

## 【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】	2018年9月14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】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【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】

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「世界の財産3分法ファンド」、「世界の財産3分法」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%（税抜3%）が上限となっております。

### （６）【申込単位】

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。

### （７）【申込期間】

2018年9月15日から2019年9月17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 <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

**（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と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		
	日々			
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	( )	アフリカ		
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、不動産投 信)))		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、不動産投信)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券および不動産投信に投資を行いません。

よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年12回(毎月)

目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)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** 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

- 国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

**2** 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

- 投資信託証券(マザーファンド)への投資を通じて、原則として国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。

**3** 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。
- 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行なわない場合があります。



### 「財産3分法」とは？

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

※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。



## 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

### 〔世界の財産3分法ファンド〕 基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス  
(円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2018年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。  
 ※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)



## 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

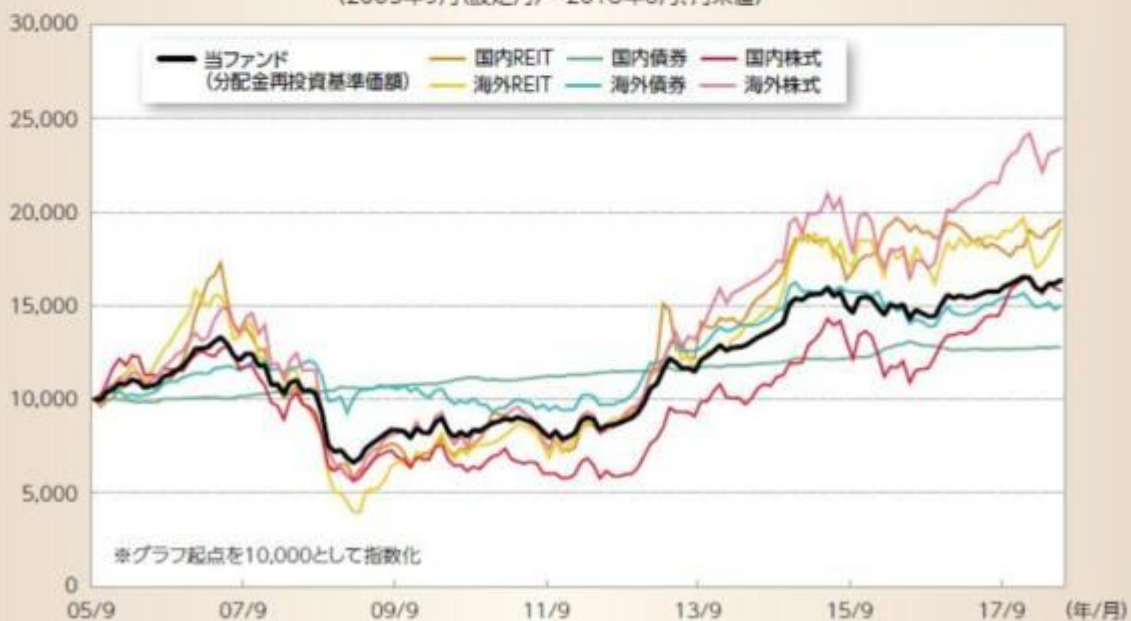
### 各資産の値動きの特徴



※価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

### ご参考: 設定来のファンドと各資産の推移 (マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)～2018年6月、月末値)



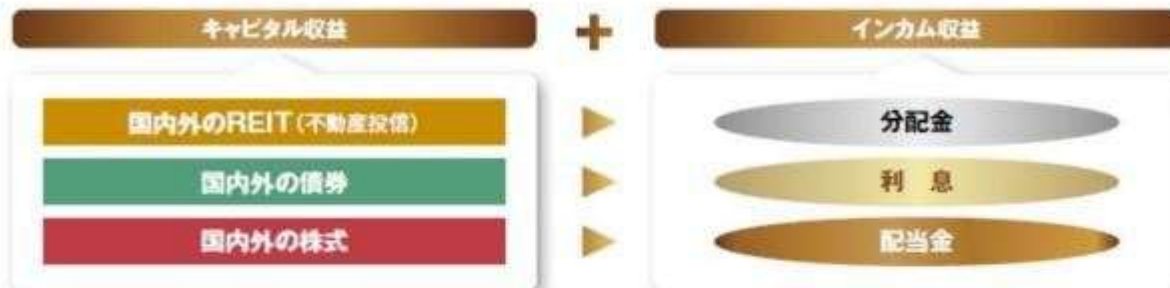
※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したもものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。  
 ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。  
 ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。





**インカム収益(投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など)に加え、キャピタル収益(投資した資産自体の値上がり益)を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。**

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行わない場合があります。



### ご参考:各指数の利回り

(2018年6月末現在)



- ◆ REIT: 実績分配金利回り  
国内: 東証REIT指数(配当込み)  
海外: S&P先進国REIT指数(除く日本)
- ◆ 債券: 最終利回りなど  
国内: NOMURA-BPI総合  
海外: FTSE世界国債インデックス(除く日本)
- ◆ 株式: 実績配当利回りなど  
国内: TOPIX(東証株価指数)  
海外: MSCI-KOKUSAIインデックス

※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。

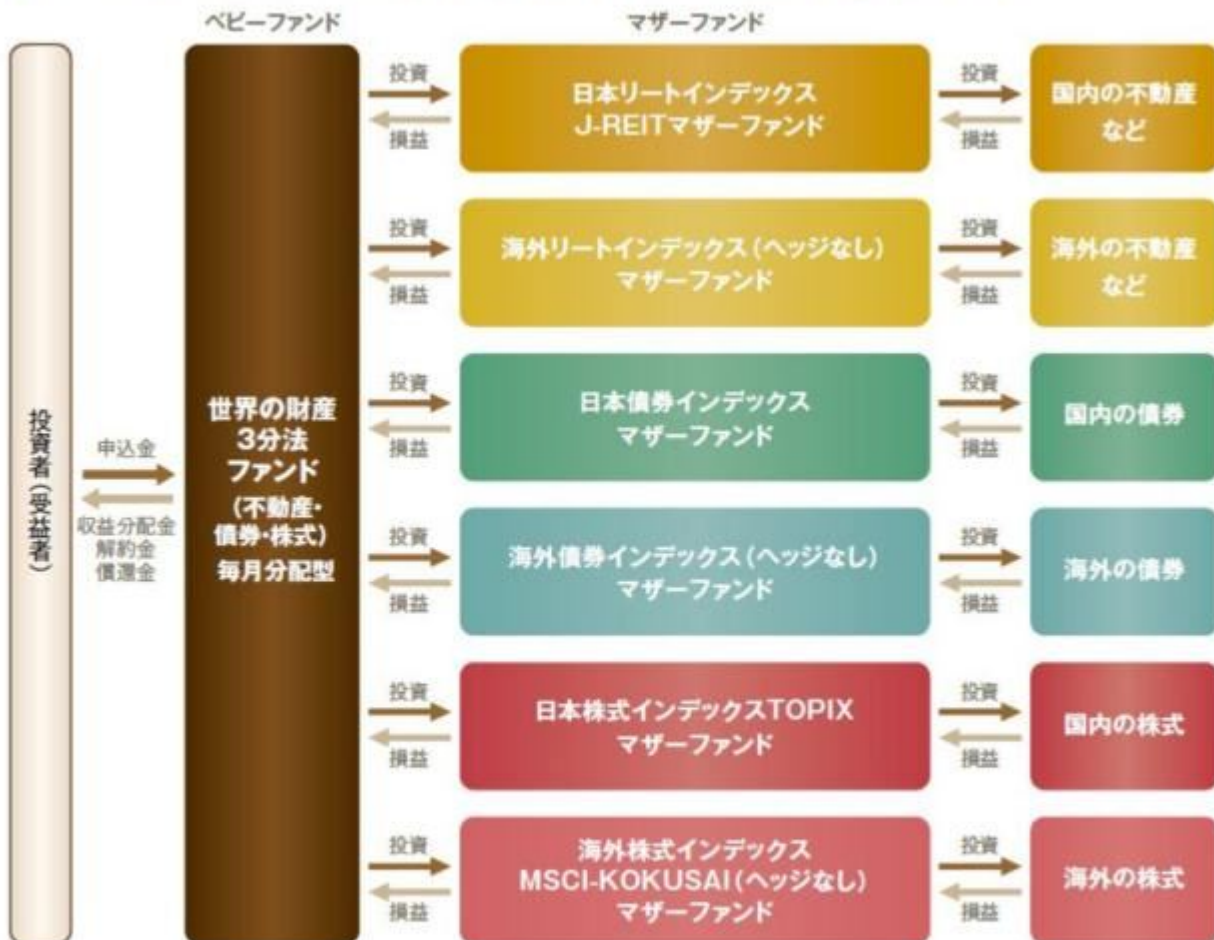
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

### 各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数(配当込み)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所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。
- **S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **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、ヘッジなし・円ベース)** 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。
- **TOPIX(東証株価指数)** TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス(円ヘッジなし・円ベース)** 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。

## ■ファンドの仕組み

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



### (主な投資制限)

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

### (分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※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。

## 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



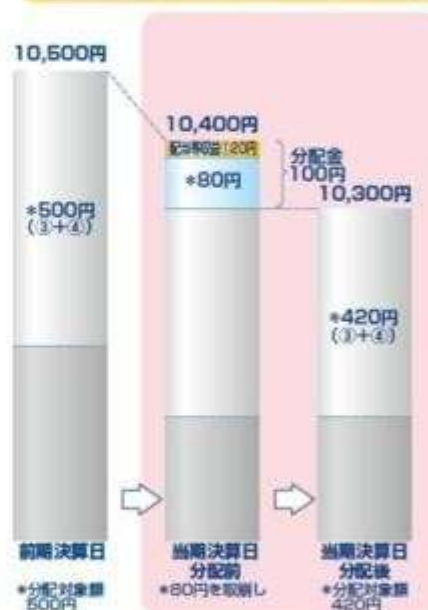
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

#### 前期決算から基準価額が上昇した場合



#### 前期決算から基準価額が下落した場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。  
※ 上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 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ります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※ 元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

- ・ 普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
- ・ 元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、(特別分配金) 元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

### 信託金限度額

- ・ 30兆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】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

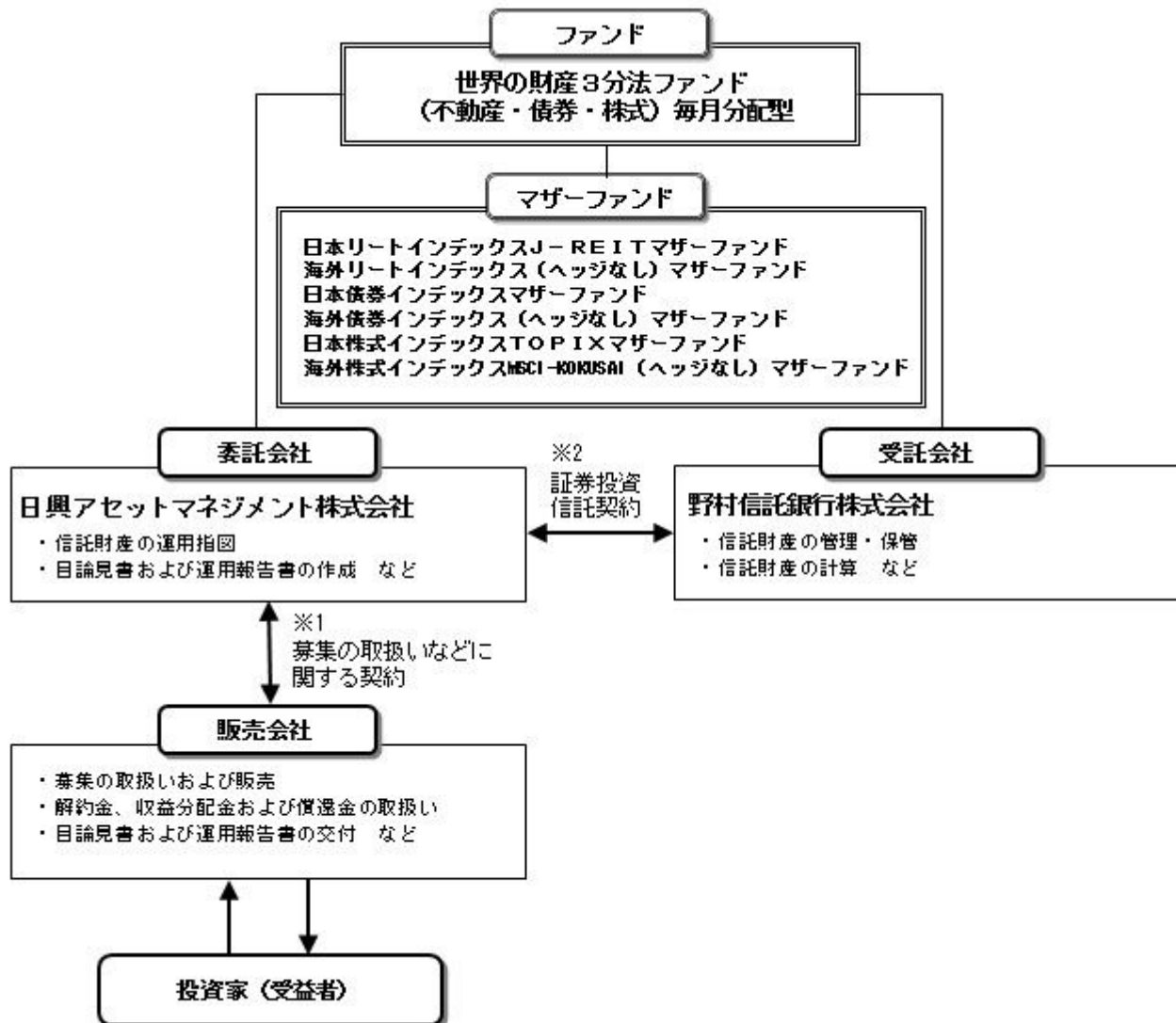
## ・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

## （3）【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2018年6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、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と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。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。
  - 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外リートインデックス(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」
  - 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」
- ・特に「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低いため、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

### (2)【投資対象】

- <世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型>
- 投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) 金銭債権
  - 3) 約束手形
  - 4) 為替手形
- 主として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「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
  - 2) 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 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」
  - 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
  - 6) 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」
  - 7) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
  - 9) 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。)
  - 10) 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。)のうち投資法人債券(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。)に類する証券

以外のもの

- 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。）

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券（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) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 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。）
- 3) 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。）のうち投資法人債券（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。）に類する証券以外のもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

<海外リートインデックス（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に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券（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) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 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。）
- 4) 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。）の

うち投資法人債券(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。)に類する証券以外のもの

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引

#### <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

<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

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

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) 金利先渡し取引
- 5) 為替先渡し取引
- 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

## 投資対象とする投資信託証券の概要

## &lt;日本リートインデックスJ - REITマザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証REIT指数（配当込み） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）

決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）
-----	----------------------

\* 東証REIT指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。  
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

#### < 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### < 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 <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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

\* NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数

で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

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

#### < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

#### <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</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	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）* に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引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> <p>&lt; 2018年9月26日以降 &gt;</p> <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）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</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>



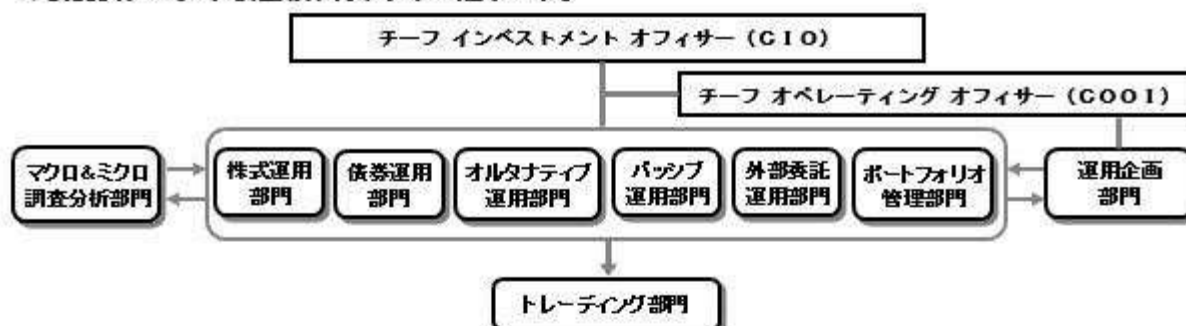
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、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。

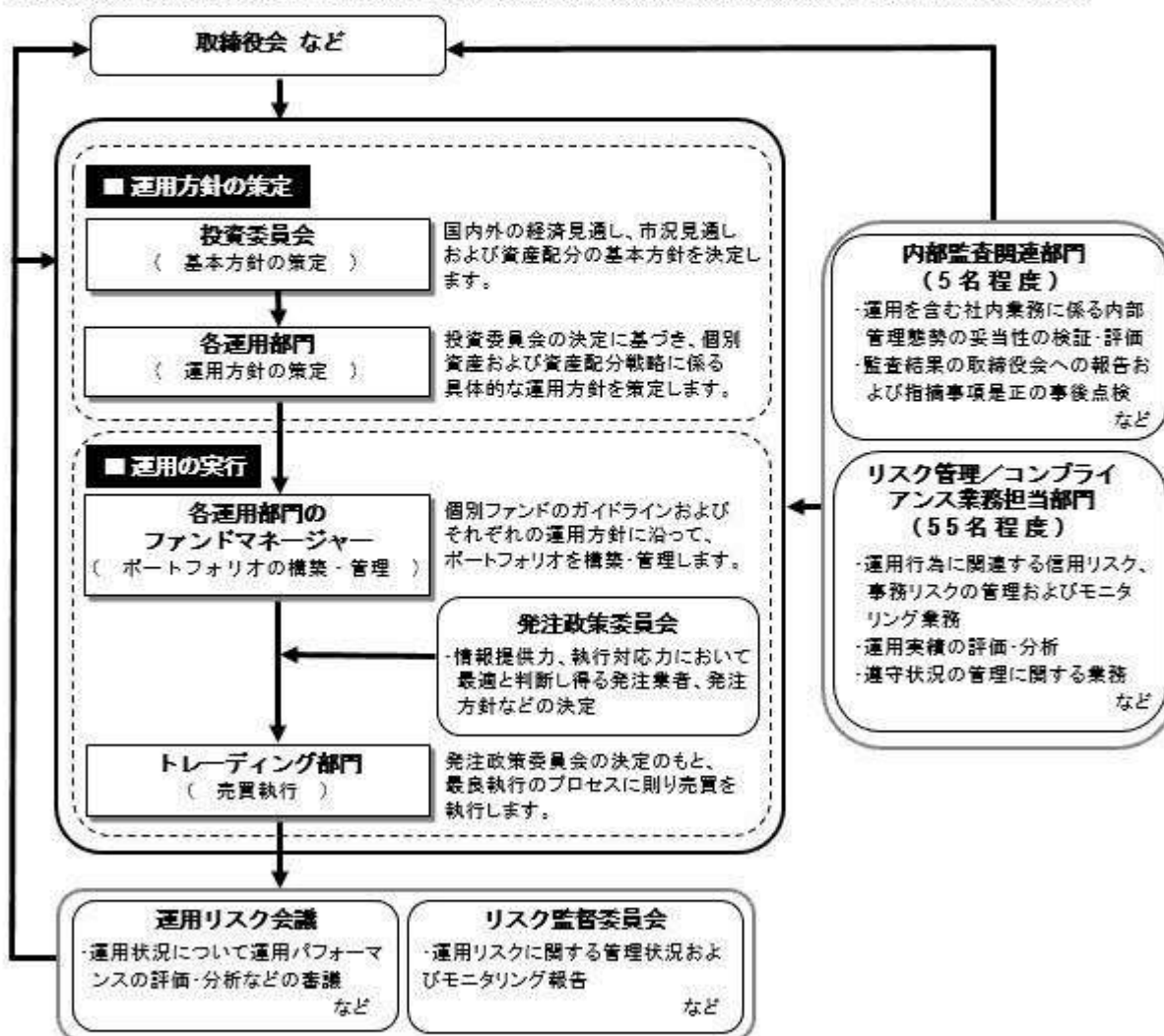
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### （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6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、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

## 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

## &lt; 分配金再投資コース &gt;

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

## &lt; 分配金受取りコース &gt;

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

## (5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

## &lt; 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 &gt;

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
  - 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
  - 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
  - 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
  - 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券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との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
  - 6) 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。
- 7) 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。

## &lt; 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド &gt;

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないませ

ん。

- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 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。

< 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 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。

<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、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>

下記の変更を予定しております。

2018年9月25日まで

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

2018年9月26日以降

- 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。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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



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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 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

- ・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も不動産投信の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・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。
- ・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。
- ・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。

ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド

自身にもこれらのリスクがあります。

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、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。

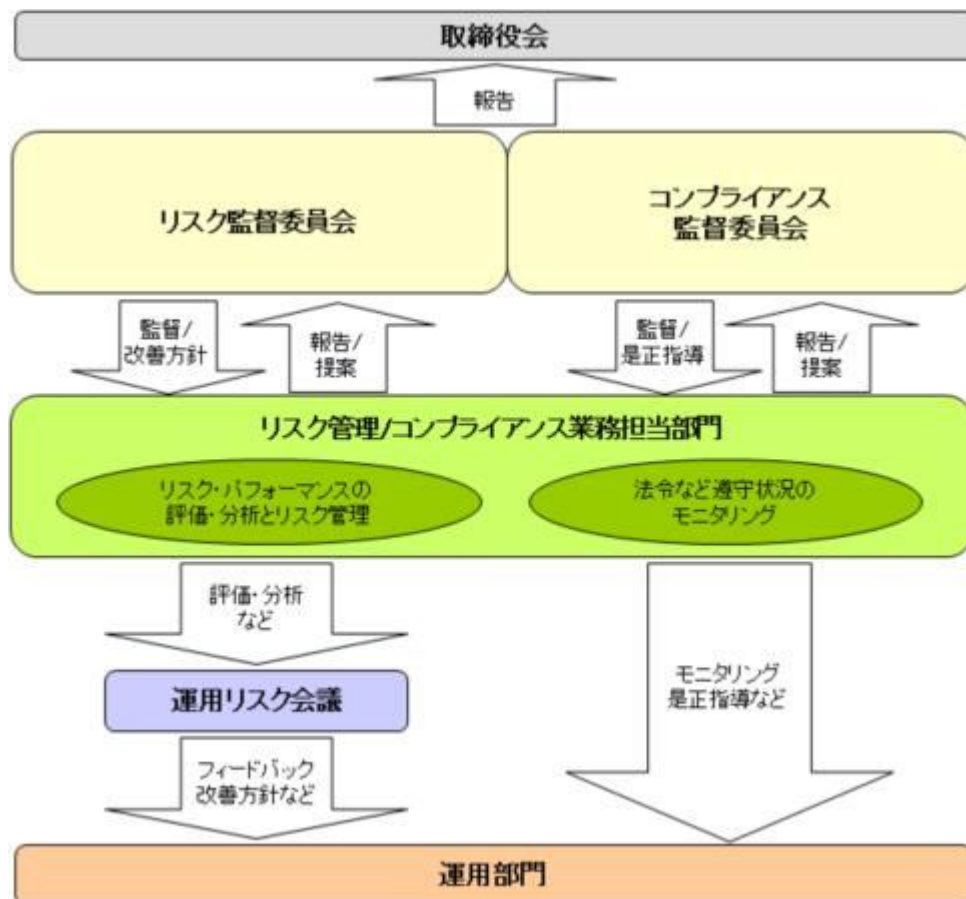
・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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6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	10.2%	18.1%	18.2%	11.7%	2.2%	6.7%	4.0%
最大値	36.6%	65.0%	57.1%	37.2%	9.3%	30.4%	24.1%
最小値	-7.8%	-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7月から2018年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**<各資産クラスの指数>**

日本株 ……東証株価指数(TOPIX, 配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込, 円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

**当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

**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・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

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

### 4【手数料等及び税金】

#### （1）【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

#### （2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

#### （3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.026%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

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
0.95%	0.40%	0.50%	0.05%

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、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

**（４）【その他の手数料等】**

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

ファンドの主要投資対象の1つである「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数（配当込み）」その他これに類する標章の使用料。

ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」その他これに類する標章の使用料。

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

**< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >**

- ・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。

\* 売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに依りて異なり、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依りて異なりますので、表示することができません。

## (5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### 1) 収益分配金に対する課税

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

### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

<sup>\*</sup>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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

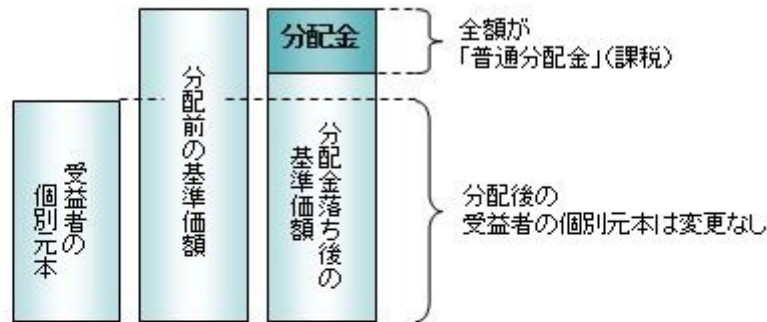
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

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

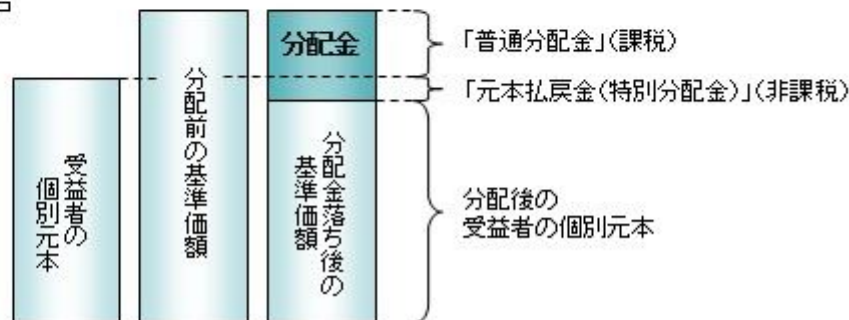
者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2018年9月14日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2018年 6月29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	31,999,820,376	97.94
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		673,941,760	2.06
合計（純資産総額）		32,673,762,136	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	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,705,875,760	1.9813	5,361,151,644	2.0126	5,445,845,554	16.67
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,769,670,671	1.9343	5,357,373,979	1.9641	5,439,910,164	16.65
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	3,829,443,209	1.3963	5,347,051,553	1.3968	5,348,966,274	16.37
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	2,385,031,584	2.2188	5,292,144,658	2.2253	5,307,410,783	16.24
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	2,180,396,670	2.4776	5,402,309,685	2.4092	5,253,011,657	16.08
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックストピックスマザーファンド	3,355,257,829	1.6012	5,372,700,146	1.5512	5,204,675,944	15.93

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.94
合計	97.94

### 【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特定期間末 (2008年12月15日)	93,015	94,145	0.5762	0.5832
第8特定期間末 (2009年6月15日)	97,568	98,553	0.5942	0.6002
第9特定期間末 (2009年12月15日)	99,747	100,783	0.5778	0.5838
第10特定期間末 (2010年6月15日)	96,496	97,363	0.5569	0.5619
第11特定期間末 (2010年12月15日)	88,713	89,187	0.5612	0.5642
第12特定期間末 (2011年6月15日)	76,898	77,323	0.5427	0.5457
第13特定期間末 (2011年12月15日)	59,790	60,171	0.4709	0.4739
第14特定期間末 (2012年6月15日)	55,918	56,146	0.4910	0.4930
第15特定期間末 (2012年12月17日)	55,668	55,874	0.5402	0.5422
第16特定期間末 (2013年6月17日)	57,765	57,856	0.6378	0.6388
第17特定期間末 (2013年12月16日)	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18特定期間末 (2014年6月16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19特定期間末 (2014年12月15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247

第20特定期間末	(2015年 6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末	(2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末	(2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末	(2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末	(2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末	(2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末	(2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
	2017年 6月末日	36,379		0.8320	
	7月末日	35,924		0.8332	
	8月末日	35,422		0.8314	
	9月末日	35,423		0.8443	
	10月末日	34,927		0.8512	
	11月末日	34,787		0.8594	
	12月末日	34,581		0.8691	
	2018年 1月末日	33,946		0.8633	
	2月末日	32,647		0.8351	
	3月末日	32,206		0.8274	
	4月末日	32,747		0.8455	
	5月末日	32,534		0.8448	
	6月末日	32,673		0.8535	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第7特定期間	2008年 6月17日～2008年12月15日	0.0420
第8特定期間	2008年12月16日～2009年 6月15日	0.0380
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	0.0360
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	0.0310
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	0.0240
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.0180
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	0.0180
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	0.0130
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	0.0120
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	0.0070
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060

第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第7特定期間	2008年 6月17日～2008年12月15日	32.89
第8特定期間	2008年12月16日～2009年 6月15日	9.72
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	3.30
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	1.75
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	5.08
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	0.09
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	9.91
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	7.03
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	12.46
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	19.36
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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特定期間	2008年 6月17日～2008年12月15日	9,808,484,367	9,822,577,811
第8特定期間	2008年12月16日～2009年 6月15日	8,688,609,761	5,897,243,897
第9特定期間	2009年 6月16日～2009年12月15日	14,406,774,226	5,986,832,540
第10特定期間	2009年12月16日～2010年 6月15日	10,739,262,952	10,086,629,772
第11特定期間	2010年 6月16日～2010年12月15日	3,738,112,212	18,933,404,132
第12特定期間	2010年12月16日～2011年 6月15日	1,451,825,844	17,852,733,674

