOGY	5,684	44.95	255,495.80
TE CONNECTIVITY LTD	7,755	78.67	610,085.85
TRIMBLE INC	6,070	36.26	220,098.20
WESTERN DIGITAL CORP	6,718	48.36	324,882.48
XEROX CORP	4,938	28.62	141,325.56
AT&T INC	163,807	30.63	5,017,408.41
CENTURYLINK INC	21,296	21.00	447,216.00
SPRINT CORP	17,350	6.27	108,784.50
T-MOBILE US INC	7,702	68.89	530,590.78
VERIZON COMMUNICATIONS INC	93,107	57.21	5,326,651.47
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,050	30.12	152,106.00
AES CORP	13,728	15.07	206,880.96
ALLIANT ENERGY CORP	4,740	42.95	203,583.00
AMEREN CORPORATION	5,552	64.65	358,936.80
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,718	73.50	787,773.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,935	88.21	347,106.35
ATMOS ENERGY CORP	2,540	93.29	236,956.60
CENTERPOINT ENERGY INC	11,712	27.49	321,962.88
CMS ENERGY CORP	6,680	48.70	325,316.00

CONSOLIDATED EDISON INC	6,986	76.04	531,215.44
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,697	70.23	1,032,170.31
DTE ENERGY COMPANY	4,068	113.36	461,148.48
DUKE ENERGY CORP	15,746	83.58	1,316,050.68
EDISON INTERNATIONAL	7,179	68.76	493,628.04
ENERGY CORP	3,847	84.37	324,571.39
EVERGY INC	6,190	56.34	348,744.60
EVERSOURCE ENERGY	7,280	62.92	458,057.60
EXELON CORP	20,896	44.18	923,185.28
FIRSTENERGY CORP	10,755	37.48	403,097.40
NEXTERA ENERGY INC	10,585	170.71	1,806,965.35
NISOURCE INC	8,510	25.93	220,664.30
OGE ENERGY CORP	4,980	36.58	182,168.40
P G & E CORP	11,431	48.71	556,804.01
PINNACLE WEST CAPITAL	2,849	83.41	237,635.09
PPL CORP	15,728	30.94	486,624.32
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,128	53.21	592,120.88
SCANA CORP	2,683	39.82	106,837.06
SEMPRA ENERGY	5,657	112.57	636,808.49
SOUTHERN CO	22,895	45.25	1,035,998.75
UGI CORP	4,060	54.50	221,270.00
VISTRA ENERGY CORP	7,920	24.97	197,762.40
WEC ENERGY GROUP INC	7,190	67.61	486,115.90
XCEL ENERGY INC	11,324	48.40	548,081.60
ADVANCED MICRO DEVICES	20,220	19.90	402,378.00
ANALOG DEVICES INC	8,650	86.38	747,187.00
APPLIED MATERIALS INC	22,653	34.32	777,450.96
BROADCOM INC	9,320	220.09	2,051,238.80
INTEL CORP	105,412	47.97	5,056,613.64
KLA-TENCOR CORPORATION	3,529	92.51	326,467.79
LAM RESEARCH CORP	3,837	147.61	566,379.57
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	13,764	17.14	235,914.96
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,790	51.41	349,073.90
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,664	69.33	392,685.12
MICRON TECHNOLOGY INC	26,457	39.92	1,056,163.44

	NVIDIA CORP	13,045	211.77	2,762,539.65	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	7,857	82.86	651,031.02	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	8,730	17.72	154,695.60	
	QORVO INC	2,670	69.32	185,084.40	
	QUALCOMM INC	31,682	63.47	2,010,856.54	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,320	83.00	358,560.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	22,212	95.66	2,124,799.92	
	XILINX INC	5,705	84.36	481,273.80	
米ドル小計		6,895,890		535,862,194.25 (60,675,676,254)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	7,925	11.98	94,941.50	
	CAMECO CORP	7,892	15.86	125,167.12	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	27,414	38.40	1,052,697.60	
	CENOVUS ENERGY INC	25,343	11.80	299,047.40	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	6.05	69,423.75	
	ENBRIDGE INC	38,797	42.38	1,644,216.86	
	ENCANA CORP	21,068	11.61	244,599.48	
	HUSKY ENERGY INC	6,873	18.37	126,257.01	
	IMPERIAL OIL LTD	7,132	42.25	301,327.00	
	INTER PIPELINE LTD	9,840	22.25	218,940.00	
	KEYERA CORP	4,270	33.11	141,379.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	11,262	45.05	507,353.10	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	19.66	80,606.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	7,090	14.02	99,401.80	
	SUNCOR ENERGY INC	37,169	44.63	1,658,852.47	
	TOURMALINE OIL CORP	6,635	19.94	132,301.90	
	TRANSCANADA CORP	19,853	51.24	1,017,267.72	
	VERMILION ENERGY INC	3,840	34.23	131,443.20	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	47.56	223,294.20	
	BARRICK GOLD CORP	29,584	17.31	512,099.04	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	57.24	174,582.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	13.05	191,965.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,805	84.29	320,723.45	
	GOLDCORP INC	17,917	12.43	222,708.31	
	KINROSS GOLD CORP	25,015	3.59	89,803.85	

LUNDIN MINING CORP	12,280	5.68	69,750.40
METHANEX CORP	1,650	84.15	138,847.50
NUTRIEN LTD	14,058	71.47	1,004,725.26
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	27.74	331,631.70
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	2.49	58,313.31
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	71.13	103,849.80
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	21.94	206,126.30
BOMBARDIER INC 'B'	40,026	3.26	130,484.76
CAE INC	5,615	23.87	134,030.05
FINNING INTERNATIONAL INC	3,545	28.54	101,174.30
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,605	45.83	165,217.15
WSP GLOBAL INC	2,100	66.32	139,272.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16,718	111.85	1,869,908.30
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,175	271.63	862,425.25
LINAMAR CORP	980	55.35	54,243.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,448	64.27	478,682.96
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	41.28	187,411.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	5,358	72.64	389,205.12
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	24.00	256,680.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,670	149.88	250,299.60
DOLLARAMA INC	6,540	37.33	244,138.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,770	64.83	633,389.10
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	23.60	70,800.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,269	54.59	233,044.71
METRO INC	6,210	42.56	264,297.60
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	93.00	109,926.00
WESTON (GEORGE) LTD(N)	576	93.00	53,568.00
SAPUTO INC	6,060	38.12	231,007.20
AURORA CANNABIS INC	13,500	9.56	129,060.00
BAUSCH HEALTH COS INC	6,734	33.45	225,252.30
BANK OF MONTREAL	14,201	98.93	1,404,904.93
BANK OF NOVA SCOTIA	26,839	70.97	1,904,763.83
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,905	114.40	1,133,132.00
NATIONAL BANK OF CANADA	7,950	60.58	481,611.00
ROYAL BANK OF CANADA	32,469	95.64	3,105,335.16



	TORONTO-DOMINION BANK	41,420	73.21	3,032,358.20	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,373	54.36	998,756.28	
	CI FINANCIAL CORP	5,700	19.82	112,974.00	
	IGM FINANCIAL INC	1,945	34.55	67,199.75	
	ONEX CORPORATION	2,315	87.69	203,002.35	
	THOMSON REUTERS CORP	6,054	60.28	364,935.12	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	670	621.26	416,244.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	30.93	184,775.82	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,225	47.30	105,242.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,535	104.74	370,255.90	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	44,161	21.61	954,319.21	
	POWER CORP OF CANADA	7,800	27.72	216,216.00	
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	29.07	166,135.05	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	13,674	48.89	668,521.86	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	19.68	65,337.60	
	BLACKBERRY LTD	10,328	12.22	126,208.16	
	CGI GROUP INC - CL A	5,940	79.75	473,715.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	485	896.00	434,560.00	
	OPEN TEXT CORP	6,900	43.22	298,218.00	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	1,960	185.01	362,619.60	
	BCE INC	2,930	53.15	155,729.50	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,765	66.70	517,925.50	
	TELUS CORP	4,366	44.81	195,640.46	
	ALTAGAS LTD	7,050	15.04	106,032.00	
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	38.31	73,555.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	31.51	81,610.90	
	EMERA INC	1,270	40.50	51,435.00	
	FORTIS INC	10,215	43.79	447,314.85	
	HYDRO ONE LTD	9,070	19.56	177,409.20	
加ドル小計		921,321		38,265,155.16	(3,304,196,148)
ユーロ	ENAGAS SA	4,790	23.27	111,463.30	
	ENI SPA	59,296	15.45	916,241.79	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	10,915	15.01	163,888.72	
	NESTE OYJ	2,740	73.10	200,294.00	

OMV AG	3,940	49.46	194,872.40
REPSOL SA	31,209	15.70	490,137.34
SNAM SPA	59,280	3.70	219,632.40
TENARIS SA	11,695	13.43	157,122.32
TOTAL SA	54,227	51.40	2,787,267.80
VOPAK	1,270	41.94	53,263.80
AIR LIQUIDE SA	9,759	106.55	1,039,821.45
AKZO NOBEL	5,728	74.60	427,308.80
ARCELORMITTAL	15,022	22.46	337,394.12
ARKEMA	1,885	95.66	180,319.10
BASF SE	20,785	69.46	1,443,726.10
COVESTRO AG	4,320	58.66	253,411.20
CRH PLC	18,710	26.54	496,563.40
EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	27.83	99,631.40
FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	40.84	70,244.80
HEIDELBERGCEMENT AG	3,825	59.82	228,811.50
IMERYS SA	830	52.85	43,865.50
K+S AG	3,880	17.12	66,445.00
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	79.38	304,977.96
LANXESS AG	1,935	56.80	109,908.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	4,600	28.50	131,100.00
SOLVAY SA	1,581	102.05	161,341.05
STORA ENSO OYJ-R SHS	11,535	13.19	152,146.65
SYMRISE AG	2,640	74.36	196,310.40
THYSSENKRUPP AG	8,755	19.09	167,176.72
UMICORE	5,130	42.16	216,280.80
UPM-KYMMENE OYJ	11,868	27.96	331,829.28
VOESTALPINE AG	2,509	32.22	80,839.98
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,086	33.72	205,219.92
AIRBUS GROUP SE	13,188	95.38	1,257,871.44
ALSTOM	3,220	38.13	122,778.60
ANDRITZ AG	1,420	45.00	63,900.00
BOUYGUES SA	5,400	33.13	178,902.00
BRENTAG AG	3,925	46.00	180,550.00
CNH INDUSTRIAL NV	25,270	9.26	234,050.74