第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	1,137,780,912	15,842,664,215
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	787,842,918	13,892,127,349
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	645,492,480	11,463,657,624
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	755,347,566	13,250,917,932
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940

（参考）

## 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	7,330,498,260	98.68
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		97,935,976	1.32
合計（純資産総額）		7,428,434,236	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	858	619,000	531,102,000	639,000	548,262,000	7.38
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	881	572,000	503,932,000	586,000	516,266,000	6.95
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2,621	157,200	412,021,200	156,300	409,662,300	5.51
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	1,953	172,500	336,892,500	171,900	335,720,700	4.52
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	1,672	200,700	335,570,400	199,600	333,731,200	4.49

日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	1,757	174,200	306,069,400	176,900	310,813,300	4.18
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,180	229,600	270,928,000	229,800	271,164,000	3.65
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,030	261,900	269,757,000	262,900	270,787,000	3.65
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	820	277,500	227,550,000	283,800	232,716,000	3.13
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	559	404,000	225,836,000	402,500	224,997,500	3.03
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	1,838	119,300	219,273,400	117,600	216,148,800	2.91
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	2,556	81,000	207,036,000	83,000	212,148,000	2.86
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	401	485,000	194,485,000	508,000	203,708,000	2.74
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	273	684,000	186,732,000	688,000	187,824,000	2.53
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2,219	68,700	152,445,300	72,600	161,099,400	2.17
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	294	491,000	144,354,000	504,000	148,176,000	1.99
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	951	140,100	133,235,100	142,100	135,137,100	1.82
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	301	451,000	135,751,000	445,000	133,945,000	1.80
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	590	225,300	132,927,000	225,700	133,163,000	1.79
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	1,029	120,800	124,303,200	123,400	126,978,600	1.71
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	2,429	50,800	123,393,200	49,900	121,207,100	1.63
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	189	638,000	120,582,000	636,000	120,204,000	1.62
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	793	144,400	114,509,200	142,700	113,161,100	1.52
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	841	122,700	103,190,700	127,700	107,395,700	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	601	168,800	101,448,800	171,600	103,131,600	1.39
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	633	160,000	101,280,000	158,700	100,457,100	1.35
日本	投資証券	プレミア投資法人 投資証券	800	105,900	84,720,000	112,400	89,920,000	1.21
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	996	87,300	86,950,800	89,100	88,743,600	1.19
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	594	148,600	88,268,400	149,000	88,506,000	1.19
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	336	259,300	87,124,800	261,000	87,696,000	1.18

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.68
合計	98.68

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	4,622,014,962	70.05
	カナダ	113,788,893	1.72
	ドイツ	16,709,465	0.25
	イタリア	7,242,310	0.11
	フランス	317,803,394	4.82
	オランダ	29,373,605	0.45
	スペイン	66,223,635	1.00
	ベルギー	47,822,556	0.72
	アイルランド	16,546,467	0.25
	イギリス	354,525,978	5.37
	オーストラリア	436,738,923	6.62
	ニュージーランド	14,683,207	0.22
	香港	142,675,903	2.16
	シンガポール	224,182,904	3.40
	イスラエル	3,942,405	0.06
	ガンジー	4,818,198	0.07
マン島	3,607,160	0.05	
	小計	6,422,699,965	97.34
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		175,439,372	2.66
合計（純資産総額）		6,598,139,337	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		5,116,000	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	15,730	18,134.08	285,249,189	18,925.55	297,698,955	4.51
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	27,071	7,120.98	192,772,233	7,201.68	194,956,706	2.95
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	7,606	23,706.40	180,310,942	25,305.92	192,476,844	2.92
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,861	24,494.76	168,058,582	23,931.96	164,197,184	2.49
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,019	18,590.61	130,487,542	18,947.66	132,993,635	2.02
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,700	7,046.92	131,777,497	6,997.18	130,847,303	1.98
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	18,900	6,370.42	120,400,942	6,893.27	130,282,886	1.97
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	10,463	11,786.88	123,326,127	12,202.51	127,674,868	1.94
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	18,104	6,014.48	108,886,171	6,349.41	114,949,856	1.74
香港	投資証券	LINK REIT	109,300	1,006.02	109,958,642	1,000.39	109,342,627	1.66
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	7,846	13,251.53	103,971,545	13,810.86	108,360,067	1.64
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	271,380	341.68	92,726,096	356.29	96,690,632	1.47
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,355	25,958.10	87,089,453	26,042.11	87,371,308	1.32
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	37,649	2,357.81	88,769,498	2,305.86	86,813,489	1.32
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	14,449	5,857.51	84,635,229	6,002.32	86,727,551	1.31
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,233	14,111.53	73,845,670	13,965.62	73,082,108	1.11
アメリカ	投資証券	GGP INC	32,135	2,291.49	73,637,166	2,264.96	72,784,637	1.10
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	8,804	7,952.24	70,011,588	8,144.58	71,704,946	1.09
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,408	10,780.96	69,084,431	11,065.05	70,904,866	1.07
アメリカ	投資証券	HCP INC	23,893	2,638.58	63,043,826	2,840.87	67,877,098	1.03
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,784	10,708.00	61,935,128	11,192.17	64,735,540	0.98
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	81,794	770.20	62,998,426	782.38	63,994,186	0.97
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	18,140	3,155.91	57,248,334	3,203.44	58,110,568	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	13,610	4,101.03	55,815,073	4,150.77	56,492,075	0.86
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	14,323	3,757.25	53,815,157	3,830.21	54,860,112	0.83
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	38,361	1,377.94	52,859,260	1,386.61	53,192,057	0.81
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,722	13,385.28	49,820,044	13,946.83	51,910,108	0.79
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	7,493	6,633.50	49,704,856	6,904.32	51,734,133	0.78
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	4,499	10,815.23	48,657,736	11,142.43	50,129,802	0.76
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	51,379	968.75	49,773,561	960.36	49,342,684	0.75

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.34
合計	97.34

## 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	ユーロ	売建	40,000.00	5,086,792	5,116,000	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29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	29,658,669,225	78.22
地方債証券	日本	2,596,854,000	6.85
特殊債券	日本	3,319,507,000	8.75
社債券	日本	2,157,867,844	5.69
	オーストラリア	100,328,000	0.26
	小計	2,258,195,844	5.96
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		83,346,574	0.22
合計(純資産総額)		37,916,572,643	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)	910,000,000	102.40	931,840,000	102.66	934,224,200	0.300	2025/12/20	2.46
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	100.63	613,903,400	101.01	616,203,700	0.100	2026/12/20	1.63
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	102.94	598,127,880	101.86	591,853,080	1.400	2019/9/20	1.56
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.60	563,404,800	100.44	562,480,800	0.100	2020/6/20	1.48
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.65	507,929,100	103.62	507,762,500	0.500	2024/9/20	1.34
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.56	507,838,100	100.38	506,949,300	0.100	2020/3/20	1.34
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.51	492,518,600	100.95	494,699,100	0.100	2027/3/20	1.30
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	490,000,000	100.49	492,412,900	100.80	493,934,700	0.100	2027/12/20	1.30
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	103.10	487,667,730	102.10	482,947,190	1.300	2019/12/20	1.27
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.15	433,255,200	103.33	434,007,000	0.400	2025/9/20	1.14



日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	340,000,000	120.12	408,428,400	120.48	409,662,600	1.700	2032/9/20	1.08
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	104.79	387,730,400	103.88	384,363,400	1.300	2021/3/20	1.01
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	380,000,000	100.62	382,380,400	100.72	382,758,800	0.100	2028/3/20	1.01
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	103.08	381,431,300	103.25	382,039,800	0.400	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	134.28	370,629,360	136.26	376,091,400	2.400	2038/9/20	0.99
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	119.66	358,983,000	118.70	356,106,000	2.300	2026/6/20	0.94
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.85	356,267,900	122.32	354,742,500	2.100	2029/9/20	0.94
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.67	332,220,900	100.40	331,326,600	0.200	2019/9/20	0.87
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.65	327,119,000	100.50	326,625,000	0.100	2020/9/20	0.86
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	310,000,000	103.10	319,628,600	103.17	319,827,000	0.400	2025/3/20	0.84
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	107.61	317,449,500	106.80	315,071,800	1.400	2022/12/20	0.83
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.51	301,545,000	100.33	301,014,000	0.100	2019/12/20	0.79
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	120.12	300,317,500	119.19	297,995,000	2.300	2026/9/20	0.79
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	131.56	273,655,200	132.11	274,788,800	2.400	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	131.73	263,466,000	134.40	268,804,000	2.200	2041/3/20	0.71
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	117.34	252,287,450	118.46	254,699,750	1.500	2034/6/20	0.67
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	106.82	253,172,880	105.52	250,098,990	1.900	2021/3/22	0.66
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	205,000,000	120.62	247,291,350	121.00	248,062,300	1.700	2033/6/20	0.65
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	245,000,000	100.70	246,734,400	101.11	247,739,100	0.100	2026/6/20	0.65
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	195,000,000	121.76	237,447,600	124.99	243,738,300	1.700	2044/6/20	0.64

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.22
地方債証券	6.85
特殊債券	8.75
社債券	5.96
合計	99.78

## 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 6月29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	65,822,885,763	44.02
	カナダ	3,108,706,087	2.08
	メキシコ	1,196,740,893	0.80
	ドイツ	10,524,526,458	7.04
	イタリア	13,539,611,952	9.06
	フランス	15,014,822,869	10.04
	オランダ	3,206,683,715	2.14
	スペイン	8,732,574,275	5.84
	ベルギー	3,747,554,493	2.51
	オーストリア	2,309,590,450	1.54
	フィンランド	938,250,064	0.63
	アイルランド	1,271,625,833	0.85
	イギリス	10,353,535,760	6.92
	スイス	207,128,612	0.14
	スウェーデン	562,886,139	0.38
	ノルウェー	355,630,306	0.24
	デンマーク	891,134,042	0.60
	ポーランド	927,866,906	0.62
	オーストラリア	3,141,097,118	2.10
	シンガポール	616,091,516	0.41
マレーシア	723,423,613	0.48	
南アフリカ	840,349,719	0.56	
	小計	148,032,716,583	99.01
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,482,843,443	0.99
合計（純資産総額）		149,515,560,026	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------	------	-----------------

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	13,682.64	1,265,644,311	12,959.09	1,198,715,878	8.000	2021/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,530,000	11,446.50	1,205,317,022	11,190.66	1,178,376,561	3.375	2019/11/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,966.77	1,063,776,970	10,704.24	1,038,311,317	1.875	2022/7/31	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	10,892.08	980,287,290	10,852.78	976,750,563	0.750	2019/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,070,000	11,548.19	931,939,028	11,253.27	908,138,926	3.625	2020/2/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,557.04	904,916,657	11,251.11	880,962,299	3.500	2020/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,824.71	882,214,512	10,562.61	860,853,248	1.750	2023/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,085.95	825,903,805	10,962.24	816,686,936	1.750	2019/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,610,000	13,189.88	739,952,663	12,464.24	699,244,269	8.750	2020/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,148.13	674,462,220	10,898.11	659,336,048	2.125	2021/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	10,705.28	653,022,627	10,508.20	641,000,734	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,024.20	653,735,622	10,697.55	634,364,876	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,959.22	650,977,847	10,633.42	631,625,651	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,223.47	650,961,836	10,883.22	631,227,152	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	12,474.18	638,678,260	12,325.21	631,050,752	3.625	2043/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,957.49	635,534,917	10,865.51	630,200,058	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,991.60	637,512,810	10,712.23	621,309,481	2.000	2023/2/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	16,021.86	629,659,330	15,765.48	619,583,486	4.250	2023/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,138.19	598,121,250	10,932.45	587,072,577	2.000	2020/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,192.17	593,185,275	10,932.66	579,430,993	2.250	2021/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,258.49	596,700,447	10,928.12	579,190,789	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,906.32	578,035,470	10,838.96	574,465,227	2.875	2045/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	20,876.19	567,832,398	21,085.23	573,518,376	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	11,322.97	586,530,070	11,069.33	573,391,392	2.625	2020/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	12,740.59	573,326,874	12,575.21	565,884,824	3.750	2043/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,920,000	14,620.44	573,121,467	14,359.73	562,901,785	3.250	2021/10/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,900,000	14,656.42	571,600,640	14,324.07	558,639,096	3.750	2021/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,960,000	14,695.08	581,925,450	14,026.91	555,465,954	6.125	2027/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	10,927.05	557,279,849	10,852.56	553,480,711	1.000	2019/10/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	10,998.50	560,923,955	10,841.77	552,930,487	1.500	2020/5/31	0.37

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.01
合計	99.01

## 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。

## 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6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,793,146,350	99.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		216,710,499	0.75
合計（純資産総額）		29,009,856,849	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	103,830,000	0.36

(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	141,600	7,035.17	996,181,202	7,170.00	1,015,272,000	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	804,400	765.54	615,805,680	631.10	507,656,840	1.75
日本	株式	ソニー	電気機器	78,000	4,352.19	339,471,493	5,664.00	441,792,000	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	82,100	5,344.83	438,810,726	5,036.00	413,455,600	1.43
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	51,800	10,014.09	518,730,040	7,973.00	413,001,400	1.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	87,000	4,522.72	393,476,673	4,306.00	374,622,000	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,700	62,073.94	353,821,464	62,560.00	356,592,000	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	104,800	3,517.88	368,674,774	3,253.00	340,914,400	1.18
日本	株式	KDDI	情報・通信業	100,700	3,002.23	302,324,561	3,031.00	305,221,700	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,561,200	204.06	318,588,490	186.50	291,163,800	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	85,900	2,739.88	235,356,542	3,066.00	263,369,400	0.91
日本	株式	任天堂	その他製品	7,200	42,548.53	306,349,480	36,200.00	260,640,000	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	80,500	2,689.36	216,493,770	3,078.00	247,779,000	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	11,100	25,084.55	278,438,520	22,005.00	244,255,500	0.84
日本	株式	花王	化学	28,600	7,193.76	205,741,740	8,450.00	241,670,000	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,400	20,618.48	214,432,234	22,960.00	238,784,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	14,000	14,741.86	206,386,077	16,625.00	232,750,000	0.80

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	48,100	4,559.55	219,314,450	4,831.00	232,371,100	0.80
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	82,200	2,706.15	222,445,821	2,822.50	232,009,500	0.80
日本	株式	キヤノン	電気機器	62,700	4,154.71	260,500,512	3,631.00	227,663,700	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,200	17,229.57	210,200,866	18,620.00	227,164,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	43,300	4,883.71	211,465,056	5,193.00	224,856,900	0.78
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	72,300	3,744.85	270,752,954	3,095.00	223,768,500	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	20,900	10,830.68	226,361,388	10,615.00	221,853,500	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	280,000	857.97	240,234,160	781.60	218,848,000	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	15,900	12,522.37	199,105,755	13,270.00	210,993,000	0.73
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	42,900	6,254.44	268,315,567	4,678.00	200,686,200	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	133,100	1,699.81	226,245,514	1,493.50	198,784,850	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	20,100	11,293.76	227,004,576	9,873.00	198,447,300	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	114,500	1,522.88	174,369,760	1,689.00	193,390,500	0.67