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	11,366	32.47	369,054.02
DASSAULT AVIATION SA	50	1,440.00	72,000.00
EIFFAGE	1,580	87.00	137,460.00
FERROVIAL SA	9,975	17.40	173,565.00
GEA GROUP AG	3,940	26.12	102,912.80
HOCHTIEF AG	440	129.50	56,980.00
KION GROUP AG	1,400	52.68	73,752.00
KONE OYJ-B	7,604	43.45	330,393.80
LEGRAND SA	6,618	56.98	377,093.64
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	9.55	77,641.50
MAN SE	824	90.45	74,530.80
METSO OYJ	2,420	28.01	67,784.20
MTU AERO ENGINES AG	1,110	178.70	198,357.00
OSRAM LICHT AG	2,002	35.71	71,491.42
PRYSMIAN SPA	6,315	17.98	113,543.70
REXEL SA	6,250	10.21	63,843.75
SAFRAN SA	7,610	111.10	845,471.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,358	64.04	791,406.32
SIEMENS AG-REG	17,336	102.70	1,780,407.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	9.88	41,306.76
THALES SA	2,485	112.80	280,308.00
VINCI SA	11,790	78.34	923,628.60
WARTSILA OYJ ABP	8,820	15.54	137,062.80
BUREAU VERITAS SA	5,650	19.75	111,587.50
EDENRED	5,696	32.60	185,689.60
RANDSTAD NV	3,115	43.10	134,256.50
SOCIETE BIC SA	565	86.75	49,013.75
TELEPERFORMANCE	1,430	146.30	209,209.00
WOLTERS KLUWER	6,297	50.10	315,479.70
ADP	650	183.30	119,145.00
AENA SA	1,590	138.25	219,817.50
ATLANTIA SPA	10,860	17.67	191,896.20
BOLLORE	20,400	3.80	77,520.00
DEUTCHE LUFTHANSA	4,950	19.48	96,450.75
DEUTSCHE POST AG-REG	23,043	27.92	643,360.56

FRAPORT AG	980	67.92	66,561.60
GETLINK	11,810	11.30	133,453.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	7.02	90,010.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	7,325	77.23	565,709.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	67.75	80,622.50
CONTINENTAL AG	2,495	144.55	360,652.25
DAIMLER AG	20,692	52.69	1,090,261.48
FAURECIA	1,630	44.82	73,056.60
FERRARI NV	2,894	103.15	298,516.10
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	24,427	14.34	350,332.03
MICHELIN (CGDE)-B	3,879	89.60	347,558.40
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,565	27.89	71,537.85
PEUGEOT SA	13,890	20.83	289,328.70
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	58.72	184,968.00
RENAULT SA	4,467	65.93	294,509.31
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	9.40	33,398.40
VALEO SA	5,760	27.34	157,478.40
VOLKSWAGEN AG	891	151.10	134,630.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	4,163	155.44	647,096.72
ADIDAS AG	4,311	207.00	892,377.00
HERMES INTERNATIONAL	697	502.00	349,894.00
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	63.94	78,646.20
KERING	1,757	410.00	720,370.00
LUXOTTICA GROUP SPA	4,376	55.52	242,955.52
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6,324	277.70	1,756,174.80
MONCLER SPA	3,650	32.01	116,836.50
PUMA SE	219	459.50	100,630.50
SEB SA	480	125.10	60,048.00
ACCOR SA	3,926	40.85	160,377.10
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,150	78.75	169,312.50
SODEXO	1,880	86.06	161,792.80
AXEL SPRINGER SE	995	57.15	56,864.25
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	18.79	71,327.02
JC DECAUX SA	1,580	30.26	47,810.80
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	20.69	99,415.45

PUBLICIS GROUPE	4,905	51.98	254,961.90
RTL GROUP	860	56.40	48,504.00
SES	7,520	18.66	140,360.80
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	43.30	53,692.00
VIVENDI	22,740	21.52	489,364.80
INDITEX	25,005	25.28	632,126.40
ZALANDO SE	2,160	34.39	74,282.40
CARREFOUR SA	12,213	17.43	212,933.65
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	39.11	52,563.84
COLRUYT SA	1,375	52.24	71,830.00
JERONIMO MARTINS	5,075	10.80	54,810.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29,118	20.39	593,861.61
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	13.94	57,711.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	17,321	66.73	1,155,830.33
DANONE	13,924	63.33	881,806.92
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	14,820	6.85	101,591.10
HEINEKEN HOLDING NV	2,725	77.35	210,778.75
HEINEKEN NV	5,643	79.84	450,537.12
KERRY GROUP PLC-A	3,660	92.00	336,720.00
PERNOD-RICARD SA	4,806	137.95	662,987.70
REMY COINTREAU	470	107.60	50,572.00
BEIERSDORF AG	2,615	91.60	239,534.00
HENKEL AG & CO KGAA	2,730	86.65	236,554.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,943	96.52	380,578.36
L'OREAL	5,756	201.70	1,160,985.20
UNILEVER NV-CVA	35,045	47.47	1,663,586.15
BIOMERIEUX	1,070	68.20	72,974.00
ESSILORLUXOTTICA	4,585	120.80	553,868.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,103	68.20	348,024.60
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,475	54.16	513,166.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21,751	33.48	728,332.23
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	730	135.50	98,915.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,400	37.15	126,327.00
BAYER AG-REG	21,144	70.18	1,483,885.92
EUROFINS SCIENTIFIC	280	442.20	123,816.00

GRIFOLS SA	6,260	25.68	160,756.80
IPSEN	780	124.65	97,227.00
MERCK KGAA	3,090	95.20	294,168.00
ORION OYJ-CLASS B	1,830	30.04	54,973.20
QIAGEN N.V.	5,344	32.43	173,305.92
RECORDATI SPA	2,530	30.15	76,279.50
SANOFI	25,436	78.64	2,000,287.04
UCB SA	3,028	73.30	221,952.40
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,570	22.39	191,882.30
AIB GROUP PLC	15,300	4.07	62,362.80
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	149,393	5.20	777,889.35
BANCO DE SABADELL SA	133,052	1.19	158,930.61
BANCO SANTANDER SA	366,509	4.25	1,560,228.81
BANK OF IRELAND GROUP PLC	24,219	6.16	149,310.13
BANKIA SA	33,700	2.88	97,157.10
BANKINTER SA	13,960	7.42	103,583.20
BNP PARIBAS	25,552	46.47	1,187,401.44
CAIXABANK S.A	81,100	3.59	291,473.40
COMMERZBANK AG	21,334	8.60	183,515.06
CREDIT AGRICOLE SA	27,112	11.55	313,306.27
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	35.53	228,742.14
ING GROEP NV-CVA	88,175	11.26	993,203.20
INTESA SANPAOLO	335,563	1.97	663,139.60
KBC GROEP NV	5,709	60.68	346,422.12
MEDIOBANCA SPA	12,760	7.84	100,063.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	24.59	68,114.30
SOCIETE GENERALE	17,839	33.21	592,522.38
UNICREDIT SPA	46,626	11.58	540,302.08
AMUNDI SA	1,140	52.56	59,918.40
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	45,725	9.17	419,526.87
DEUTSCHE BOERSE AG	4,260	110.65	471,369.00
EURAZEO SE	1,055	64.65	68,205.75
EXOR NV	2,264	50.98	115,418.72
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,632	80.28	131,016.96
NATIXIS	19,150	5.22	99,963.00

WENDEL	600	112.00	67,200.00
AEGON NV	38,139	5.46	208,238.94
AGEAS	4,044	44.20	178,744.80
ALLIANZ SE-REG	9,948	184.66	1,836,997.68
ASSICURAZIONI GENERALI	25,628	14.32	367,121.10
AXA	44,632	22.06	984,581.92
CNP ASSURANCES	3,530	19.73	69,646.90
HANNOVER RUECK SE-REG	1,275	119.70	152,617.50
MAPFRE SA	20,814	2.64	55,094.65
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,366	190.05	639,708.30
NN GROUP NV	6,340	37.47	237,559.80
POSTE ITALIANE SPA	10,260	6.51	66,813.12
SAMPO OYJ-A SHS	10,069	40.10	403,766.90
SCOR SE	3,562	41.95	149,425.90
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	40.00	300,000.00
VONOVIA SE	11,328	39.88	451,760.64
AMADEUS IT GROUP SA	10,210	70.64	721,234.40
ATOS SE	2,250	77.38	174,105.00
CAP GEMINI SA	3,679	106.40	391,445.60
DASSAULT SYSTEMES SA	2,930	107.00	313,510.00
DELIVERY HERO SE	1,880	35.94	67,567.20
SAP SE	22,242	93.78	2,085,854.76
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,920	75.90	145,728.00
WIRECARD AG	2,610	150.95	393,979.50
INGENICO GROUP	1,160	68.00	78,880.00
NOKIA OYJ	132,796	5.12	680,712.29
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	75,196	14.47	1,088,086.12
DRILLISCH AG	980	40.84	40,023.20
ELISA OYJ	3,045	37.88	115,344.60
ILIAD SA	520	103.75	53,950.00
KONINKLIJKE KPN NV	82,606	2.37	195,858.82
ORANGE S.A.	44,474	14.16	629,751.84
PROXIMUS	3,040	22.77	69,220.80
TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.53	124,856.88
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.45	57,492.59

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,270	3.41	55,562.05	
	TELEFONICA SA	108,829	7.42	808,272.98	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,400	37.92	91,008.00	
	E.ON SE	49,369	8.74	431,781.27	
	EDF	11,785	14.67	172,944.87	
	ENDESA SA	6,840	18.68	127,805.40	
	ENEL SPA	182,177	4.43	807,226.28	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	3.09	170,252.13	
	ENGIE	39,514	12.05	476,341.27	
	FORTUM OYJ	11,015	18.95	208,734.25	
	IBERDROLA SA	132,772	6.33	840,446.76	
	INNOGY SE	2,850	39.23	111,805.50	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	7,722	21.87	168,880.14	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,120	18.27	203,218.00	
	RWE AG	10,685	17.82	190,460.12	
	SUEZ	7,629	12.95	98,795.55	
	TERNA SPA	35,697	4.59	163,956.32	
	UNIPER SE	3,800	26.00	98,800.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	12,624	17.86	225,527.76	
	ASML HOLDING NV	9,252	150.28	1,390,390.56	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	25,245	17.84	450,497.02	
	STMICROELECTRONICS NV	15,063	13.28	200,036.64	
ユーロ小計		4,379,122		82,406,759.49	(10,644,481,123)
英ポンド	BP PLC	450,458	5.42	2,441,932.81	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	104,118	24.35	2,535,273.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	84,249	24.83	2,091,902.67	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	17,360	6.89	119,749.28	
	ANGLO AMERICAN PLC	24,834	17.15	426,052.10	
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	8.09	70,678.08	
	BHP BILLITON PLC	49,421	16.28	804,771.56	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	48.19	132,570.69	
	FRESNILLO PLC	4,710	8.72	41,099.46	
	GLENCORE PLC	261,813	3.21	840,812.44	
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	30.11	126,431.89	



MONDI PLC	9,350	18.30	171,105.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,520	63.40	159,768.00
RIO TINTO PLC	27,255	39.24	1,069,486.20
ASHTED GROUP PLC	11,210	18.77	210,467.75
BAE SYSTEMS PLC ORD	71,205	5.20	370,408.41
BUNZL PLC	7,276	22.42	163,127.92
DCC PLC	2,530	65.00	164,450.00
FERGUSON PLC	5,432	52.54	285,397.28
MEGGITT PLC	16,205	5.05	81,964.89
MELROSE INDUSTRIES PLC	110,300	1.72	189,716.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	36,015	8.23	296,403.45
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT-C	1,656,690	0.00	1,656.69
SMITHS GROUP PLC	8,233	13.48	110,980.84
TRAVIS PERKINS PLC	5,250	11.30	59,325.00
WEIR GROUP PLC/THE	5,990	15.12	90,568.80
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	5.80	36,420.10
EXPERIAN PLC	20,468	17.72	362,692.96
G4S PLC	34,639	2.13	74,023.54
INTERTEK GROUP PLC	3,365	46.69	157,111.85
RELX PLC	43,975	15.26	671,278.37
EASYJET PLC	3,840	12.24	47,020.80
ROYAL MAIL PLC	19,950	3.56	71,041.95
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,690	5.36	111,063.92
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	36.32	94,432.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	18.00	160,272.00
PERSIMMON PLC	7,470	23.73	177,263.10
TAYLOR WIMPEY PLC	92,590	1.65	152,912.38
CARNIVAL PLC	3,850	42.48	163,548.00
COMPASS GROUP PLC	35,088	15.37	539,478.00
GVC HOLDINGS PLC	11,000	8.93	98,285.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4,719	40.98	193,384.62
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.29	51,268.35
TUI AG-DI	9,213	13.09	120,598.17
WHITBREAD PLC	3,820	46.34	177,018.80
INFORMA PLC	28,840	7.04	203,091.28

ITV PLC	77,235	1.54	119,559.78
PEARSON PLC	17,749	9.07	160,983.43
WPP PLC	28,054	8.93	250,746.65
KINGFISHER PLC	45,257	2.54	115,179.06
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	2.97	104,070.72
NEXT PLC	2,987	52.56	156,996.72
SAINSBURY (J) PLC	42,801	3.13	134,052.73
TESCO PLC	229,014	2.17	497,876.43
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.54	125,378.60
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,505	23.88	203,099.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	51,987	34.07	1,771,197.09
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,140	22.88	117,603.20
DIAGEO PLC	55,392	26.77	1,483,120.80
IMPERIAL BRANDS PLC	22,002	26.43	581,622.87
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,235	63.28	964,070.80
UNILEVER PLC	27,827	40.92	1,138,819.97
CONVATEC GROUP PLC	27,730	1.57	43,799.53
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	3.90	27,335.00
NMC HEALTH PLC	2,120	33.90	71,868.00
SMITH & NEPHEW PLC	20,386	13.74	280,103.64
ASTRAZENECA PLC	28,503	58.77	1,675,121.31
GLAXOSMITHKLINE PLC	111,701	15.07	1,683,557.47
SHIRE PLC	20,865	45.27	944,662.87
BARCLAYS PLC	374,501	1.74	655,002.24
HSBC HOLDINGS PLC	450,341	6.40	2,885,785.12
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,624,396	0.58	951,408.73
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	100,970	2.42	245,155.16
STANDARD CHARTERED PLC	61,220	5.72	350,668.16
3I GROUP PLC	20,499	8.61	176,660.38
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	18.51	105,877.20
INVESTEC PLC	13,185	4.98	65,714.04
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	42.60	280,180.20
SCHRODERS PLC	2,621	26.29	68,906.09
ST JAMES' S PLACE PLC	12,080	10.15	122,612.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	54,215	2.70	146,597.36

	ADMIRAL GROUP PLC	4,245	19.80	84,051.00	
	AVIVA PLC	91,805	4.24	389,345.00	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.18	93,278.94	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	136,201	2.57	350,172.77	
	PRUDENTIAL PLC	58,802	15.91	935,539.82	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	5.45	117,336.08	
	AUTO TRADER GROUP PLC	20,690	4.25	88,035.95	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	12.56	109,272.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	26,940	5.55	149,517.00	
	BT GROUP PLC	184,862	2.62	485,817.33	
	VODAFONE GROUP PLC	604,108	1.50	908,578.43	
	CENTRICA PLC	126,905	1.47	187,629.04	
	NATIONAL GRID PLC	75,888	8.35	634,271.90	
	SEVERN TRENT PLC	6,043	19.14	115,693.23	
	SSE PLC	23,977	11.57	277,533.77	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	17,085	7.43	126,975.72	
英ボンド小計		8,460,072		40,476,746.43 (5,982,867,889)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,430	22.15	98,124.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	558.00	94,860.00	
	GIVAUDAN-REG	213	2,407.00	512,691.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	10,939	46.24	505,819.36	
	SIKA AG-REG	3,010	130.20	391,902.00	
	ABB LTD-REG	40,645	20.44	830,783.80	
	GEBERIT AG-REG	880	383.70	337,656.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	450	206.40	92,880.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	840	210.80	177,072.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,327	48.03	159,795.81	
	SGS SA-REG	113	2,379.00	268,827.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	137.05	157,607.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12,349	75.12	927,656.88	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	345.10	234,668.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,400	67.30	94,220.00	
	DUFREY AG-REG	690	109.05	75,244.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,974.00	88,830.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	6,890.00	158,470.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	80,300.00	240,900.00	
	NESTLE SA-REG	70,413	84.42	5,944,265.46	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,350	168.50	227,475.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	230	691.00	158,930.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,698	324.60	551,170.80	
	NOVARTIS AG-REG	49,113	88.44	4,343,553.72	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15,898	245.20	3,898,189.60	
	VIFOR PHARMA AG	1,070	141.30	151,191.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	57,308	12.87	737,840.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,550	45.88	254,634.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	775	71.90	55,722.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	713.00	263,810.00	
	UBS GROUP AG-REG	87,702	14.23	1,247,999.46	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	144.50	156,060.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	830	381.30	316,479.00	
	SWISS RE AG	7,199	89.46	644,022.54	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,531	311.30	1,099,200.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,551	81.75	126,794.25	
	TEMENOS AG	1,530	138.90	212,517.00	
	SWISSCOM AG-REG	644	458.70	295,402.80	
	スイスフラン小計	389,199		26,133,266.28 (2,945,480,442)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	269.80	1,165,536.00	
	BOLIDEN AB	5,920	211.30	1,250,896.00	
	ALFA LAVAL AB	6,030	226.40	1,365,192.00	
	ASSA ABLOY AB-B	23,020	175.60	4,042,312.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,245	229.50	3,498,727.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	214.15	1,948,765.00	
	EPIROC AB-A	13,705	79.48	1,089,273.40	
	EPIROC AB-B	9,100	75.15	683,865.00	
	SANDVIK AB	25,790	143.60	3,703,444.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	143.70	1,030,329.00	
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	147.50	1,154,777.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	35,270	137.05	4,833,753.50	

	SECURITAS AB-B SHS	8,769	153.70	1,347,795.30	
	ELECTROLUX AB - B	4,825	196.65	948,836.25	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	69.32	587,833.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	160.14	3,008,710.32	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	323.00	468,350.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	466.90	1,886,276.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	14,885	209.10	3,112,453.50	
	NORDEA BANK ABP	65,938	80.47	5,306,030.86	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	34,730	94.84	3,293,793.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	35,130	99.48	3,494,732.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,630	205.60	4,241,528.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,370	190.25	641,142.50	
	INVESTOR AB-B SHS	10,095	392.30	3,960,268.50	
	KINNEVIK AB - B	4,885	240.60	1,175,331.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,400	282.60	395,640.00	
	ERICSSON LM-B SHS	67,775	81.06	5,493,841.50	
	HEXAGON AB-B SHS	5,850	463.10	2,709,135.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	514.00	704,180.00	
	TELE2 AB-B SHS	7,555	107.75	814,051.25	
	TELIA CO AB	57,340	42.14	2,416,307.60	
スウェーデンクローナ小計		539,804		71,773,107.68	(896,446,114)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	2,200	263.60	579,920.00	
	EQUINOR ASA	26,264	215.30	5,654,639.20	
	NORSK HYDRO A S	36,870	45.12	1,663,574.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	369.90	1,398,222.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,070	276.50	572,355.00	
	MARINE HARVEST	8,740	206.20	1,802,188.00	
	ORKLA ASA	17,310	71.14	1,231,433.40	
	DNB ASA	21,025	155.70	3,273,592.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	130.60	548,520.00	
	TELENOR ASA	16,365	156.30	2,557,849.50	
ノルウェークローネ小計		138,824		19,282,294.00	(261,275,083)
デンマークク	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,400	681.60	1,635,840.00	

ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,845	325.00	1,574,625.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	404.40	1,795,536.00	
	ISS A/S	4,720	213.50	1,007,720.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	8,085.00	646,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	8,634.00	1,191,492.00	
	DSV A/S	4,610	527.60	2,432,236.00	
	PANDORA A/S	2,190	389.20	852,348.00	
	CARLSBERG AS-B	2,720	726.80	1,976,896.00	
	COLOPLAST-B	2,545	610.20	1,552,959.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,610	225.00	587,250.00	
	GENMAB A/S	1,380	971.40	1,340,532.00	
	H LUNDBECK A/S	1,460	305.50	446,030.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	41,275	283.70	11,709,717.50	
	DANSKE BANK A/S	16,415	135.25	2,220,128.75	
	TRYG A/S	2,575	157.70	406,077.50	
	ORSTED A/S	4,460	428.10	1,909,326.00	
デンマーククローネ小計		98,863		33,285,513.75	(576,505,098)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	27.31	145,698.85	
	OIL SEARCH LTD	28,830	7.56	217,954.80	
	ORIGIN ENERGY LTD	43,120	7.17	309,170.40	
	SANTOS LTD	39,755	6.37	253,239.35	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	21,413	33.40	715,194.20	
	ALUMINA LTD	46,512	2.51	116,745.12	
	AMCOR LIMITED	27,430	13.16	360,978.80	
	BHP BILLITON LTD	72,966	33.11	2,415,904.26	
	BLUESCOPE STEEL LTD	11,500	14.09	162,035.00	
	BORAL LTD	25,275	5.50	139,012.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.21	124,889.65	
	INCITEC PIVOT LTD	44,370	4.02	178,367.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,885	19.09	207,794.65	
	NEWCREST MINING LTD	18,889	20.73	391,568.97	
	ORICA LIMITED	7,605	17.82	135,521.10	
	RIO TINTO LTD	9,988	79.61	795,144.68	
SOUTH32 LTD	122,197	3.64	444,797.08		

CIMIC GROUP LTD	1,867	46.86	87,487.62
BRAMBLES LTD	38,398	10.52	403,946.96
SEEK LTD	6,920	17.97	124,352.40
AURIZON HOLDINGS LTD	41,770	4.16	173,763.20
SYDNEY AIRPORT	24,156	6.33	152,907.48
TRANSURBAN GROUP	60,149	11.13	669,458.37
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,980	27.43	356,041.40
CROWN RESORTS LTD	6,745	11.89	80,198.05
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	54.87	64,746.60
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	45.86	44,484.20
TABCORP HOLDINGS LTD	39,384	4.63	182,347.92
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	11,392	3.23	36,796.16
WESFARMERS LTD	25,205	45.96	1,158,421.80
WOOLWORTHS GROUP LTD	29,922	28.81	862,052.82
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	10.00	106,500.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	15.50	247,163.00
COCHLEAR LTD	1,277	172.73	220,576.21
HEALTHSCOPE LTD	33,080	2.04	67,483.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	55.82	163,831.70
SONIC HEALTHCARE LTD	10,050	22.52	226,326.00
CSL LTD	10,292	187.52	1,929,955.84
AUST AND NZ BANKING GROUP	64,999	25.82	1,678,274.18
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	9.64	78,276.80
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.14	106,246.92
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	39,697	67.98	2,698,602.06
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	61,193	25.39	1,553,690.27
WESTPAC BANKING CORP	77,111	26.65	2,055,008.15
AMP LTD	59,627	2.74	163,377.98
ASX LTD	4,035	59.52	240,163.20
CHALLENGER LTD	12,110	10.24	124,006.40
MACQUARIE GROUP LTD	7,084	121.72	862,264.48
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	56,205	7.05	396,245.25
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.78	172,360.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	29,260	11.28	330,052.80
SUNCORP GROUP LTD	32,570	13.96	454,677.20

	COMPUTERSHARE LTD	9,430	19.97	188,317.10	
	REA GROUP LTD	1,150	71.85	82,627.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	88,954	3.03	269,530.62	
	TPG TELECOM LTD	7,840	7.77	60,916.80	
	AGL ENERGY LTD	14,751	17.95	264,780.45	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.68	68,663.75	
豪ドル小計		1,638,367		26,320,939.65 (2,150,420,769)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	18,583	5.85	108,710.55	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	7.20	154,583.27	
	A2 MILK CO LTD	15,000	10.15	152,250.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,700	13.74	147,018.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	12.61	107,185.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.98	139,924.86	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	3.16	88,480.00	
ニュージーランドドル小計		137,395		898,151.68 (67,747,581)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	60,208	80.05	4,819,650.40	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	15.30	436,050.00	
	MTR CORP	34,000	38.15	1,297,100.00	
	MINTH GROUP LTD	14,000	27.45	384,300.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	1.60	220,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	41.50	1,203,500.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	22.00	319,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	54,000	46.55	2,513,700.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	12.64	212,352.00	
	SANDS CHINA LTD	61,400	33.95	2,084,530.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	11.12	311,360.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	6.95	333,600.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	18.60	665,880.00	
	WH GROUP LTD	182,000	5.79	1,053,780.00	
	BANK OF EAST ASIA	26,040	25.95	675,738.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	80,000	30.20	2,416,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	17,400	186.60	3,246,840.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	27,400	221.00	6,055,400.00		



	AIA GROUP LTD	273,990	62.20	17,042,178.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	60,208	52.95	3,188,013.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	17,000	19.86	337,620.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	14.62	672,520.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,638	37.35	1,032,279.30	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	37.30	559,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	11,450	25.40	290,830.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	169,666	10.16	1,723,806.56	
	SINO LAND CO	85,050	12.56	1,068,228.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	38,480	105.20	4,048,096.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	82.95	872,385.15	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	27.55	639,160.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	24,800	20.00	496,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	31,800	47.90	1,523,220.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	17,600	42.65	750,640.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	91,000	10.66	970,060.00	
	PCCW LTD	80,000	4.29	343,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	16,000	57.80	924,800.00	
	CLP HOLDINGS LTD	36,500	86.30	3,149,950.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.53	421,680.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	204,668	14.94	3,057,739.92	
	POWER ASSETS HOLDINGS	32,000	52.20	1,670,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,200	75.30	466,860.00	
香港ドル小計		2,269,815		73,498,746.93 (1,062,791,880)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	39,560	6.11	241,711.60	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.69	56,490.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.47	114,510.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	50,900	1.23	62,607.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.30	105,800.00	
	SATS LTD	13,000	4.90	63,700.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	9.44	120,832.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	125,000	0.93	116,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.64	85,932.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	31.77	63,540.00	

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.24	31,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.14	155,932.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	40,615	24.00	974,760.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	69,140	11.32	782,664.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	28,900	24.65	712,385.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,000	7.08	155,760.00	
	CAPITALAND LTD	72,500	3.10	224,750.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	8.28	82,800.00	
	UOL GROUP LTD	9,350	6.14	57,409.00	
	VENTURE CORP LTD	5,600	14.75	82,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.17	545,810.60	
シンガポールドル小計		985,755		4,838,094.40	(398,513,835)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	13,070	22.10	288,847.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	445.90	222,950.00	
	BANK HAPOALIM BM	21,225	25.18	534,445.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	30,255	23.46	709,782.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	64.13	185,977.00	
	AZRIELI GROUP LTD	940	182.10	171,174.00	
	NICE LTD	1,385	388.40	537,934.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	4.28	208,967.57	
イスラエルシュケル小計		119,065		2,860,077.37	(87,832,976)
合 計		26,973,492		89,054,235,192	(89,054,235,192)

(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	75,323.28	
	出資金小計		3,327.00	75,323.28	(8,528,855)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	10,210	179,389.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	2,420	296,667.80	

AMERICAN TOWER CORP	10,009	1,558,401.30	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	27,640	271,424.80	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,115	551,573.05	
BOSTON PROPERTIES INC	3,487	421,787.52	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,558	123,028.08	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	176,481.80	
CROWN CASTLE INTL CORP	9,400	1,043,682.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,605	508,760.40	
DUKE REALTY CORPORATION	8,845	246,598.60	
EQUINIX INC	1,738	689,047.48	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,170	536,523.90	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	349,412.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,020	268,387.40	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,875	234,131.25	
HCP INC	10,905	307,739.10	
HOST HOTELS & RESORTS INC	16,889	325,113.25	
INVITATION HOMES INC	6,200	128,526.00	
IRON MOUNTAIN INC	6,925	219,037.75	
KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	139,576.65	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	133,547.70	
MACERICH CO/THE	2,460	127,649.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,670	259,951.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,050	193,833.00	
PROLOGIS INC	13,932	906,555.24	
PUBLIC STORAGE	3,479	701,366.40	
REALTY INCOME CORP	6,660	409,390.20	
REGENCY CENTERS CORP	3,175	200,945.75	
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,660	443,209.20	
SIMON PROPERTY GROUP INC	7,054	1,291,940.10	
SL GREEN REALTY CORP	2,040	189,250.80	
UDR INC	5,820	230,355.60	
VENTAS INC	8,015	468,396.60	
VEREIT INC	19,554	147,241.62	
VORNADO REALTY TRUST	4,021	271,900.02	
WELLTOWER INC	8,360	566,640.80	