## 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	0.11
		鉱業	0.29
		建設業	3.15
		食料品	4.46
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.36
		医薬品	4.71
		石油・石炭製品	0.76
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.02
		非鉄金属	0.84
		金属製品	0.62
		機械	5.11
		電気機器	13.53
		輸送用機器	8.55
		精密機器	1.72
		その他製品	2.07
		電気・ガス業	1.75
陸運業	4.35		
海運業	0.19		
空運業	0.57		
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.46		
卸売業	4.76		

	小売業	5.00
	銀行業	6.61
	証券、商品先物取引業	0.92
	保険業	2.24
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.41
	サービス業	4.59
合 計		99.25

### 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09月	買建		6日本円	104,053,240	103,830,000	0.36

(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 6月29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	8,774,911	0.01
株式	アメリカ	51,977,485,169	61.54
	カナダ	3,137,461,413	3.71
	モーリシャス	3,255,837	0.00
	ドイツ	3,073,416,337	3.64
	イタリア	634,111,766	0.75
	フランス	3,153,871,162	3.73
	オランダ	1,532,635,951	1.81
	スペイン	992,803,741	1.18
	ベルギー	349,659,294	0.41
	オーストリア	77,965,175	0.09
	ルクセンブルク	107,250,989	0.13
	フィンランド	335,034,161	0.40
	アイルランド	1,233,595,887	1.46
ポルトガル	55,104,090	0.07	

	イギリス	5,427,875,664	6.43
	スイス	2,761,162,484	3.27
	スウェーデン	809,335,589	0.96
	ノルウェー	237,553,549	0.28
	デンマーク	535,066,740	0.63
	ケイマン	215,686,080	0.26
	オーストラリア	2,069,907,501	2.45
	バミューダ	223,280,406	0.26
	ニュージーランド	69,666,948	0.08
	香港	882,505,018	1.04
	シンガポール	395,839,198	0.47
	イスラエル	171,043,779	0.20
	ジャージー	399,774,467	0.47
	英ヴァージン諸島	21,983,222	0.03
	アラブ首長国連邦	10,820,537	0.01
	マン島	16,541,096	0.02
	小計	80,911,693,250	95.80
投資証券	アメリカ	1,576,682,144	1.87
	カナダ	15,093,181	0.02
	フランス	117,222,682	0.14
	イギリス	72,599,155	0.09
	オーストラリア	182,822,872	0.22
	香港	46,017,940	0.05
	シンガポール	33,951,367	0.04
	小計	2,044,389,341	2.42
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,494,172,817	1.77
合計（純資産総額）		84,459,030,319	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	1,803,681,180	2.14
	買建	ドイツ	460,322,508	0.55

(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		1,800,581,500	2.13

(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	104,912	17,320.51	1,817,129,618	20,505.16	2,151,238,395	2.55
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	151,184	8,744.05	1,321,961,321	10,902.56	1,648,292,661	1.95
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,505	110,029.86	935,803,993	188,078.28	1,599,605,797	1.89
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	49,560	18,915.32	937,443,326	21,691.26	1,075,019,054	1.27
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	70,940	11,182.22	793,267,140	11,598.96	822,830,378	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,512	108,073.88	703,777,148	123,165.87	802,056,203	0.95
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	87,591	9,175.24	803,669,057	9,060.96	793,658,880	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,170	110,024.76	678,852,826	124,554.26	768,499,792	0.91
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	55,511	15,681.15	870,476,659	13,485.88	748,614,685	0.89
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	201,289	3,058.64	615,670,949	3,169.18	637,921,435	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	96,710	6,113.58	591,245,197	5,928.26	573,322,044	0.68
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,541	13,087.17	517,479,936	13,890.45	549,242,537	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	37,342	12,125.52	452,791,456	14,673.07	547,922,138	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	26,380	20,908.00	551,553,056	20,680.92	545,562,896	0.65
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	64,403	9,019.67	580,893,823	8,460.14	544,858,654	0.65
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	20,020	23,026.37	460,988,127	27,071.24	541,966,345	0.64
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	149,007	3,695.54	550,661,369	3,558.28	530,209,015	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	96,672	4,532.25	438,141,777	5,444.09	526,291,552	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	24,180	18,401.04	444,937,209	21,578.51	521,768,454	0.62
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	123,260	3,996.37	492,592,732	4,019.23	495,410,832	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	85,337	5,372.65	458,486,385	5,622.06	479,770,110	0.57
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	99,420	3,810.31	378,821,398	4,746.58	471,905,739	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	52,049	9,586.66	498,976,160	8,627.64	449,060,399	0.53
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	11,542	28,842.15	332,896,139	36,992.21	426,964,099	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	413,591	1,070.85	442,897,600	1,026.29	424,468,368	0.50



アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	19,340	16,219.47	313,684,595	21,787.43	421,368,974	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	83,812	5,080.24	425,785,825	4,805.17	402,731,227	0.48
アメリカ	株式	NETFLIX INC	小売	8,970	21,864.74	196,126,746	43,709.72	392,076,249	0.46
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	53,017	8,140.16	431,567,159	7,392.91	391,950,185	0.46
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	55,743	6,883.48	383,705,881	6,665.56	371,558,423	0.44

## 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	7.14
		素材	4.71
		資本財	7.01
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.38
		耐久消費財・アパレル	1.83
		消費者サービス	1.81
		メディア	1.98
		小売	4.85
		食品・生活必需品小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	4.78
		家庭用品・パーソナル用品	1.84
		ヘルスケア機器・サービス	4.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.69
		銀行	8.77
		各種金融	4.35
		保険	3.74
		不動産	0.55
		ソフトウェア・サービス	11.50
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.29		
電気通信サービス	2.33		
公益事業	3.05		
半導体・半導体製造装置	3.05		
投資証券			2.42
合計			98.23

## 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 1809	買建	120	米ドル	16,518,850	1,825,993,679	16,317,000	1,803,681,180	2.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1809	買建	120	ユーロ	3,638,570	465,409,489	3,598,800	460,322,508	0.55

(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	12,900,000.00	1,416,125,510	1,423,264,500	1.69
	ユーロ	買建	2,950,000.00	381,037,090	377,317,000	0.45

(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6月29日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………8,535円

純資産総額……………326.73億円

※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6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)

2018年2月	2018年3月	2018年4月	2018年5月	2018年6月	最近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	4,760円

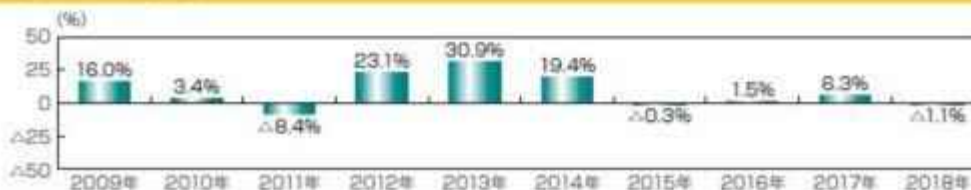
## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.6%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	7.4%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	6.9%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	5.5%
			ユナイテッドアーバン投資法人 投資証券	日本	4.5%
			日本リテールファンド投資法人 投資証券	日本	4.5%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.7%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.5%
			PROLOGIS INC	アメリカ	3.0%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.9%
			UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	フランス	2.5%
			AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.0%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.4%	第341回利付国債(10年)	日本	2.5%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.5%
			第335回利付国債(10年)	日本	1.3%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.2%	US TREASURY N/B(8%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(3.375%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(1.875%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(0.75%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(3.625%)	アメリカ	0.6%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	15.9%	トヨタ自動車	日本	3.5%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	1.7%
			ソニー	日本	1.5%
			日本電信電話	日本	1.4%
			ソフトバンクグループ	日本	1.4%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.1%	APPLE INC	アメリカ	2.5%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	2.0%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.9%
			FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.3%
			JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
現金その他		2.1%			

\*1:当ファンドの対純資産総額比です。また、合計の比率が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

\*2: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6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

## (2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

## ＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

## ＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

## (3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

## (4) 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。

## (5) 取得申込不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

## (6) 申込金額

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

## (7) 申込単位

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 <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。

## (8) 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。

## (9) 受付の中止および取消

委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、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。

## (10) 償還乗換

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

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

## (11) 乗換優遇

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

社にお問い合わせください。

## 2【換金（解約）手続等】

### < 解約請求による換金 >

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (2) 取扱時間

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

#### (3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

#### (4) 解約制限

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

#### (5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

#### < 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

#### (7) 解約単位

1口単位

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

#### (8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

#### (9) 受付の中止および取消

・委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

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

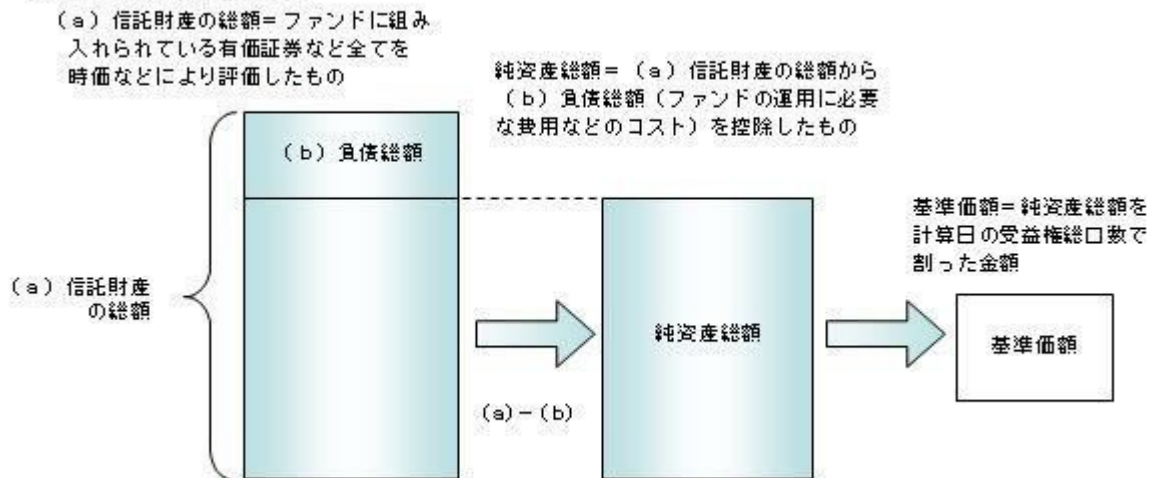
## 3【資産管理等の概要】

### (1)【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

#### <基準価額算出の流れ>



#### 有価証券などの評価基準

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

#### <主な資産の評価方法>

##### 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。

##### 国内上場不動産投信

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。

##### 海外上場不動産投信

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。

- ・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 <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(2005年9月29日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4)【計算期間】

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)

4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)

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

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)

4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

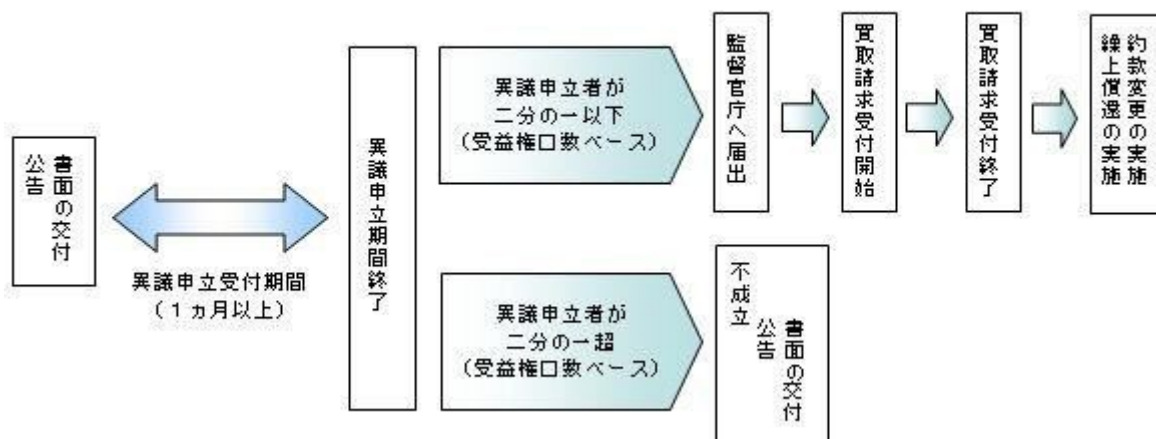
異議の申立て

1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手

続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回（6月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <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) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 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、平成29年12月16日から平成30年6月15日までの特定期間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】

## 【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成29年12月15日現在	当期 平成30年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	162,443,692
コール・ローン	663,428,896	534,622,558
親投資信託受益証券	33,878,460,290	32,193,127,211
未収入金	175,040,834	120,056,257
流動資産合計	34,716,930,020	33,010,249,718
資産合計	34,716,930,020	33,010,249,718
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	40,061,794	38,370,708
未払解約金	75,641,348	40,441,502
未払受託者報酬	1,544,488	1,506,616
未払委託者報酬	27,800,995	27,119,309
未払利息	703	993
その他未払費用	3,279,862	6,852,128
流動負債合計	148,329,190	114,291,256
負債合計	148,329,190	114,291,256
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	40,061,794,146	38,370,708,488
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,493,193,316	5,474,750,026
（分配準備積立金）	1,090,822,479	1,304,212,189
元本等合計	34,568,600,830	32,895,958,462
純資産合計	34,568,600,830	32,895,958,462
負債純資産合計	34,716,930,020	33,010,249,718

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	平成29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自	平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
営業収益				
受取利息		52		200
有価証券売買等損益		1,900,706,508		176,764,488
営業収益合計		1,900,706,560		176,764,688
営業費用				
支払利息		167,555		165,835
受託者報酬		9,615,359		8,917,201
委託者報酬		173,077,611		160,510,682
その他費用		4,070,761		4,452,778
営業費用合計		186,931,286		174,046,496
営業利益又は営業損失（ ）		1,713,775,274		2,718,192
経常利益又は経常損失（ ）		1,713,775,274		2,718,192
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,713,775,274		2,718,192
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（ ）		24,345,709		2,076,458
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,579,586,288		5,493,193,316
剰余金増加額又は欠損金減少額		755,267,640		388,176,704
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		755,267,640		388,176,704
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		107,218,262		136,734,341
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		107,218,262		136,734,341
分配金		251,085,971		233,640,807
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,493,193,316		5,474,750,026

## （ 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 ）

		前期 平成29年12月15日現在	当期 平成30年 6月15日現在
1.	期首元本額	44,022,611,634円	40,061,794,146円
	期中追加設定元本額	675,282,245円	900,474,282円
	期中一部解約元本額	4,636,099,733円	2,591,559,940円
2.	受益権の総数	40,061,794,146口	38,370,708,488口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	5,493,193,316円	5,474,750,026円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