		WEYERHAEUSER CO	16,658	460,093.96	
		WP CAREY INC	3,400	220,082.00	
		投資証券小計	271,267	15,797,639.42	(1,788,766,711)
		米ドル小計	274,594	15,872,962.70	(1,797,295,566)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	79,920.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	81,120.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	51,088.70	
		加ドル小計	9,070	212,128.70	(18,317,313)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	995	87,162.00	
		GECINA SA	970	124,936.00	
		ICADE	685	50,107.75	
		KLEPIERRE	4,732	140,256.48	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,130	494,727.80	
		ユーロ小計	10,512	897,190.03	(115,890,036)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	20,201	121,771.62	
		HAMMERSON PLC	15,295	67,573.31	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	130,475.26	
		SEGRO PLC	21,263	130,809.97	
		英ポンド小計	71,973	450,630.16	(66,607,643)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	26,518	256,163.88	
		DEXUS	21,247	205,670.96	
		GOODMAN GROUP	37,672	376,343.28	
		GPT GROUP	37,975	193,292.75	
		LENDLEASE GROUP	12,197	209,544.46	
		MIRVAC GROUP	78,535	164,923.50	
		SCENTRE GROUP	122,321	468,489.43	
		STOCKLAND	50,500	179,780.00	
		VICINITY CENTRES	72,862	185,798.10	
		豪ドル小計	459,827	2,240,006.36	(183,008,519)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	51,500	3,646,200.00	

香港ドル小計			51,500	3,646,200.00 (52,724,052)
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	130,269.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	54,940	92,848.60
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	101,491.00
		SUNTEC REIT	54,600	95,004.00
シンガポールドル小計			209,540	419,612.60 (34,563,489)
合計				2,268,406,618 (2,268,406,618)

(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 593銘柄	97.1%			66.3%
	投資証券 39銘柄			2.9%	2.0%
加ドル	株式 89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%			11.7%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 97銘柄	98.9%			6.6%
	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	92.2%			2.4%
	投資証券 9銘柄			7.8%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 41銘柄	95.3%			1.2%

	投資証券	1銘柄			4.7%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	92.0%			0.4%
	投資証券	4銘柄			8.0%	0.0%
イスラエルシケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 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11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	8,389,574
コール・ローン	131,499,443	73,344,063
国債証券	28,815,877,772	29,887,813,826
地方債証券	2,812,553,000	2,790,485,000
特殊債券	3,517,684,000	3,105,017,000
社債券	1,646,515,000	2,455,598,000
未収入金	102,783,000	-
未収利息	89,566,925	91,357,008
前払費用	1,192,355	830,695
流動資産合計	37,117,671,495	38,412,835,166
資産合計	37,117,671,495	38,412,835,166
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	99,927,000	-
未払解約金	37,621,920	24,628,232
未払利息	156	125
流動負債合計	137,549,076	24,628,357
負債合計	137,549,076	24,628,357
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,628,181,886	27,717,750,995
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,351,940,533	10,670,455,814
元本等合計	36,980,122,419	38,388,206,809
純資産合計	36,980,122,419	38,388,206,809
負債純資産合計	37,117,671,495	38,412,835,166

## 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11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
1.	期首	平成28年11月 8日	平成29年11月 7日
	期首元本額	24,222,472,005円	26,628,181,886円
	期首からの追加設定元本額	4,014,076,957円	3,474,873,250円
	期首からの一部解約元本額	1,608,367,076円	2,385,304,141円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	1,299,980,063円	1,856,314,765円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,386,534,583円	1,875,652,086円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,027,217,032円	1,348,956,010円
	DCインデックスバランス（株式80）	167,462,850円	221,368,003円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,687,936,899円	1,826,802,108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	4,137,230,806円	3,832,217,524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	5,029,453円	3,699,170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）	1,094,893,656円	1,514,625,168円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,872,201円	4,753,159円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	24,740,926円	24,838,920円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	101,678,455円	115,571,543円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	319,207,373円	294,386,146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	4,971,632,764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）	27,576,235円	2,762,842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)	120,941,335円	-円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,220,118,508円	1,239,420,432円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,211,835,185円	1,219,133,392円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	671,580,224円	658,273,991円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	101,292,777円	102,644,008円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,290,601,507円	6,340,531,990円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	246,145,716円	264,166,974円
計	26,628,181,886円	27,717,750,995円
2. 受益権の総数	26,628,181,886口	27,717,750,995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11月8日 至平成29年11月6日	自平成29年11月7日 至平成30年11月6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月6日現在	平成30年11月6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左



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

(有価証券に関する注記)

(平成29年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	109,891,826
地方債証券	3,340,000
特殊債証券	4,443,000
社債証券	1,542,000
合計	119,216,826

(平成30年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	64,396,902
地方債証券	1,570,000
特殊債証券	1,358,000
社債証券	1,286,000
合計	68,610,902

(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11月 6日現在		平成30年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3888円	1口当たり純資産額	1.3850円
(1万口当たり純資産額)	(13,888円)	(1万口当たり純資産額)	(13,850円)

#### 附属明細表

##### 第 1 有価証券明細表 (1)株式

該当事項はありません。

##### (2)株式以外の有価証券

( 単位 : 円 )

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 1 2 0 回利付国債 ( 5 年 )	330,000,000	330,921,006	
	第 1 2 2 回利付国債 ( 5 年 )	300,000,000	300,822,000	
	第 1 2 3 回利付国債 ( 5 年 )	505,000,000	506,656,400	
	第 1 2 4 回利付国債 ( 5 年 )	560,000,000	562,128,000	
	第 1 2 5 回利付国債 ( 5 年 )	325,000,000	326,397,500	
	第 1 2 6 回利付国債 ( 5 年 )	220,000,000	221,097,800	
	第 1 回利付国債 ( 4 0 年 )	70,000,000	97,559,700	
	第 2 回利付国債 ( 4 0 年 )	165,000,000	222,246,750	
	第 3 回利付国債 ( 4 0 年 )	50,000,000	67,635,500	
	第 4 回利付国債 ( 4 0 年 )	95,000,000	129,025,200	
	第 5 回利付国債 ( 4 0 年 )	35,000,000	45,699,500	
	第 6 回利付国債 ( 4 0 年 )	70,000,000	89,547,500	
	第 7 回利付国債 ( 4 0 年 )	50,000,000	61,058,000	
	第 8 回利付国債 ( 4 0 年 )	95,000,000	107,425,050	
	第 9 回利付国債 ( 4 0 年 )	160,000,000	130,860,800	
	第 1 0 回利付国債 ( 4 0 年 )	125,000,000	121,197,500	
	第 1 1 回利付国債 ( 4 0 年 )	50,000,000	46,648,000	
	第 3 0 5 回利付国債 ( 1 0 年 )	473,000,000	480,624,760	

第306回利付国債(10年)	93,000,000	94,951,140
第308回利付国債(10年)	140,000,000	143,253,600
第309回利付国債(10年)	134,000,000	136,680,000
第310回利付国債(10年)	78,000,000	79,650,480
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,400,430
第312回利付国債(10年)	205,000,000	210,744,100
第313回利付国債(10年)	370,000,000	382,454,200
第315回利付国債(10年)	65,000,000	67,243,150
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,115,800
第317回利付国債(10年)	105,000,000	108,655,050
第318回利付国債(10年)	185,000,000	190,908,900
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,188,450
第320回利付国債(10年)	190,000,000	196,566,400
第321回利付国債(10年)	175,000,000	181,527,500
第322回利付国債(10年)	75,000,000	77,544,750
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,633,050
第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,816,500
第325回利付国債(10年)	210,000,000	217,339,500
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,985,800
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,404,350
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,476,450
第329回利付国債(10年)	230,000,000	239,432,300
第330回利付国債(10年)	210,000,000	219,032,100
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,658,400
第333回利付国債(10年)	210,000,000	217,574,700
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,462,800
第335回利付国債(10年)	490,000,000	506,008,300
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,674,400
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,634,800
第338回利付国債(10年)	390,000,000	400,947,300
第339回利付国債(10年)	370,000,000	380,545,000
第340回利付国債(10年)	420,000,000	432,280,800
第341回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,022,440,000
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,004,900
第343回利付国債(10年)	245,000,000	246,771,350
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,314,000
第345回利付国債(10年)	610,000,000	613,208,600
第346回利付国債(10年)	490,000,000	492,244,200
第347回利付国債(10年)	160,000,000	160,616,000
第348回利付国債(10年)	90,000,000	90,237,600
第349回利付国債(10年)	490,000,000	490,886,900
第350回利付国債(10年)	480,000,000	480,220,800

第351回利付国債(10年)	435,000,000	434,582,400	
第352回利付国債(10年)	160,000,000	159,609,600	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	268,991,840	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	192,656,730	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	45,966,900	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	141,447,900	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	25,798,400	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	52,993,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	72,986,100	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	90,382,200	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	25,916,000	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	223,388,500	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	38,732,980	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	125,857,540	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	365,164,560	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	192,174,570	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	154,890,000	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	65,723,000	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	169,731,450	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	260,276,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	212,096,640	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	170,754,750	
第37回利付国債(30年)	101,000,000	125,786,410	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	116,387,350	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	93,603,000	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	110,384,100	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	48,184,400	
第42回利付国債(30年)	105,000,000	126,526,050	
第43回利付国債(30年)	235,000,000	283,276,050	
第44回利付国債(30年)	100,000,000	120,581,000	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	69,599,400	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	115,998,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	136,084,100	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	119,196,000	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	102,146,400	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	24,722,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	60,575,900	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	82,161,900	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	98,262,150	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	108,370,900	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	108,235,600	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	49,135,500	

第57回利付国債(30年)	100,000,000	98,145,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	98,018,000	
第59回利付国債(30年)	100,000,000	95,323,000	
第60回利付国債(30年)	30,000,000	30,106,200	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	52,840,080	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,917,700	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	104,514,300	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	60,007,320	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	248,376,000	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	41,166,840	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,081,500	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	70,693,920	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	55,774,680	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	145,485,450	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,448,600	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	313,231,000	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,289,250	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,708,160	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	59,225,580	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	110,146,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,274,880	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,596,180	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	87,509,760	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	118,417,520	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	126,172,480	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	127,136,300	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	133,486,320	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,361,800	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,591,820	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,192,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	181,472,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	68,748,600	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	151,061,300	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	352,284,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,740,160	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	294,777,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,029,000	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	69,774,600	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,562,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	97,786,640	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	115,186,260	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,471,250	