前期 自 平成29年 6月16日 至 平成29年12月15日		当期 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日	
分配金の計算過程 自 平成29年 6月16日 至 平成29年 7月18日		分配金の計算過程 自 平成29年12月16日 至 平成30年 1月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	69,962,775円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 74,943,292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	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 136,178,300円
C	信託約款に定める収益調整金	357,712,439円	C 信託約款に定める収益調整金 343,432,841円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,063,310,181円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 1,075,355,233円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	1,490,985,395円	E 分配対象収益（A+B+C+D） 1,629,909,666円
F	分配対象収益(1万口当たり)	343円	F 分配対象収益(1万口当たり) 411円
G	分配金額	43,438,989円	G 分配金額 39,572,220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
自 平成29年 7月19日 至 平成29年 8月15日		自 平成30年 1月16日 至 平成30年 2月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	29,412,299円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 34,385,066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	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	354,621,585円	C 信託約款に定める収益調整金 343,922,175円

D	信託約款に定める分配準備積立金	1,073,343,423円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,230,267,713円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,457,377,307円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,608,574,954円
F	分配対象収益(1万口当たり)	340円	F	分配対象収益(1万口当たり)	410円
G	分配金額	42,820,738円	G	分配金額	39,146,599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
	自 平成29年 8月16日			自 平成30年 2月16日	
	至 平成29年 9月15日			至 平成30年 3月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	75,064,497円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	70,346,691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	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	355,726,836円	C	信託約款に定める収益調整金	346,662,248円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,047,332,483円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,218,733,081円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,478,123,816円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,635,742,020円
F	分配対象収益(1万口当たり)	348円	F	分配対象収益(1万口当たり)	419円
G	分配金額	42,443,331円	G	分配金額	39,036,121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
	自 平成29年 9月16日			自 平成30年 3月16日	
	至 平成29年10月16日			至 平成30年 4月16日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	98,712,915円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	89,073,571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	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	351,259,134円	C	信託約款に定める収益調整金	348,028,442円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,056,454,645円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,239,826,107円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,506,426,694円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,676,928,120円
F	分配対象収益(1万口当たり)	362円	F	分配対象収益(1万口当たり)	432円
G	分配金額	41,580,270円	G	分配金額	38,804,588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
	自 平成29年10月17日			自 平成30年 4月17日	
	至 平成29年11月15日			至 平成30年 5月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	44,053,734円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	62,204,824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	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	347,880,796円	C	信託約款に定める収益調整金	353,543,700円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,088,767,103円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,281,109,059円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,480,701,633円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,696,857,583円
F	分配対象収益(1万口当たり)	363円	F	分配対象収益(1万口当たり)	438円
G	分配金額	40,740,849円	G	分配金額	38,710,571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
	自 平成29年11月16日			自 平成30年 5月16日	
	至 平成29年12月15日			至 平成30年 6月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	58,454,651円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	56,946,512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	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	344,601,948円	C	信託約款に定める収益調整金	359,081,295円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,072,429,622円	D	信託約款に定める分配準備積立金	1,285,636,385円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	1,475,486,221円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	1,701,664,192円
F	分配対象収益(1万口当たり)	368円	F	分配対象収益(1万口当たり)	443円
G	分配金額	40,061,794円	G	分配金額	38,370,708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

	前期 自 平成29年 6月16日 至 平成29年12月15日	当期 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15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

	前期 平成29年12月15日現在	当期 平成30年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(2)デリバティブ取引 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。	(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)

前期（平成29年12月15日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の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	461,513,891
合計	461,513,891

当期（平成30年 6月15日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の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	193,257,687
合計	193,257,687

## (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)

前期 平成29年12月15日現在	当期 平成30年 6月15日現在
1口当たり純資産額	0.8629円
	1口当たり純資産額
	0.8573円

(1万口当たり純資産額)	(8,629円)	(1万口当たり純資産額)	(8,573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	2,184,327,321	5,412,107,803	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,835,405,455	5,355,376,636	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,384,654,413	5,291,309,677	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,353,898,807	5,370,598,159	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,784,033,392	5,385,155,790	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,714,671,754	5,378,579,146	
合計		17,256,991,142	32,193,127,211	

(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、「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」「海外リートインデックス(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」「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



OKUSA I (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)

## 日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

	平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	12,452,796
コール・ローン	61,568,931	40,983,712
投資証券	7,044,666,350	7,244,713,500
未収配当金	33,548,829	45,500,810
流動資産合計	7,139,784,110	7,343,650,818
資産合計	7,139,784,110	7,343,650,818
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	8,505,000	-
未払解約金	8,546,244	18,291,571
未払利息	65	76
流動負債合計	17,051,309	18,291,647
負債合計	17,051,309	18,291,647
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,905,777,315	3,787,119,953
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	3,216,955,486	3,538,239,218
元本等合計	7,122,732,801	7,325,359,171
純資産合計	7,122,732,801	7,325,359,171
負債純資産合計	7,139,784,110	7,343,650,818

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
--	--

## (貸借対照表に関する注記)

		平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
1.	期首	平成29年 6月16日	平成29年12月16日
	期首元本額	3,661,846,461円	3,905,777,315円
	期首からの追加設定元本額	311,356,405円	219,052,376円
	期首からの一部解約元本額	67,425,551円	337,709,738円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,116,346,036円	2,784,033,392円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	649,507,199円	812,386,879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)	139,924,080円	190,699,682円
	計	3,905,777,315円	3,787,119,953円
2.	受益権の総数	3,905,777,315口	3,787,119,953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29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15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。当該有価証券の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12月15日現在	平成30年 6月15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)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)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12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	278,808,704
合計	278,808,704

（平成30年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,830,770
合計	4,830,770

(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12月15日現在		平成30年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.8236円	1口当たり純資産額	1.9343円
(1万口当たり純資産額)	(18,236円)	(1万口当たり純資産額)	(19,343円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	294	144,354,000	
	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	988	82,004,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	951	133,235,100	
	産業ファンド投資法人 投資証券	1,029	124,303,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	820	227,550,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	451	73,107,100	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	401	194,485,000	
	GLP投資法人 投資証券	1,838	219,273,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	336	87,124,800	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,180	270,928,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	140	78,680,000	
	Oneリート投資法人 投資証券	97	24,414,900	
	イオンリート投資法人 投資証券	841	103,190,700	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	601	101,448,800	
	日本リート投資法人 投資証券	238	77,826,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	5,219	76,197,400	
	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	43	7,335,800	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2,219	152,445,300	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	142	15,932,400	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	322	78,890,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	109	11,946,400		
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	154	14,830,200		

野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2,621	412,021,200	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	139	18,459,200	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	668	74,214,800	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	208	22,027,200	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	71	8,307,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	168	56,868,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	149	13,007,700	
さくら総合リート投資法人 投資証券	213	19,617,300	
投資法人みらい 投資証券	129	24,123,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	192	28,339,200	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	82	22,140,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	89	10,137,100	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	82	9,348,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	858	531,102,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	881	503,932,000	
日本リートファンド投資法人 投資証券	1,672	335,570,400	
オリックス不動産投資法人 投資証券	1,757	306,069,400	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	559	225,836,000	
プレミアム投資法人 投資証券	800	84,720,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	594	88,268,400	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	562	61,820,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	1,953	336,892,500	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	633	101,280,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	2,429	123,393,200	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	301	135,751,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	552	59,505,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	590	132,927,000	
福岡リート投資法人 投資証券	458	79,600,400	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	273	186,732,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	686	57,075,200	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	191	121,858,000	
阪急リート投資法人 投資証券	387	53,251,200	
スターツプロシード投資法人 投資証券	140	22,764,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,030	269,757,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	2,556	207,036,000	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	996	86,950,800	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	793	114,509,200	
合計	44,875	7,244,713,500	

(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。

### 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	38,659,988	81,294,213
金銭信託	-	8,625,454
コール・ローン	33,027,006	28,387,452
投資証券	6,965,316,630	6,437,368,658
派生商品評価勘定	58,990	13,320
未収入金	31,840	87,703
未収配当金	15,437,456	12,994,270
流動資産合計	7,052,531,910	6,568,771,070
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	160	-
未払金	-	906,285
未払解約金	46,949,201	35,806,090
未払利息	35	52
流動負債合計	46,949,396	36,712,427
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,424,168,478	3,296,876,765
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,581,414,036	3,235,181,878
元本等合計	7,005,582,514	6,532,058,643
純資産合計	7,005,582,514	6,532,058,643
負債純資産合計	7,052,531,910	6,568,771,070

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p>
--------------------	---

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

## （貸借対照表に関する注記）

		平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
1.	期首	平成29年 6月16日	平成29年12月16日
	期首元本額	3,922,911,190円	3,424,168,478円
	期首からの追加設定元本額	40,947,639円	22,793,916円
	期首からの一部解約元本額	539,690,351円	150,085,629円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,764,756,389円	2,714,671,754円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	100,582,243円	68,639,243円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	558,829,846円	513,565,768円
	計	3,424,168,478円	3,296,876,765円
2.	受益権の総数	3,424,168,478口	3,296,876,765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29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月15日現在	平成30年 6月15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12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)



種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,588,848
合計	4,588,848

(平成30年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	224,502,043
合計	224,502,043

(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12月15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	25,968,130	-	25,909,300	58,830
	米ドル	16,914,000	-	16,855,500	58,500
	英ポンド	3,019,640	-	3,019,800	160
	豪ドル	6,034,490	-	6,034,000	490
合計		25,968,130	-	25,909,300	58,830

(平成30年 6月15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	30,705,080	-	30,715,900	10,820
	米ドル	29,862,000	-	29,872,800	10,800

	加ドル	843,080	-	843,100	20
	売建	31,977,500	-	31,975,000	2,500
	ユーロ	31,977,500	-	31,975,000	2,500
	合計	62,682,580	-	62,690,900	13,320

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成29年12月15日現在		平成30年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.0459円	1口当たり純資産額	1.9813円
(1万口当たり純資産額)	(20,459円)	(1万口当たり純資産額)	(19,813円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	4,443	121,027.32	
		AGREE REALTY CORPORATION	1,620	87,172.20	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	3,451	72,505.51	
		ALEXANDER'S INC	200	76,608.00	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,231	667,789.46	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,226	83,074.32	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	7,058	301,800.08	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,003	273,583.12	
AMERICOLD REALTY TRUST	2,416	52,354.72	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	8,168	338,073.52	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,693	200,386.82	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	2,411	35,297.04	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,613	32,752.30	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,111	1,195,927.98	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,064	9,661.12	
BOSTON PROPERTIES INC	7,954	953,525.52	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1,499	16,009.32	
BRANDYWINE REALTY TRUST	8,912	143,572.32	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,782	273,817.70	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,809	433,579.44	
CARETRUST REIT INC	4,110	68,554.80	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	9,318	50,410.38	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,650	11,766.00	
CHATHAM LODGING TRUST	2,340	47,689.20	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,183	101,378.55	
CITY OFFICE REIT INC	1,829	22,423.54	
CLIPPER REALTY INC	560	5,560.80	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	26,500	161,385.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	6,125	135,975.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	977	27,101.98	
CORECIVIC INC	6,000	127,140.00	
CORESITE REALTY CORP	1,744	187,985.76	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	5,254	143,907.06	
COUSINS PROPERTIES INC	21,440	207,968.00	
CUBESMART	9,494	297,731.84	
CYRUSONE INC	4,958	291,183.34	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4,792	314,594.80	
DDR CORP	8,100	139,725.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,072	123,583.44	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,582	1,128,358.66	
DOUGLAS EMMETT INC	8,307	321,730.11	
DUKE REALTY CORPORATION	18,480	527,604.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,319	45,823.44	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,805	170,410.05	
EDUCATION REALTY TRUST INC	3,892	156,886.52	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,809	115,140.19	

EPR PROPERTIES	3,390	215,705.70
EQUITY COMMONWEALTH	6,371	197,118.74
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	4,527	415,352.25
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	19,031	1,213,226.25
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,397	797,717.51
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,527	636,578.31
FARMLAND PARTNERS INC	1,521	13,673.79
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,770	456,509.30
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	6,122	203,617.72
FOREST CITY REALTY TRUST- A	13,830	279,504.30
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,212	73,843.88
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	5,875	45,825.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	10,352	364,804.48
GEO GROUP INC/THE	6,516	162,509.04
GETTY REALTY CORPORATION	1,764	46,781.28
GGP INC	32,598	675,756.54
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,465	27,498.05
GLADSTONE LAND CORP	565	7,203.75
GLOBAL MEDICAL REIT INC	697	6,286.94
GLOBAL NET LEASE INC	3,521	68,272.19
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	5,110	73,584.00
GRAMERCY PROPERTY TRUST	8,244	227,699.28
HCP INC	24,308	580,231.96
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,539	177,141.51
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	10,627	266,100.08
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,092	43,827.40
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,329	257,603.86
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8,473	240,972.12
HOST HOTELS & RESORTS INC	37,826	806,828.58
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	8,013	282,538.38
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,291	43,038.73
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	996	21,902.04
INFREIT INC	2,062	42,848.36
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,450	36,442.50
INVITATION HOMES INC	14,809	332,017.78
IRON MOUNTAIN INC	14,553	494,656.47
ISTAR INC	3,747	40,654.95
JBG SMITH PROPERTIES	4,788	180,699.12
KILROY REALTY CORPORATION	5,109	388,232.91
KIMCO REALTY CORPORATION	22,095	365,230.35
KITE REALTY GROUP TRUST	4,441	72,743.58
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,739	203,849.28
LEXINGTON REALTY TRUST	11,355	97,880.10

LIBERTY PROPERTY TRUST	7,629	337,812.12
LIFE STORAGE INC	2,390	222,915.30
LTC PROPERTIES INC	2,108	89,421.36
MACERICH CO/THE	5,629	315,899.48
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,802	94,551.38
MANULIFE US REAL ESTATE INV	51,913	45,683.44
MANULIFE US REAL ESTATE INV(N)	11,420	10,049.60
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,587	16,361.97
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	18,734	258,903.88
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,888	570,370.56
MONMOUTH RE INVST CORP	4,045	62,535.70
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,914	333,733.38
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,563	75,762.28
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,168	161,516.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	4,389	32,785.83
NEXPOINT RESIDENTIAL	899	24,389.87
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,906	41,410.50
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,179	318,297.33
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	949	24,446.24
PARAMOUNT GROUP INC	10,344	156,090.96
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	10,377	318,988.98
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,598	143,812.06
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,741	42,086.25
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,393	142,961.46
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6,615	127,801.80
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1,880	27,711.20
PROLOGIS INC	27,435	1,767,362.70
PS BUSINESS PARKS INC	1,051	130,061.25
PUBLIC STORAGE	7,715	1,654,558.90
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	2,579	103,753.17
QUALITY CARE PROPERTIES	4,896	107,907.84
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES TRUST	4,333	55,332.41
REALTY INCOME CORP	14,671	777,416.29
REGENCY CENTERS CORP	7,674	460,516.74
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	5,822	109,337.16
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	11,722	152,268.78
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	4,086	128,709.00
RLJ LODGING TRUST	8,917	199,829.97
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,608	218,237.44
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,313	199,111.94
SAUL CENTERS INC	651	32,667.18
SELECT INCOME REIT	3,411	73,268.28

		SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	12,225	213,693.00
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,358	58,434.74
		SIMON PROPERTY GROUP INC	16,051	2,633,166.55
		SL GREEN REALTY CORP	4,662	456,130.08
		SPIRIT MTA REIT	2,234	22,563.40
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,342	181,640.46
		STAG INDUSTRIAL INC	4,879	129,098.34
		STORE CAPITAL CORP	8,461	227,431.68
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	5,479	77,911.38
		SUN COMMUNITIES INC	4,107	396,407.64
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,482	190,141.92
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	5,010	111,773.10
		TAUBMAN CENTERS INC	3,136	175,051.52
		TERRENO REALTY CORP	2,767	104,288.23
		TIER REIT INC	2,570	58,955.80
		UDR INC	13,881	514,985.10
		UMH PROPERTIES INC	1,802	26,597.52
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	669	42,347.70
		URBAN EDGE PROPERTIES	5,340	118,441.20
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	1,610	35,178.50
		VENTAS INC	18,432	1,002,885.12
		VEREIT INC	50,541	365,916.84
		VORNADO REALTY TRUST	8,944	643,431.36
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,942	77,647.02
		WASHINGTON REIT	4,085	118,955.20
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	6,124	183,781.24
		WELLTOWER INC	19,066	1,098,964.24
		WHEELER REAL ESTATE INVESTME	103	393.46
		WHITESTONE REIT	2,039	24,692.29
		WP CAREY INC	5,551	371,750.47
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,583	136,560.18
米ドル小計			1,217,770	41,450,896.89 (4,587,785,267)
加ドル	投資証券	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	574	7,823.62
		ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	2,419	99,590.23
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,174	55,347.24
		BOARDWALK EQUITIES INC	1,206	55,982.52
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	3,405	144,814.65
		CHOICE PROPERTIES REIT	7,010	84,470.50
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,831	60,339.19
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,635	34,044.20
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,544	20,118.32

		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	4,266	61,217.10
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1,940	20,292.40
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,523	36,445.39
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,221	64,859.52
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7,568	152,268.16
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,761	19,230.12
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,155	32,303.45
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	682	10,557.36
		MORGUARD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,005	13,286.10
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1,386	36,202.32
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,652	29,941.08
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,157	194,789.16
		SLATE OFFICE REIT	1,116	8,414.64
		SLATE RETAIL REIT	912	11,764.80
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,524	106,530.52
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	1,697	14,577.23
加ドル小計			69,363	1,375,209.82 (115,971,444)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	952	75,398.40
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,175	93,490.25
		ALTAREA	193	38,561.40
		AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	541	9,197.00
		BEFIMMO S.C.A.	1,226	64,242.40
		BENI STABILI SPA	52,571	40,059.10
		COFINIMMO	1,000	107,800.00
		COVIVIO	2,810	251,776.00
		CROMWELL EUROPEAN REIT	23,500	14,100.00
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	2,627	94,677.08
		GECINA SA	2,500	359,000.00
		GREEN REIT PLC	35,316	54,033.48
		HAMBORNER REIT AG	4,232	39,230.64
		HIBERNIA REIT PLC	37,324	57,180.36
		HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	5,471	96,508.44
		ICADE	2,316	190,375.20
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,553	18,506.69
		INMOBILIARIA COLONIAL SA	16,820	157,267.00
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	928	19,812.80
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	19,113	25,611.42
		KLEPIERRE	10,642	355,229.96
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,947	45,462.93
		MERCIALYS	3,035	46,769.35
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	17,164	206,997.84

		NSI NV	960	34,896.00
		RETAIL ESTATES	439	34,022.50
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,962	1,333,223.00
		VASTNED RETAIL	844	34,435.20
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	803	85,439.20
		WERELDHAVE NV	2,139	70,950.63
ユーロ小計			267,103	4,054,254.27 (518,539,121)
英ポンド	投資証券	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	2,098	1,921.76
		ASSURA PLC	122,751	69,599.81
		BIG YELLOW GROUP PLC	7,737	76,132.08
		BRITISH LAND COMPANY PLC	51,470	356,172.40
		CAPITAL & REGIONAL PLC	25,207	13,737.81
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	8,816	9,080.48
		DERWENT LONDON PLC	5,677	173,943.28
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	30,277	26,038.22
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	14,700	103,326.30
		HAMMERSON PLC	40,985	219,433.69
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	21,879	23,585.56
		INTU PROPERTIES PLC	46,002	88,737.85
		LAND SECURITIES GROUP PLC	38,899	370,979.76
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	36,260	68,205.06
		LXI REIT PLC	8,380	9,301.80
		NEWRIVER REIT PLC	15,163	43,669.44
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	37,726	43,083.09
		REDEFINE INTERNATIONAL PLC	72,207	25,561.27
		REGIONAL REIT LTD	15,688	14,903.60
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	10,476	60,446.52
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	29,709	18,686.96
		SEGRO PLC	50,855	340,728.50
		SHAFTESBURY PLC	12,708	118,438.56
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	76,078	117,616.58
		UNITE GROUP PLC	13,572	117,669.24
		WORKSPACE GROUP PLC	6,177	69,614.79
英ポンド小計			801,497	2,580,614.41 (378,472,909)
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	17,961	68,431.41
		ARENA REIT	14,357	32,303.25
		BWP TRUST	27,285	88,949.10
		CHARTER HALL GROUP	23,668	151,001.84
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	9,625	41,676.25
		CHARTER HALL RETAIL REIT	18,757	79,342.11



		CROMWELL PROPERTY GROUP	83,019	91,320.90
		DEXUS	52,535	504,336.00
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	12,897	34,950.87
		GDI PROPERTY GROUP	29,145	37,305.60
		GOODMAN GROUP	83,321	790,716.29
		GPT GROUP	93,581	468,840.81
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	14,463	51,343.65
		INDUSTRIA REIT	3,970	10,123.50
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,640	31,311.60
		INVESTA OFFICE FUND	27,159	139,868.85
		MIRVAC GROUP	192,920	430,211.60
		NATIONAL STORAGE REIT	31,223	49,020.11
		RURAL FUNDS GROUP	15,139	32,094.68
		SCENTRE GROUP	276,227	1,162,915.67
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	40,085	99,009.95
		STOCKLAND	125,973	522,787.95
		VICINITY CENTRES	167,439	442,038.96
		VIVA ENERGY REIT	24,842	52,416.62
豪ドル小計			1,397,231	5,412,317.57 (446,678,569)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	65,032	92,020.28
		STRIDE STAPLED GROUP	27,914	50,803.48
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	24,690	50,120.70
ニュージーランドドル小計			117,636	192,944.46 (14,843,217)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	107,000	584,220.00
		FORTUNE REIT	73,000	686,930.00
		LINK REIT	111,800	7,982,520.00
		PROSPERITY REIT	69,000	224,250.00
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00
		SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	51,000	170,850.00
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	53,000	292,560.00
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	57,000	311,790.00
香港ドル小計			722,800	11,127,470.00 (156,897,327)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	33,325	46,321.75
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	42,040	32,581.00
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	123,413	323,342.06
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	69,242	75,473.78
		CACHE LOGISTICS TRUST	57,258	44,088.66
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	138,850	227,714.00
		CAPITALAND MALL TRUST	138,100	280,343.00

		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	30,440	46,877.60	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	40,400	65,044.00	
		ESR REIT	78,318	37,592.64	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	50,200	33,634.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	30,500	42,090.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	31,000	68,510.00	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	33,200	45,816.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	76,610	81,206.60	
		KEPPEL DC REIT	48,154	65,970.98	
		KEPPEL REIT	95,200	106,624.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	109,900	34,618.50	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	95,840	150,468.80	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	61,860	120,008.40	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	108,144	133,017.12	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	110,100	127,716.00	
		QUE HOSPITALITY TRUST	60,526	47,512.91	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	21,100	55,493.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	36,100	15,703.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	29,050	18,882.50	
		SPH REIT	35,200	35,200.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	72,700	48,345.50	
		SUNTEC REIT	114,700	194,990.00	
シンガポールドル小計			1,971,470	2,605,186.30	(214,146,313)
イスラエル エルシュケ ル	投資証券	REIT 1 LTD	9,000	131,760.00	
イスラエルシュケル小計			9,000	131,760.00	(4,034,491)
合計				6,437,368,658	(6,437,368,658)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 162銘柄	100.0%	71.3%
加ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	8.1%
英ポンド	投資証券 26銘柄	100.0%	5.9%
豪ドル	投資証券 24銘柄	100.0%	6.9%

ニュージーランドドル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券	8銘柄	100.0%	2.4%
シンガポールドル	投資証券	29銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	27,078,398
コール・ローン	73,337,759	89,118,403
国債証券	29,100,275,920	29,533,465,500
地方債証券	2,912,304,290	2,597,698,000
特殊債券	3,213,420,000	3,320,180,000
社債券	1,748,123,000	2,157,678,000
未収利息	125,951,261	127,071,544
前払費用	3,029,246	2,922,189
流動資産合計	37,176,441,476	37,855,212,034
資産合計	37,176,441,476	37,855,212,034
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	50,354,500	-
未払解約金	7,222,373	8,105,808
未払利息	77	165
流動負債合計	57,576,950	8,105,973
負債合計	57,576,950	8,105,973
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,719,435,422	27,104,380,312
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,399,429,104	10,742,725,749
元本等合計	37,118,864,526	37,847,106,061
純資産合計	37,118,864,526	37,847,106,061
負債純資産合計	37,176,441,476	37,855,212,034

### 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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
1.	期首	平成29年 6月16日	平成29年12月16日
	期首元本額	25,107,309,471円	26,719,435,422円
	期首からの追加設定元本額	2,487,461,131円	1,838,512,383円
	期首からの一部解約元本額	875,335,180円	1,453,567,493円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	1,341,272,015円	1,572,820,575円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,420,292,606円	1,613,686,036円
	DCインデックスバランス(株式60)	1,060,373,542円	1,182,214,655円
	DCインデックスバランス(株式80)	174,144,370円	193,306,104円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,731,595,207円	1,767,528,379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	4,080,514,182円	3,835,405,455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	4,989,137円	4,796,180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)	4,968,107円	4,784,918円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	25,165,641円	25,435,734円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	104,031,096円	107,879,750円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	318,312,106円	312,440,112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	5,143,797,989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)	27,666,287円	17,226,651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)	117,144,809円	48,119,819円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,218,414,707円	1,224,077,129円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,218,719,220円	1,230,397,452円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	671,415,903円	674,917,994円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	101,481,739円	102,063,711円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,272,849,464円	6,280,590,683円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	249,885,526円	248,265,818円
計	26,719,435,422円	27,104,380,312円
2. 受益権の総数	26,719,435,422口	27,104,380,312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29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（平成29年12月15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	92,039,860
地方債証券	1,619,710
特殊債券	182,000
社債券	753,000
合計	89,849,150

（平成30年 6月15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	124,185,170
地方債証券	13,004,000
特殊債券	9,844,000
社債券	9,277,000
合計	92,060,170

(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12月15日現在		平成30年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.3892円	1口当たり純資産額	1.3963円
(1万口当たり純資産額)	(13,892円)	(1万口当たり純資産額)	(13,963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	331,412,400	
	第 1 2 1 回利付国債 ( 5 年 )	100,000,000	100,302,000	
	第 1 2 2 回利付国債 ( 5 年 )	300,000,000	301,062,000	
	第 1 2 3 回利付国債 ( 5 年 )	505,000,000	507,040,200	
	第 1 2 4 回利付国債 ( 5 年 )	560,000,000	562,587,200	
	第 1 2 5 回利付国債 ( 5 年 )	325,000,000	326,690,000	
	第 1 2 6 回利付国債 ( 5 年 )	220,000,000	221,271,600	
	第 1 回利付国債 ( 4 0 年 )	70,000,000	101,553,900	
	第 2 回利付国債 ( 4 0 年 )	165,000,000	231,735,900	
	第 3 回利付国債 ( 4 0 年 )	50,000,000	70,584,000	
	第 4 回利付国債 ( 4 0 年 )	95,000,000	134,581,750	
	第 5 回利付国債 ( 4 0 年 )	35,000,000	47,682,950	
	第 6 回利付国債 ( 4 0 年 )	70,000,000	93,480,100	
	第 7 回利付国債 ( 4 0 年 )	50,000,000	63,841,500	
	第 8 回利付国債 ( 4 0 年 )	95,000,000	112,466,700	
	第 9 回利付国債 ( 4 0 年 )	160,000,000	137,456,000	
	第 1 0 回利付国債 ( 4 0 年 )	125,000,000	127,192,500	
	第 3 0 2 回利付国債 ( 1 0 年 )	94,000,000	95,461,700	

第303回利付国債(10年)	581,000,000	592,271,400	
第304回利付国債(10年)	36,000,000	36,653,040	
第305回利付国債(10年)	473,000,000	483,245,180	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	95,508,210	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	144,039,000	
第309回利付国債(10年)	134,000,000	137,327,220	
第310回利付国債(10年)	78,000,000	80,004,600	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,486,910	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	211,883,900	
第313回利付国債(10年)	370,000,000	384,618,700	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	67,598,050	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,293,250	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	109,188,450	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	191,774,700	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,213,900	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	197,457,500	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	182,355,250	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	77,869,500	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,837,800	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,920,250	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	218,219,400	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,107,600	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,694,250	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,900,800	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	240,471,900	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	219,987,600	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,959,200	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	218,316,000	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,923,600	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	507,713,500	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,980,000	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,725,400	
第338回利付国債(10年)	310,000,000	319,777,400	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	381,836,300	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	433,923,000	
第341回利付国債(10年)	910,000,000	933,996,700	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,466,400	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	247,653,350	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,517,000	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	615,971,900	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	494,503,100	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	161,368,000	



第348回利付国債(10年)	90,000,000	90,748,800	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	493,719,100	
第350回利付国債(10年)	340,000,000	342,312,000	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	274,738,880	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	196,840,350	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	46,972,450	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	144,746,800	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,433,400	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	54,374,400	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	74,902,300	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	92,770,360	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,593,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	229,311,300	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,782,200	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	129,309,220	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	375,917,520	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	198,053,100	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	159,812,400	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	67,857,000	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	175,381,200	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	268,910,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	219,132,480	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	176,494,950	
第37回利付国債(30年)	61,000,000	78,624,120	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	120,609,150	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	97,043,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	114,441,300	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	49,954,400	
第42回利付国債(30年)	105,000,000	131,202,750	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	243,800,700	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	87,565,800	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	72,184,200	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	120,331,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	141,397,100	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	123,951,450	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	106,245,900	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	25,730,250	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	63,074,200	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	85,551,300	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	102,382,350	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	112,902,900	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	112,787,400	