第98回利付国債(20年)	94,000,000	110,866,420
第99回利付国債(20年)	117,000,000	138,455,460
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,877,900
第101回利付国債(20年)	66,000,000	80,157,000
第102回利付国債(20年)	81,000,000	98,697,690
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,298,670
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,267,690
第105回利付国債(20年)	77,000,000	91,914,130
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,406,880
第107回利付国債(20年)	130,000,000	155,574,900
第108回利付国債(20年)	134,000,000	157,685,840
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,854,600
第110回利付国債(20年)	98,000,000	117,622,540
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,355,500
第112回利付国債(20年)	80,000,000	96,301,600
第113回利付国債(20年)	290,000,000	350,099,600
第114回利付国債(20年)	52,000,000	62,916,360
第115回利付国債(20年)	55,000,000	67,145,650
第116回利付国債(20年)	55,000,000	67,334,850
第117回利付国債(20年)	93,000,000	112,822,020
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,043,400
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,449,200
第120回利付国債(20年)	70,000,000	81,079,600
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,290,000
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,118,310
第123回利付国債(20年)	65,000,000	79,376,050
第124回利付国債(20年)	80,000,000	96,750,400
第125回利付国債(20年)	50,000,000	61,804,500
第126回利付国債(20年)	25,000,000	30,283,500
第128回利付国債(20年)	65,000,000	78,117,000
第129回利付国債(20年)	50,000,000	59,478,500
第130回利付国債(20年)	60,000,000	71,460,600
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,142,840
第132回利付国債(20年)	35,000,000	41,288,450
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,769,600
第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,713,500
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,442,000
第136回利付国債(20年)	180,000,000	210,202,200
第137回利付国債(20年)	200,000,000	236,474,000
第138回利付国債(20年)	120,000,000	138,746,400
第139回利付国債(20年)	150,000,000	175,395,000
第140回利付国債(20年)	450,000,000	532,813,500

	第141回利付国債(20年)	195,000,000	231,036,000	
	第142回利付国債(20年)	85,000,000	101,854,650	
	第143回利付国債(20年)	94,000,000	110,145,440	
	第144回利付国債(20年)	130,000,000	150,549,100	
	第145回利付国債(20年)	205,000,000	243,312,450	
	第146回利付国債(20年)	135,000,000	160,303,050	
	第147回利付国債(20年)	60,000,000	70,414,200	
	第148回利付国債(20年)	120,000,000	139,106,400	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	249,393,550	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	103,044,600	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	167,031,000	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	100,134,900	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	135,350,400	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	133,377,600	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	150,918,600	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	107,554,700	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	47,076,000	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	168,206,500	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	150,615,000	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	142,669,800	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	120,000,000	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	69,822,200	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	164,155,200	
	第164回利付国債(20年)	285,000,000	277,883,550	
	第166回利付国債(20年)	30,000,000	30,210,600	
国債証券 合計		27,321,000,000	29,887,813,826	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,622,000	
	第690回東京都公募公債	100,000,000	102,672,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	206,262,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	103,128,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	102,730,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	205,762,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	103,279,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,124,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	206,400,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,889,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,552,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,399,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,809,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,119,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	103,711,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,851,000	

	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,611,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,012,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,092,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	103,807,000	
	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	103,381,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,340,000	
地方債証券 合計		2,700,000,000	2,790,485,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,150,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,138,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,943,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,370,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,119,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,270,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,545,000	
	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	102,804,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	117,224,000	
	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	103,916,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,062,000	
	第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,579,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,949,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,830,000	
	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	103,160,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	117,275,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,244,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,674,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,404,000	
	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	102,491,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,228,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,259,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,090,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,698,000	
	第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,011,000	
	第318回信金中金債(5年)	100,000,000	99,936,000	
第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,850,000		
第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,798,000		
特殊債券 合計		3,000,000,000	3,105,017,000	
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	101,947,000	
	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・パンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,333,000	
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	103,307,000	
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	99,384,000	
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	201,962,000	
第21回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	200,000,000	200,342,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,929,000	
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	102,175,000	
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	102,909,000	
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	201,140,000	
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	106,270,000	
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	109,154,000	
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	103,833,000	
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	206,040,000	
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	204,686,000	
第563回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,909,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,903,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,072,000	
社債券 合計	2,400,000,000	2,455,598,000	
合計	35,421,000,000	38,238,913,826	

## 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11月 6日現在

平成30年11月 6日現在

資産の部

	平成29年11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
<b>流動資産</b>		
預金	837,560,116	435,075,215
金銭信託	-	5,137,390
コール・ローン	165,237,118	44,912,539
国債証券	157,741,251,099	146,813,640,796
派生商品評価勘定	-	48,249
未収入金	146,567,421	-
未収利息	1,357,790,881	1,240,467,078
前払費用	18,996,145	30,283,573
<b>流動資産合計</b>	<b>160,267,402,780</b>	<b>148,569,564,840</b>
<b>資産合計</b>	<b>160,267,402,780</b>	<b>148,569,564,840</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	41,944	-
未払金	690,365,082	98,981,385
未払解約金	70,358,933	45,246,907
未払利息	196	76
<b>流動負債合計</b>	<b>760,766,155</b>	<b>144,228,368</b>
<b>負債合計</b>	<b>760,766,155</b>	<b>144,228,368</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	68,813,700,349	66,186,471,666
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	90,692,936,276	82,238,864,806
<b>元本等合計</b>	<b>159,506,636,625</b>	<b>148,425,336,472</b>
<b>純資産合計</b>	<b>159,506,636,625</b>	<b>148,425,336,472</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>160,267,402,780</b>	<b>148,569,564,840</b>

## 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11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
1.	期首	平成28年11月 8日	平成29年11月 7日
	期首元本額	73,864,517,578円	68,813,700,349円
	期首からの追加設定元本額	2,564,470,551円	3,403,109,134円
	期首からの一部解約元本額	7,615,287,780円	6,030,337,817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）	11,581,356,815円	12,025,880,978円
	DCインデックスバランス（株式20）	120,311,772円	177,605,835円
	DCインデックスバランス（株式40）	185,599,379円	259,547,219円
	DCインデックスバランス（株式60）	246,887,356円	334,197,477円
	DCインデックスバランス（株式80）	201,193,535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	24,009,643,571円	23,997,031,098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	2,492,204,828円	2,369,212,998円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	22,163,069,508円	19,391,378,340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	27,380,363円	20,802,198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）	948,027,456円	- 円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	282,781,980円	546,561,756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）	2,937,698円	2,942,188円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2,970,589円	3,097,804円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,819,295円	8,011,579円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	14,757,936円	14,087,457円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	458,972,132円	878,307,671円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,122,097,048円	1,026,017,703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）	23,300,031円	2,349,760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）	83,430,561円	- 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	56,531,512円	59,204,110円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	81,754,055円	84,546,738円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	80,813,771円	82,151,594円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	61,086,829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	4,204,298,604円	4,160,469,588円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	242,688,378円	252,567,497円
	計	68,813,700,349円	66,186,471,666円
2.	受益権の総数	68,813,700,349口	66,186,471,666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11月 8日 至 平成29年11月 6日	自 平成29年11月 7日 至 平成30年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月 6日現在	平成30年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	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11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,165,819,291
合計	1,165,819,291

（平成30年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	210,610,529
合計	210,610,529

(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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	61,227,656	-	61,269,600	41,944
	ポーランドズロチ	61,227,656	-	61,269,600	41,944
合計		61,227,656	-	61,269,600	41,944

（平成30年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	11,038,226	-	11,085,000	46,774
	英ポンド	11,038,226	-	11,085,000	46,774
	売建	63,023,276	-	63,021,801	1,475
	米ドル	22,359,726	-	22,358,251	1,475
	ポーランドズロチ	40,663,550	-	40,663,550	-
	合計	74,061,502	-	74,106,801	48,249

## （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11月 6日現在		平成30年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.3179円	1口当たり純資産額	2.2425円
(1万口当たり純資産額)	(23,179円)	(1万口当たり純資産額)	(22,425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-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,051,312.50	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,530,000.00	10,596,023.10	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	4,934,570.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,875,433.00	
		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	2,971,347.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	8,070,000.00	8,150,700.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/02/29	3,000,000.00	2,944,278.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,077,871.30	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	2,430,000.00	2,377,983.42	
		US TREASURY N/B-2.375%-20/04/30	3,000,000.00	2,978,907.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	7,904,322.36	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,384,289.92	
		US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	4,993,318.20	
		US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	3,510,000.00	3,453,032.70	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,919,452.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,288,714.31	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,914,452.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/07/31	620,000.00	617,214.96	
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	4,810,000.00	5,293,347.28	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,180,000.00	5,155,312.12	
		US TREASURY N/B-1.5%-20/08/15	800,000.00	780,906.40	
		US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,430,119.05	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,238,277.20	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/31	2,800,000.00	2,786,655.20	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/09/15	4,750,000.00	4,620,857.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/09/30	6,000,000.00	5,900,040.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,596,444.40	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/10/15	2,000,000.00	1,951,796.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,955,312.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,252,030.14	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,479,696.50	
		US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,368,144.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	1,963,320.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,091,102.88			
US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,349,280.80			
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	2,965,839.00			

US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,951,602.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,862,704.90	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,358,235.20	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,932,852.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,730,000.00	4,801,044.60	
US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,462,305.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,320,376.94	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,919,414.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	334,601.14	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,220,762.10	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,110,770.84	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,925,274.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,338,986.40	
US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	880,000.00	872,884.32	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	1,979,973.12	
US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,884,079.90	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	5,922,381.30	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,719,242.80	
US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	2,973,573.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,200,937.70	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,759,275.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	12,250,000.00	11,975,330.50	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,181,892.00	
US TREASURY N/B-2.75%-21/09/15	300,000.00	298,154.40	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,343,468.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,423,302.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,723,326.84	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,901,680.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,589,982.75	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,887,892.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	578,449.20	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,039,806.64	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	763,406.40	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,423,387.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,402,685.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,727,964.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,876,661.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,659,430.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,916,718.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,290,481.18	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,424,462.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,791,145.24	