第56回利付国債(30年)	50,000,000	51,214,000	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	102,320,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	102,210,000	
第43回利付国債(20年)	47,000,000	48,799,630	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	53,361,810	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	22,109,010	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	105,554,790	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	60,527,730	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	250,354,950	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	41,508,480	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,222,650	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	71,265,480	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	56,216,160	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	146,605,950	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,705,340	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	315,175,050	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,432,080	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,971,350	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	59,692,140	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	111,013,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,556,060	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,890,960	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	88,278,840	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	119,563,600	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	127,314,880	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	128,288,900	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	134,737,120	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,468,500	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,798,880	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,602,800	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	183,121,600	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	69,396,000	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	152,707,100	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	356,235,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,945,760	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	298,095,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,808,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	70,534,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,217,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	98,939,560	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	116,479,860	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	54,114,750	

第98回利付国債(20年)	94,000,000	112,170,200	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	140,091,120	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,330,900	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	81,211,680	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	100,049,580	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,477,420	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,774,570	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	93,108,400	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,438,820	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	157,688,700	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	159,742,740	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,256,090	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	119,168,980	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,765,000	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	97,576,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	354,762,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	63,830,520	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,138,950	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	68,338,050	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	114,473,700	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,224,900	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,964,600	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,260,500	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,698,100	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,425,330	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	80,659,150	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	98,289,600	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	62,866,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	30,787,500	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,409,200	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,447,000	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	72,679,800	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,380,320	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,015,050	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,408,300	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,789,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,071,400	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	214,016,400	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	240,706,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	141,156,000	
第139回利付国債(20年)	150,000,000	178,488,000	
第140回利付国債(20年)	340,000,000	409,842,800	

	第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,405,950	
	第142回利付国債(20年)	85,000,000	103,879,350	
	第143回利付国債(20年)	54,000,000	64,464,120	
	第144回利付国債(20年)	130,000,000	153,338,900	
	第145回利付国債(20年)	205,000,000	248,168,900	
	第146回利付国債(20年)	75,000,000	90,849,000	
	第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,877,000	
	第148回利付国債(20年)	120,000,000	141,980,400	
	第149回利付国債(20年)	215,000,000	254,596,550	
	第150回利付国債(20年)	90,000,000	105,183,000	
	第151回利付国債(20年)	150,000,000	170,562,000	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	102,348,900	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	138,408,000	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	136,377,600	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	154,373,800	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	109,908,700	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	48,118,000	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	172,159,000	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	154,239,000	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	146,178,200	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	122,935,200	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	71,543,500	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	168,380,850	
	第164回利付国債(20年)	125,000,000	125,000,000	
国債証券 合計		26,584,000,000	29,533,465,500	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,641,000	
	第690回東京都公募公債	100,000,000	103,159,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	207,276,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	103,447,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	103,006,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	206,304,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	103,555,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,388,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	207,054,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,370,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,935,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,735,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,079,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,365,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,394,000	
	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,083,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,448,000	

	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,383,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	104,503,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,957,000	
	平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	103,907,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,709,000	
地方債証券 合計		2,500,000,000	2,597,698,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,499,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,539,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,068,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,858,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,486,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,626,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,845,000	
	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	103,111,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,156,000	
	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	104,654,000	
	第17回道路債券	100,000,000	106,714,000	
	第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,127,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,353,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,159,000	
	第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,097,000	
	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	103,585,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	118,582,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,960,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,919,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,434,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,671,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,462,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,509,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,085,000	
	第298回信金中金債(5年)	200,000,000	200,398,000	
	第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,000,000	
	第318回信金中金債(5年)	100,000,000	99,926,000	
	第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,751,000	
	第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,606,000	
特殊債券 合計		3,200,000,000	3,320,180,000	
社債券	第8回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,513,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,336,000	
	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	103,306,000	

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	99,636,000	
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）	100,000,000	101,169,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,905,000	
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	102,471,000	
第8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	100,257,000	
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	103,217,000	
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	201,350,000	
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	106,975,000	
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	110,031,000	
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	104,576,000	
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	206,782,000	
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	204,912,000	
第563回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,282,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,348,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,612,000	
社債券 合計	2,100,000,000	2,157,678,000	
合計	34,384,000,000	37,609,021,500	

## 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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	55,905,406	123,583,975
金銭信託	-	54,748,563
コール・ローン	25,246,672	180,184,388

	平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
国債証券	156,305,768,792	147,820,431,138
派生商品評価勘定	1,801,532	306,958
未収入金	429,754,097	61,238,786
未収利息	1,249,059,191	1,169,396,277
前払費用	26,020,280	34,579,994
流動資産合計	158,093,555,970	149,444,470,079
資産合計	158,093,555,970	149,444,470,079
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,160	-
未払解約金	344,929,613	239,687,758
未払利息	26	334
流動負債合計	344,941,799	239,688,092
負債合計	344,941,799	239,688,092
純資産の部		
元本等		
元本	68,347,760,820	67,242,519,709
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	89,400,853,351	81,962,262,278
元本等合計	157,748,614,171	149,204,781,987
純資産合計	157,748,614,171	149,204,781,987
負債純資産合計	158,093,555,970	149,444,470,079

## 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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
1.	期首	平成29年 6月16日	平成29年12月16日
	期首元本額	71,002,753,726円	68,347,760,820円
	期首からの追加設定元本額	1,335,512,999円	1,862,224,270円
	期首からの一部解約元本額	3,990,505,905円	2,967,465,381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)	11,585,547,628円	11,850,197,899円
	DCインデックスバランス(株式20)	123,439,406円	151,707,746円
	DCインデックスバランス(株式40)	189,564,054円	225,303,716円
	DCインデックスバランス(株式60)	254,075,696円	297,243,750円
	DCインデックスバランス(株式80)	208,305,204円	242,735,068円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,857,577,541円	23,546,695,950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	2,439,792,056円	2,384,654,413円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	21,672,670,901円	20,300,174,684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	26,981,437円	27,385,927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)	936,911,723円	904,814,591円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	305,613,731円	425,130,451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	158,821,660円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,991,195円	3,004,405円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,020,637円	3,209,195円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,937,062円	7,519,093円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	14,669,118円	15,108,887円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	672,382,781円	879,853,294円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,117,035,739円	1,071,714,429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)	23,410,884円	15,354,552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)	80,920,497円	35,011,045円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	56,155,388円	59,436,474円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	82,033,195円	86,576,653円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	81,214,831円	85,626,254円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	61,240,488円	64,417,819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	4,188,777,212円	4,158,162,298円
	海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	243,707,069円	242,659,456円
	計	68,347,760,820円	67,242,519,709円
2.	受益権の総数	68,347,760,820口	67,242,519,709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29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15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12月15日現在	平成30年 6月15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12月15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	1,347,375,962
合計	1,347,375,962

（平成30年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,509,635,829
合計	2,509,635,829

(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12月15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	380,876,132	-	379,086,760	1,789,372
	米ドル	146,225,206	-	145,509,450	715,756
	加ドル	8,803,250	-	8,790,000	13,250
	ユーロ	183,041,736	-	182,065,540	976,196
	英ポンド	33,728,428	-	33,670,770	57,658
	豪ドル	9,077,512	-	9,051,000	26,512
	合計	380,876,132	-	379,086,760	1,789,372

（平成30年 6月15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	40,208,958	-	39,902,000	306,958
	ユーロ	18,212,208	-	17,906,000	306,208
	英ポンド	21,996,750	-	21,996,000	750
	合計	40,208,958	-	39,902,000	306,958

## （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12月15日現在		平成30年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.3080円	1口当たり純資産額	2.2189円
(1万口当たり純資産額)	(23,080円)	(1万口当たり純資産額)	(22,189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%-19/05/31	4,100,000.00	4,067,806.80	
		US TREASURY N/B-0.875%-19/06/15	3,000,000.00	2,956,581.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	2,510,000.00	2,490,635.35	
		US TREASURY N/B-0.75%-19/07/15	2,650,000.00	2,603,521.65	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	2,973,867.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-19/07/31	800,000.00	790,859.20	
		US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,378,557.60	
		US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	4,110,000.00	4,377,713.07	
		US TREASURY N/B-0.75%-19/08/15	9,000,000.00	8,827,380.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,243,603.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,564,842.40	
		US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,450,000.00	7,381,758.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-19/10/15	5,100,000.00	5,001,386.40	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,045,146.10	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,530,000.00	10,657,718.37	
		US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	4,928,420.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,874,431.70	
		US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,919,296.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/01/31	3,000,000.00	2,975,040.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	8,070,000.00	8,211,539.73	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/02/29	3,000,000.00	2,941,407.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,077,398.30	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	2,430,000.00	2,377,460.97	
		US TREASURY N/B-2.375%-20/04/30	3,000,000.00	2,989,569.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	7,964,120.07	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,384,099.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	4,995,409.20	
		US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	710,000.00	700,043.67	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,924,064.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,303,712.72	
		US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,919,688.00	

US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	5,610,000.00	6,331,193.55	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,180,000.00	5,181,414.14	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,434,876.50	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,239,176.50	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,598,031.70	
US TREASURY N/B-1.625%-20/10/15	2,000,000.00	1,954,922.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,959,414.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,252,735.77	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,498,768.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,371,097.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	1,969,454.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,093,028.16	
US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,355,374.40	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	2,979,786.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,955,938.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,868,976.80	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,367,235.20	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,935,000.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,730,000.00	4,846,585.04	
US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,473,387.50	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,328,709.86	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,919,610.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	336,088.64	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,221,407.26	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,129,873.44	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,927,774.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,372,734.24	
US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	880,000.00	878,315.68	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	1,982,628.46	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	5,948,614.10	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,721,224.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,226,711.60	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,763,280.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,829,998.90	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,184,470.40	

US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,354,061.60	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,424,181.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,738,960.90	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,904,610.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,829,724.25	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,903,908.00	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	580,312.80	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,520,000.00	4,425,007.68	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	765,375.20	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,434,180.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,900,000.00	2,796,800.60	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,734,188.40	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,887,149.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,674,645.60	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,923,946.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,304,841.76	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,437,597.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,809,490.48	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,355,572.40	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,908,398.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,830,754.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,399,955.70	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	1,925,976.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,886,327.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	1,000,000.00	967,207.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	951,406.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,296,644.78	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,787,114.50	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,908,594.00	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,550,251.76	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,800,000.00	5,596,205.40	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	2,921,266.40	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	565,524.36	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,882,890.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,100,380.22	

US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	624,266.94	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,589,452.00	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	7,751,733.95	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,417,236.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,727,968.00	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	2,000,000.00	1,849,376.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,215,014.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,719,127.30	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,319,825.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,596,572.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,981,328.00	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	3,230,000.00	3,111,904.74	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,422,265.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,936,368.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,280,856.70	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,441,669.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	2,881,056.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,905,820.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,681,395.80	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	4,330,000.00	4,122,463.10	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,100,000.00	1,046,353.00	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,044,601.96	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,486,454.28	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,339,321.28	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,294,390.40	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,049,295.04	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,705,887.51	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,100,000.00	1,050,242.60	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,826,819.60	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,464,463.50	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,698,687.70	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,041,210.74	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,324,289.20	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,196,090.60	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,564,310.40	

US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	4,911,388.38	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,672,818.80	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,181,585.60	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,250,000.00	4,779,857.25	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,086,496.20	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,582,816.00	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,102,981.35	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,686,610.32	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,545,470.40	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	2,730,000.00	2,608,536.84	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	4,805,077.07	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,960,000.00	4,993,314.48	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	5,751,873.00	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,933,672.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,205,293.00	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,209,297.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,408,661.56	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,830,304.18	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,800,000.00	2,323,863.00	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,409,210.01	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,600,000.00	1,959,688.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,204,317.55	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,241,337.28	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,122,797.25	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,106,595.68	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,932,284.07	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,990,000.00	2,259,853.95	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,405,640.36	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,920,088.50	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	1,870,000.00	2,281,289.67	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,189,190.64	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	758,593.60	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,895,078.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,023,476.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,613,651.80	



		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	5,625,400.32	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,045,625.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,300,117.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,590,852.20	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	4,097,146.05	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,263,775.90	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,961,878.70	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,164,124.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,115,326.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	3,855,060.30	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,505,672.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,235,060.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,819,858.90	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	1,927,500.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	2,766,094.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,646,186.44	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,877,460.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,870,000.00	1,754,987.52	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	1,450,000.00	1,431,337.05	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	900,000.00	910,458.90	
米ドル小計			595,660,000.00	592,593,407.74 (65,588,238,368)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	381,662.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,670,000.00	1,701,796.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/08/01	1,090,000.00	1,077,748.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,390,000.00	1,389,082.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-19/11/01	950,000.00	942,381.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-20/02/01	780,000.00	771,895.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,170,000.00	2,155,222.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/05/01	590,000.00	588,053.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,184,120.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	1,967,439.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,300,000.00	2,224,146.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	982,813.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,210,000.00	1,161,212.80	

		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,123,324.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,004,343.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,310,000.00	1,251,783.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,120,107.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,338,130.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	160,000.00	158,673.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,138,860.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,031,359.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,040,369.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	541,017.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,160,000.00	1,041,378.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	787,000.00	767,757.85	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	890,000.00	1,186,752.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,453,946.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,090,000.00	1,535,744.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,345,000.00	1,743,711.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,340,000.00	1,661,399.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,158,495.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	200,000.00	186,344.00	
			35,267,000.00	37,011,074.30	
				(3,121,143,895)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	18,000,000.00	17,275,941.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	27,400,000.00	27,487,192.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	23,757,368.96	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	1,900,000.00	1,858,167.03	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	20,294,103.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	8,197,705.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	23,711,054.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	9,296,076.67	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	9,200,000.00	8,925,772.84	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,750,000.00	12,203,270.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	11,680,611.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,800,000.00	5,673,462.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	7,800,000.00	9,299,823.39	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	9,400,000.00	9,867,811.21	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	15,500,000.00	15,072,081.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	4,900,000.00	4,886,196.94	
メキシコペソ小計			210,000,000.00	209,486,641.32	(1,112,374,065)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,003,797.12	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,518,000.00	1,667,644.44	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,482,979.95	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,257,853.75	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,320,000.00	1,575,741.42	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,206,698.04	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	494,371.57	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,340,000.00	1,535,686.90	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	500,000.00	508,265.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,295,000.00	1,336,199.13	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	920,000.00	1,208,520.28	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,257,211.78	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	940,000.00	952,075.24	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,504,363.05	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	460,000.00	460,754.86	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	746,104.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	911,396.64	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	320,000.00	322,876.16	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	741,651.88	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,585,000.00	2,485,457.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	320,000.00	323,277.44	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	571,571.08	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,430,000.00	2,189,420.09	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,190,799.76	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	650,000.00	634,952.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	285,623.52	

BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	321,000.00	339,059.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	1,740,000.00	1,837,412.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	1,850,000.00	1,968,801.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 20/01/31	1,480,000.00	1,520,929.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	2,000,000.00	2,158,400.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,213,852.19	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	2,001,565.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	280,000.00	281,050.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,080,000.00	2,414,121.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,769,841.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,960,000.00	2,371,737.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,648,520.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,300,000.00	1,314,034.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	2,069,676.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	110,000.00	109,653.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,115,668.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,510,000.00	1,866,177.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,990,089.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,960,000.00	2,214,625.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,660,000.00	1,751,899.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,337,867.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-	1,690,000.00	1,837,119.57	