US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,313,513.20
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,901,524.00
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,822,552.20
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,385,741.50
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	1,916,758.00
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,872,206.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	1,000,000.00	962,207.00
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	947,480.00
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,278,394.46
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,764,564.70
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,899,532.00
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,539,852.20
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,800,000.00	5,563,806.60
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	2,909,821.20
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	561,105.15
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,875,196.00
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,084,571.36
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	621,457.32
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,559,500.00
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	7,714,007.60
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,410,967.50
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,285,527.10
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,715,236.00
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	982,852.00
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	11,000,000.00	10,143,628.00
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,176,610.70
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,713,346.05
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	5,500,000.00	5,086,856.50
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	380,000.00	377,365.08
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,589,666.60
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,947,656.00
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	2,785,984.53
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,406,495.00
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,923,554.00
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,252,691.20
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,432,558.50
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	2,862,540.00
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,894,140.00
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,636,422.60
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,430,000.00	3,245,369.96
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	4,100,000.00	3,874,741.90
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,022,615.44
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,449,277.14

US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,330,417.88
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,277,048.00
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,040,694.94
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,658,749.94
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,136,437.20
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,811,271.90
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,450,048.50
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,660,344.15
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,019,644.60
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,279,259.60
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,171,081.00
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,522,406.40
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,134,434.75
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	4,000,000.00	3,914,140.00
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	4,000,000.00	3,942,968.00
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	4,864,899.06
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	5,000,000.00	4,964,845.00
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,613,763.32
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,137,570.20
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,250,000.00	4,737,306.00
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,056,678.20
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,547,188.00
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,032,783.95
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,627,939.68
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,481,438.40
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	2,851,690.56
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	4,728,727.07
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,960,000.00	4,869,564.48
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	5,654,535.30
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,858,752.00
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,200,000.00	2,142,551.40
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,173,984.00
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,177,305.00
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,367,482.68
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,775,354.16
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,250,000.00	1,543,993.75
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,345,363.11
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,220,000.00	1,425,494.36
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,095,015.85
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,128,903.14
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,014,447.75
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	1,998,116.40

		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,831,201.41
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,547,663.04
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,277,149.10
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,817,812.50
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,003,371.87
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,066,957.20
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	712,296.80
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,777,812.00
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	1,899,336.00
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,265,199.40
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	5,286,000.64
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	4,741,173.00
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,098,496.00
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,368,920.60
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	3,838,877.55
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,055,852.80
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,766,264.60
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	2,960,124.80
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	4,781,596.40
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	3,603,997.80
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,336,194.00
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,083,495.00
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,693,965.65
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	1,799,218.00
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	2,581,577.60
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,469,577.12
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,749,844.00
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,870,000.00	1,635,445.90
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,529,678.25
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,263,312.80
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	2,100,000.00	1,932,000.00
	米ドル小計		607,070,000.00	592,657,327.75 (67,106,589,221)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	356,597.45
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-19/11/01	950,000.00	941,668.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-20/02/01	780,000.00	770,850.60
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,170,000.00	2,149,037.80
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/05/01	970,000.00	962,521.30
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,171,401.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/08/01	690,000.00	683,334.60
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	1,963,823.80
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-20/11/01	670,000.00	665,578.00

		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,140,000.00	2,063,067.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	970,681.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,470,000.00	1,405,231.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,118,433.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	991,446.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,310,000.00	1,242,954.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,108,741.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,300,000.00	1,248,364.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	660,000.00	647,064.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,122,419.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,015,621.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,024,870.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	525,614.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,160,000.00	1,025,869.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,107,000.00	1,058,790.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	890,000.00	1,154,054.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	100,000.00	97,479.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,408,139.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,090,000.00	1,481,211.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,225,000.00	1,524,390.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,315,000.00	1,555,237.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,099,415.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	238,000.00	209,142.50	
		加ドル小計	33,690,000.00	34,763,051.70 (3,001,789,514)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	16,000,000.00	15,437,416.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	26,100,000.00	25,959,876.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	23,603,973.31	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	2,900,000.00	2,807,867.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	20,137,183.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	11,000,000.00	10,788,847.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	23,012,070.27	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	9,032,405.58	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	12,300,000.00	11,467,717.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,750,000.00	11,628,430.38	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	11,021,114.79	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	5,291,567.65	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	8,664,399.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	9,400,000.00	9,133,949.45	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	15,500,000.00	13,869,938.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	7,670,000.00	7,012,249.17	
メキシコペソ小計			216,370,000.00	208,869,008.98 (1,190,553,351)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,518,000.00	1,641,730.81	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,458,265.54	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,238,097.52	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,250,000.00	1,467,537.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,196,175.60	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	493,744.09	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,200,000.00	1,364,079.12	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	639,871.21	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,330,000.00	1,369,280.22	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	850,000.00	1,100,551.10	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,252,615.71	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	1,070,000.00	1,080,249.31	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,459,380.31	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	520,000.00	519,051.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	742,962.75	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	898,250.10	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	320,000.00	321,312.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	733,044.32	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,475,000.00	2,279,808.67	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	320,000.00	319,045.44	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	567,294.08	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,370,000.00	2,067,651.95	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,178,736.94	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	870,000.00	842,850.94	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	280,481.24	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	399,820.34	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	1,850,000.00	1,936,132.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	1,480,000.00	1,513,038.04	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	2,000,000.00	2,128,074.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%-20/07/30	1,180,000.00	1,208,655.12	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	1,790,000.00	1,967,847.59	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%-21/01/31	770,000.00	772,363.13	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	2,080,000.00	2,367,855.56	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,762,757.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,790,000.00	2,121,608.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,643,328.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,300,000.00	1,307,811.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	2,027,202.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	640,000.00	634,298.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,074,148.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,610,971.81	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,954,192.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,885,000.00	2,096,152.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,660,000.00	1,730,179.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,289,148.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,813,485.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,660,000.00	1,751,363.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,177,605.94	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,760,000.00	1,765,163.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,495,000.00	1,509,915.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,785,000.00	1,787,324.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,725,123.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	910,000.00	896,467.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	1,934,875.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,848,294.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,630,000.00	1,659,014.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,489,645.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,120,000.00	1,160,651.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,028,456.30	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,420,000.00	2,028,930.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,570,000.00	2,195,017.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	1,180,000.00	1,762,863.95
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,260,000.00	1,330,220.68
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	685,000.00	686,717.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	560,000.00	626,326.40
BUNDES Obligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,017,088.60
BUNDES Obligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,216,498.80
BUNDES Obligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	750,864.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	3,220,000.00	3,371,929.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	2,720,000.00	2,886,882.88
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-20/09/04	1,520,000.00	1,601,107.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	1,410,000.00	1,505,677.94
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	1,730,000.00	1,905,652.09
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-21/09/04	1,580,000.00	1,704,576.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-22/01/04	2,000,000.00	2,157,098.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-22/07/04	2,470,000.00	2,665,110.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	1,600,000.00	1,715,231.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	1,900,000.00	2,046,852.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	1,720,000.00	1,857,603.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	1,850,000.00	2,047,205.93
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	1,052,349.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,920,000.00	2,111,904.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,950,000.00	2,123,111.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,830,000.00	1,942,859.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	2,670,000.00	2,754,110.34
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,540,000.00	2,703,319.46
	2,760,000.00	2,837,227.56

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,590,000.00	2,553,895.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,670,000.00	2,672,055.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,736,744.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,500,000.00	2,543,102.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,703,354.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,545,000.00	1,564,259.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	860,000.00	1,218,860.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,380,000.00	1,356,535.01	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,354,320.13	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,420,000.00	2,253,371.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,530,000.00	2,448,191.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,775,000.00	2,735,780.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,060,000.00	1,739,913.89	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,180,000.00	2,083,985.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	1,820,423.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,265,948.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,600,000.00	2,169,916.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	400,000.00	419,472.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,105,912.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,654,264.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,788,453.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	748,012.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	396,741.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,680,440.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.2%- 20/10/15	380,000.00	373,479.53	



BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	940,000.00	931,596.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,107,812.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 21/04/15	280,000.00	270,995.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,263,627.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,620,000.00	1,580,352.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,910,000.00	3,067,285.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,270,000.00	2,455,784.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	741,742.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,073,089.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,050,000.00	2,248,720.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,356,128.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	950,219.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,216,925.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,129,217.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,278,841.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,244,752.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	730,000.00	691,309.27
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,136,680.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,489,104.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,878,823.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	350,220.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,190,000.00	2,855,383.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,801,110.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	895,000.00	859,860.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,582,113.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	810,000.00	753,892.01

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,386,308.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,160,000.00	3,556,990.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	480,000.00	441,366.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,210,000.00	1,116,836.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	1,945,855.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,576,339.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,123,704.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,660,000.00	2,149,741.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,299,603.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	803,594.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	950,000.00	873,952.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,880,000.00	3,609,774.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	835,000.00	761,750.46
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,500,000.00	1,692,075.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	75,000.00	71,960.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,364,902.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	1,760,015.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,740,000.00	3,439,398.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,219,779.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,156,521.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	610,000.00	538,278.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,427,672.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	753,547.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	2,854,280.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	609,960.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,153,868.79

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,820,000.00	2,111,017.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	1,310,000.00	1,484,122.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	1,320,000.00	1,207,272.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	1,270,000.00	1,056,626.14
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,135,000.00	1,055,229.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	680,000.00	550,303.60
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	637,000.00	673,435.12
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	305,048.10
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	767,891.60
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	321,252.00
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	589,656.65
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	250,532.07
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	575,255.20
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	736,237.40
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	332,980.80
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	413,682.62
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	303,000.00	301,442.58
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	455,715.38
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	210,000.00	206,438.40
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	335,206.00
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	330,000.00	335,359.20
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	464,388.63
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,669,319.85
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,007,552.80
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,369,887.34
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,613,883.84
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,687,164.40
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,486,997.45
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,303,517.40
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,341,568.56
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,199,010.92
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,015,410.75
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	180,613.80
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,329,845.76
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,422,370.37
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,765,286.13
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,513,016.30
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,355,000.00	3,672,097.82
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,640,000.00	3,695,271.21

FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,149,688.74
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,391,122.35
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,080,000.00	3,791,005.68
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,920,000.00	2,935,111.57
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,760,000.00	2,703,715.32
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	3,910,000.00	4,043,862.76
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,330,000.00	3,951,393.31
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,220,000.00	2,224,870.68
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	1,160,000.00	1,155,435.40
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,615,000.00	3,860,022.42
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,600,000.00	3,055,122.46
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,070,000.00	3,250,889.00
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,720,000.00	4,393,596.96
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	680,000.00	686,277.76
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,390,000.00	3,678,797.94
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	1,530,000.00	1,519,853.31
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,266,106.18
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	765,000.00	812,836.98
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,150,982.05
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,030,000.00	2,777,543.44
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,740,000.00	1,880,202.93
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,120,000.00	1,800,892.35
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	930,000.00	1,531,617.00
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	797,742.00
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	870,000.00	932,948.67
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	640,000.00	708,764.80
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	494,710.08
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	34,987.79
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	665,567.62
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	781,089.35
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,260,803.38
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	945,000.00	966,187.27
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	500,000.00	495,131.69
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	890,228.09
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	110,000.00	110,246.62
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	175,000.00	170,957.50
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	545,000.00	550,385.96
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	685,000.00	712,868.04
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,240,000.00	1,254,198.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,330,000.00	1,424,253.77
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,608,706.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	708,619.80

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,347,682.71
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	584,538.80
		NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,207,192.35
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,034,993.65
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	180,271.44
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,757,956.34
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,282,248.50
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,213,950.90
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,160,000.00	1,191,041.13
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,742,455.79
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	580,000.00	591,360.22
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,340,418.78
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,230,000.00	1,873,214.96
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,255,000.00	1,973,393.37
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,073,000.00	1,502,747.23
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	187,440.90
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	337,000.00	375,512.36
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,181,000.00	1,271,092.58
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,402,962.12
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	790,994.09
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,078,901.92
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	451,507.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,166,283.62
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	933,552.27
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	957,577.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	931,884.10
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	983,756.16
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	625,000.00	623,666.87
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,191,262.40
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	460,000.00	465,268.38
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	677,821.02
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,074,000.00	1,605,970.77
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	559,000.00	780,602.69
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	375,000.00	381,500.13
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	273,000.00	467,324.04
ユーロ小計			393,396,000.00	446,530,080.64 (57,678,290,516)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	495,000.00	465,918.75
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,610,000.00	1,694,589.40
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,908,238.50
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,530,000.00	1,612,191.60
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,060,620.52

		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,207,157.25	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,199,883.36	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,211,950.19	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,192,494.20	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,699,651.88	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	200,000.00	198,332.00	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,019,411.80	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,608,736.14	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,512,811.90	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,410,000.00	1,392,840.30	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,482,823.30	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	430,000.00	435,007.78	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,428,730.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,250,000.00	1,685,000.00	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,655,047.80	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,759,755.20	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,279,961.48	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	100,000.00	98,304.00	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,098,742.70	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,749,517.61	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,415,000.00	2,021,401.08	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,545,000.00	2,322,644.85	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,104,793.10	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,302,618.56	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,349,484.80	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,495,000.00	1,363,673.22	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	160,000.00	154,544.00	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,084,951.56	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,440,000.00	2,120,961.60	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,603,001.65	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	865,000.00	847,741.52	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	1,993,260.40	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,577,963.40	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,665,000.00	1,637,784.89	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,600,364.67	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,241,369.44	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,394,851.13	
			54,692,000.00	67,379,127.53	
		英債券小計		(9,959,308,840)	
スウェーデン ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,410,000.00	8,246,959.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,000,000.00	9,037,808.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,560,000.00	7,020,458.85	

		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,425,963.95
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,297,539.66
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,750,000.00	3,784,066.50
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,590,000.00	4,983,559.02
スウェーデンクローナ小計			39,150,000.00	43,796,355.48 (547,016,479)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,710,000.00	7,123,215.22
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	4,992,859.90
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,120,000.00	3,332,827.68
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,268,211.31
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,177,525.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,470,000.00	2,440,960.21
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,950,000.00	1,956,344.52
ノルウェークローネ小計			25,670,000.00	26,291,943.84 (356,255,839)
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	7,044,273.60
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,930,000.00	7,660,692.27
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,185,843.85
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,190,000.00	9,124,479.00
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	3,410,000.00	3,449,607.15
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,270,000.00	17,527,624.14
デンマーククローネ小計			42,160,000.00	51,992,520.01 (900,510,446)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,570,899.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	220,000.00	214,599.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,703,685.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,160,000.00	2,174,148.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,430,364.50
		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	2,293,224.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,344,378.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	1,780,000.00	1,792,638.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,435,937.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,647,596.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,802,415.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,471,637.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	770,000.00	743,127.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,051,709.85
ポーランドズロチ小計			28,475,000.00	29,245,688.35 (877,955,564)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	1,940,000.00	2,008,484.52
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,107,504.35

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,390,000.00	2,604,703.73	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,349,347.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,940,000.00	2,184,590.35	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	730,000.00	730,568.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,020,000.00	2,295,235.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,990,000.00	2,025,205.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,200,000.00	2,296,310.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,660,000.00	2,956,602.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,695,916.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,246,267.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,020,000.00	1,938,128.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,800,000.00	1,801,589.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,670,000.00	1,746,357.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,060,000.00	1,058,910.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	640,000.00	621,867.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,359,164.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	510,468.82	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,016,814.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	671,988.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	280,000.00	259,755.46	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	942,249.52	
	豪ドル小計		35,642,000.00	37,428,031.28 (3,057,870,155)	
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	320,000.00	319,472.83	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	585,000.00	596,855.02	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	611,403.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	240,000.00	234,072.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	206,955.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	380,000.00	392,616.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	200,000.00	196,240.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	655,000.00	668,643.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	559,170.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	199,760.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	195,800.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	581,580.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	225,000.00	227,408.62	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	205,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	337,425.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	415,000.00	444,676.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	220,000.00	202,518.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	364,687.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	410,000.00	395,814.00	



シンガポールドル小計			6,855,000.00	6,940,298.07 (571,672,352)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,012,575.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	464,623.09
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	848,300.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	550,000.00	552,397.28
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	580,000.00	579,498.34
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	796,000.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	100,000.00	100,050.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	120,000.00	119,041.51
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	970,200.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	441,450.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	450,000.00	439,650.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	470,000.00	473,134.90
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	568,975.83
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,129,740.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	300,000.00	303,696.06
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	588,925.57
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	920,000.00	891,588.96
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,290,000.00	2,311,829.19
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	549,972.50
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	804,957.52
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,156,625.00
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	641,836.01
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,724,444.01
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	947,050.00
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,288,512.28
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	441,802.58
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	618,851.85
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	581,700.00
MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	808,768.12		
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,218,611.20		
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,004,948.86		
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	430,735.70		
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	899,536.94		
マレーシアアリンギット小計			26,875,000.00	26,710,028.80 (724,375,981)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	2,700,000.00	2,724,317.01
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,569,568.48
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,900,000.00	5,752,980.85

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	16,796,688.48	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	7,500,000.00	6,685,451.25	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	7,771,234.56	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,920,000.00	6,142,268.46	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	6,610,000.00	6,081,106.46	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,850,948.05	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,800,000.00	7,738,749.04	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	6,310,000.00	5,742,474.49	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,142,204.93	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	10,650,000.00	9,409,374.57	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	16,900,000.00	14,905,842.25	
南アフリカランド小計		117,890,000.00	105,313,208.88 (841,452,538)	
	合計		146,813,640,796 (146,813,640,796)	

(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 195銘柄	100.0%	45.7%
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 280銘柄	100.0%	39.3%
英ポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.8%
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 15銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%

## 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11月30日現在です。

## 【DCインデックスバランス(株式20)】

## 【純資産額計算書】

資産総額	4,092,933,847円
負債総額	1,693,352円
純資産総額( - )	4,091,240,495円
発行済口数	2,622,733,955口
1口当たり純資産額( / )	1.5599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	29,974,372,233円
負債総額	123,272,189円
純資産総額( - )	29,851,100,044円
発行済口数	19,803,118,492口
1口当たり純資産額( / )	1.5074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	96,807,032,003円
負債総額	40,050,296円
純資産総額( - )	96,766,981,707円
発行済口数	39,529,183,207口
1口当たり純資産額( / )	2.4480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	38,934,618,547円
負債総額	216,444,476円
純資産総額（ - ）	38,718,174,071円
発行済口数	27,820,969,949口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3917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	149,367,443,191円
負債総額	135,803,585円
純資産総額（ - ）	149,231,639,606円
発行済口数	66,106,123,560口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2575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11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11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11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11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	806	175,127

株式投資信託	762	149,406
単位型	246	8,740
追加型	516	140,665
公社債投資信託	44	25,721
単位型	30	543
追加型	14	25,177

### 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)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
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
<b>固定負債</b>				
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
<b>純資産の部</b>				
<b>株主資本</b>				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
<b>利益剰余金</b>				
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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、ま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ベ - 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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）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9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9月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	48,323百万円	
損保ジャパン日本興亜D C証券株式会社	3,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
住友生命保険相互会社	50,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニ - 生命保険株式会社	70,000 百万円	
日本生命保険相互会社	100,000百万円 (基金の総額)	
富国生命保険相互会社	10,000百万円 (基金の総額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

信金中央金庫 1	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 2019年3月1日より取扱開始予定です。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(2018年9月末現在)

## 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・使用する場合があります。



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

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

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12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DCインデックスバランス（株式20）の平成29年11月7日から平成30年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 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、DCインデックスバランス（株式20）の平成30年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 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な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。