25/10/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,660,000.00	1,775,113.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,228,732.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,675,000.00	1,702,105.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,495,000.00	1,531,324.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,785,000.00	1,811,766.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,590,000.00	1,596,331.38	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	1,976,890.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,911,018.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,630,000.00	1,690,883.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,560,245.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,120,000.00	1,185,880.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,090,553.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,091,265.09	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,540,000.00	2,220,005.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,080,000.00	1,665,620.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,260,000.00	1,377,122.41	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	585,000.00	609,608.89	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	560,000.00	660,469.43	
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,020,088.80	
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,218,375.60	
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	751,626.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	3,936,634.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,419,015.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	2,924,010.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	1,520,000.00	1,617,751.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	1,943,118.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,930,354.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,719,893.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,173,970.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,683,578.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,724,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,057,124.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,865,835.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,058,502.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,069,982.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,060,000.00	2,275,300.07	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,129,222.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,944,461.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	2,670,000.00	2,750,268.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,840,000.00	3,021,282.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,828,411.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,530,000.00	2,479,983.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,570,000.00	2,558,083.75	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,755,313.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,080,000.00	2,105,658.88
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,718,358.63
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,380,000.00	1,389,323.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	860,000.00	1,227,308.83
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,365,106.81
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,420,000.00	2,263,931.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,630,000.00	2,603,859.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,775,000.00	2,722,476.89
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,060,000.00	1,728,136.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,280,000.00	2,243,827.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	1,800,885.92
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,234,377.73
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,500,000.00	2,003,553.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	400,000.00	409,538.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	738,844.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	2,550,000.00	2,664,089.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 19/10/15	470,000.00	467,014.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,106,729.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,694,487.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,829,117.84

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	749,078.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	396,604.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,721,955.93
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.2%- 20/10/15	380,000.00	373,733.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 20/11/01	940,000.00	934,067.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,142,472.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,288,523.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	540,000.00	530,471.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,910,000.00	3,135,266.01
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,990,000.00	3,320,290.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	748,638.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,090,463.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,180,000.00	2,454,682.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,376,786.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	964,981.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,236,052.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,193,320.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,301,148.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,315,252.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	730,000.00	703,733.14
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,100,000.00	1,059,799.40



BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,535,062.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,937,513.29
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	356,573.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,490,000.00	3,378,810.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,863,029.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	895,000.00	882,362.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,632,087.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	810,000.00	774,065.97
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,426,950.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,160,000.00	3,688,769.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	480,000.00	453,318.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,210,000.00	1,146,577.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,006,098.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,632,443.67
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,153,936.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,660,000.00	2,241,775.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,334,026.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	829,752.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	950,000.00	900,575.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,160,000.00	4,133,845.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	300,000.00	281,583.00

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,270,000.00	1,477,604.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,496,038.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,240,000.00	1,299,467.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,890,000.00	3,775,215.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,272,616.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,263,861.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	490,000.00	451,976.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,557,401.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	792,952.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,001,057.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	645,435.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,280,076.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,242,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	1,581,684.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,203,474.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,117,822.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	950,000.00	938,505.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	577,520.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	350,000.00	368,469.85	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	793,830.56	
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	306,145.05	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	778,634.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	323,654.10	

FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	592,754.25	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	250,217.47	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	578,198.92	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	743,674.76	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	332,947.29	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	413,022.93	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	303,000.00	300,446.83	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	458,007.92	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	334,901.02	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	230,000.00	232,664.32	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	380,000.00	494,661.20	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,179,604.12	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	3,230,000.00	3,418,751.51	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,675,603.87	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,009,287.90	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,418,463.43	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,616,458.08	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,726,631.08	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,494,563.05	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,369,396.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,398,695.89	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,251,539.46	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,044,396.57	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	180,730.98	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,363,183.68	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,446,627.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,833,507.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,540,718.95	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,355,000.00	3,692,060.07	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,580,000.00	3,638,584.19	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,231,358.62	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,645,000.00	2,774,110.38	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,180,000.00	3,958,476.72	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,840,000.00	2,858,460.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,580,000.00	2,527,640.19	

FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,780,000.00	2,881,944.26	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,330,000.00	3,983,004.67	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	1,770,000.00	1,777,020.70	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,615,000.00	3,911,582.37	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,600,000.00	3,077,744.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,670,000.00	2,841,440.70	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,720,000.00	4,452,721.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	180,000.00	182,735.82	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,390,000.00	3,716,846.74	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	1,530,000.00	1,524,807.18	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,292,426.50	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	765,000.00	816,128.01	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,179,029.57	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,030,000.00	2,784,985.42	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,440,000.00	1,553,872.32	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,220,000.00	1,965,751.84	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	930,000.00	1,534,407.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	799,953.00	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	600,000.00	629,191.74	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	505,000.00	548,192.90	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	870,000.00	950,731.65	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	640,000.00	722,702.59	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	497,439.36	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,076.05	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	675,761.79	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	792,288.40	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,281,929.16	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,052,299.85	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	420,000.00	418,756.29	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	899,845.55	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	125,000.00	123,021.12	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	545,000.00	556,500.59	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	665,000.00	696,841.53	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,180,000.00	1,239,737.26	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,240,000.00	1,257,959.54	

NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,330,000.00	1,445,289.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,540,000.00	1,719,088.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	709,074.66	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,359,590.09	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	591,604.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	970,000.00	1,315,594.89	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,040,637.79	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	179,883.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,765,886.51	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,277,525.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,125,000.00	1,138,629.93	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	960,000.00	983,425.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,758,915.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	500,000.00	508,112.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,336,650.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,195,000.00	1,818,419.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,255,000.00	1,963,576.38	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,105,000.00	1,535,441.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	181,651.32	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	300,000.00	324,549.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	543,272.26	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	616,540.42	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,218,000.00	1,331,082.77	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,421,126.28	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	800,429.41	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,090,761.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	450,681.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,170,000.00	1,280,648.07	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	815,000.00	891,482.86	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	955,469.52	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	760,000.00	1,023,680.48	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	979,283.13	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	625,000.00	620,687.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,206,293.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	460,000.00	462,375.44	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	677,846.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	994,000.00	1,485,014.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	870,254.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	375,000.00	374,727.76	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	273,000.00	458,678.22	
	ユーロ小計		401,587,000.00	462,546,826.81 (59,159,739,148)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	285,000.00	293,446.60	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	2,093,000.00	2,118,737.20	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,490,000.00	1,547,153.42	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,610,000.00	1,724,118.08	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,919,947.70	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,610,000.00	1,719,129.02	
		UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,069,173.51	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,237,772.04	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,214,431.02	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,228,348.00	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,202,730.55	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,708,994.07	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,165,000.00	1,278,846.13	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,630,982.47	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,516,736.56	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,095,000.00	1,083,338.25	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,498,763.46	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	300,000.00	304,315.26	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,446,145.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,300,000.00	1,773,674.50	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,676,899.98	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,800,900.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,319,195.80	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	100,000.00	99,853.42	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,143,538.40	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,789,156.32	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,510,000.00	2,208,979.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,735,000.00	2,675,196.50	

		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,455,000.00	1,892,009.25	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,372,994.60	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,424,568.53	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,295,000.00	1,219,600.08	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,158,671.66	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,350,002.27	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,735,364.88	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	665,000.00	690,203.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,110,185.20	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,774,125.60	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,565,000.00	1,538,676.70	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,200,000.00	1,182,061.42	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,248,204.00	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,498,612.34	
英ボンド小計			56,860,000.00	71,425,782.29	(10,475,305,230)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	425,500.80	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	237,471.71	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	551,000.00	668,170.15	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	385,000.00	536,613.00	
スイスフラン小計			1,556,000.00	1,867,755.66	(207,171,457)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,710,000.00	8,778,158.82	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,300,000.00	9,548,818.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,040,000.00	7,626,018.04	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,508,107.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,345,518.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,608,926.45	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,840,000.00	5,430,835.20	
スウェーデンクローナ小計			40,280,000.00	45,846,382.11	(579,498,269)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,870,000.00	7,394,730.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,042,341.08	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,970,000.00	4,299,621.16	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,302,503.80	

		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,211,357.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	3,070,000.00	3,069,631.60	
ノルウェークローネ小計			25,330,000.00	26,320,185.74	(357,954,526)
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	7,163,184.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,930,000.00	7,741,620.81	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,202,939.20	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,190,000.00	9,129,966.30	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,810,000.00	2,824,409.68	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,270,000.00	17,393,539.02	
デンマーククローネ小計			41,560,000.00	51,455,659.01	(883,493,665)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	1,810,000.00	1,847,648.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,450,000.00	1,530,040.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,567,173.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	220,000.00	212,652.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,721,811.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,160,000.00	2,168,100.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,414,569.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,410,000.00	1,581,103.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,282,166.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,358,351.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	1,150,000.00	1,154,657.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,431,397.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,627,472.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,776,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,454,802.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	510,000.00	490,620.00	
POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,058,156.55			
ポーランドズロチ小計			30,845,000.00	31,677,469.05	(945,255,676)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,455,000.00	1,469,365.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,240,000.00	2,338,482.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,102,799.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,510,000.00	2,764,944.21	



		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,345,799.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,328,230.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	670,000.00	668,111.61	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,020,000.00	2,309,364.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,990,000.00	2,019,395.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,330,000.00	2,429,142.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,660,000.00	2,962,369.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,707,660.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,247,118.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,020,000.00	1,937,309.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,800,000.00	1,802,981.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,620,000.00	1,698,166.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	700,000.00	698,866.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,363,643.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	630,000.00	607,309.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,021,131.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	674,626.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	946,742.69	
	豪ドル小計		36,467,000.00	38,443,563.18 (3,172,747,269)	
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	770,000.00	775,305.83	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	450,000.00	448,917.61	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	220,217.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	520,000.00	534,252.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	613,172.24	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	240,000.00	233,640.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	207,018.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	380,000.00	395,276.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	200,000.00	196,215.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	455,000.00	465,119.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	559,008.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	199,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	195,100.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	581,148.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	170,000.00	170,659.12	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	204,900.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	335,775.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	377,854.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	145,000.00	131,930.42	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	362,625.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	410,000.00	394,922.25	
シンガポールドル小計			7,520,000.00	7,602,257.42	(624,905,559)
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	1,012,628.42	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	464,311.71	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	849,304.13	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	100,000.00	100,285.69	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	580,000.00	577,485.49	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	793,575.17	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	100,000.00	99,658.19	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	120,000.00	118,780.92	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	961,796.43	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	436,286.96	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	450,000.00	435,712.93	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	560,889.87	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,129,139.23	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	593,743.19	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	1,040,000.00	1,006,547.08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	970,000.00	994,403.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,470,000.00	2,500,732.97	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	549,695.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	804,951.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,158,441.46	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	637,954.59	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,714,036.99	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	943,275.33	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,275,354.70	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	434,774.36			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	607,149.98			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	413,238.40			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	797,136.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,197,176.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	988,647.03	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	422,909.68	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	884,110.03	
マレーシアリングット小計			26,755,000.00	26,464,134.21 (735,173,648)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	3,750,000.00	3,730,987.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,515,033.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,900,000.00	5,770,259.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,018,898.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	7,000,000.00	6,330,415.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	7,884,240.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,920,000.00	6,238,899.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	6,610,000.00	6,180,911.85	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	5,921,137.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,800,000.00	7,884,976.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	6,310,000.00	5,855,301.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,224,685.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	9,450,000.00	8,493,423.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	14,800,000.00	13,261,096.00	
南アフリカランド小計			115,140,000.00	104,310,263.25 (857,430,363)	
合計				147,820,431,138 (147,820,431,138)	

(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 191銘柄	100.0%	44.5%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 287銘柄	100.0%	40.0%
英ポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.1%
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 6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 17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%

## 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。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

平成29年12月15日現在

平成30年 6月15日現在

資産の部  
流動資産

	平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
金銭信託	-	16,396,555
コール・ローン	52,568,230	53,963,120
株式	28,777,179,220	29,378,927,370
派生商品評価勘定	253,380	2,442,440
未収入金	89,649,690	22,499,430
未収配当金	3,301,840	195,574,905
流動資産合計	28,922,952,360	29,669,803,820
資産合計	28,922,952,360	29,669,803,820
負債の部		
流動負債		
前受金	645,000	1,680,000
未払金	1,539,000	-
未払解約金	90,107,283	34,072,259
未払利息	55	100
流動負債合計	92,291,338	35,752,359
負債合計	92,291,338	35,752,359
純資産の部		
元本等		
元本	18,171,588,693	18,506,621,192
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	10,659,072,329	11,127,430,269
元本等合計	28,830,661,022	29,634,051,461
純資産合計	28,830,661,022	29,634,051,461
負債純資産合計	28,922,952,360	29,669,803,820

## 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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
1. 期首	平成29年 6月16日	平成29年12月16日

期首元本額	19,150,879,367円	18,171,588,693円
期首からの追加設定元本額	1,264,297,199円	1,372,822,111円
期首からの一部解約元本額	2,243,587,873円	1,037,789,612円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	269,141,643円	314,957,191円
DCインデックスバランス(株式40)	835,808,259円	942,286,592円
DCインデックスバランス(株式60)	1,660,078,163円	1,854,984,657円
DCインデックスバランス(株式80)	1,812,493,625円	2,015,355,038円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,242,852,260円	1,457,067,242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	3,542,697,124円	3,353,898,807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	4,422,624円	4,251,912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	694,075,198円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	52,238,655円	50,175,949円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	40,167,802円	39,979,352円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	61,020,727円	62,481,414円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	64,017,243円	62,830,888円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,950,663,071円	4,506,212,587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)	9,684,494円	6,150,542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)	29,290,095円	12,263,467円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	245,473,863円	248,487,751円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	720,121,778円	724,963,495円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,063,309,742円	1,077,848,694円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,072,798,763円	1,078,350,416円
計	18,171,588,693円	18,506,621,192円
2. 受益権の総数	18,171,588,693口	18,506,621,192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	476,910,000円	456,990,000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29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年12月15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	625,160,085
合計	625,160,085

（平成30年 6月15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	582,523,489
合計	582,523,489

(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12月15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	53,460,000	-	53,715,000	255,000
合計		53,460,000	-	53,715,000	255,000

（平成30年 6月15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	247,730,000	-	250,180,000	2,450,000
合計		247,730,000	-	250,180,000	2,450,000



## (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12月15日現在		平成30年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.5866円	1口当たり純資産額	1.6013円
(1万口当たり純資産額)	(15,866円)	(1万口当たり純資産額)	(16,013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	3,760.00	1,880,000	
日本水産	14,500	545.00	7,902,500	
マルハニチロ	2,400	4,355.00	10,452,000	
カネコ種苗	500	1,590.00	795,000	
サカタのタネ	1,900	4,220.00	8,018,000	
ホクト	1,300	1,994.00	2,592,200	
ホクリヨウ	200	894.00	178,800	
住石ホールディングス	3,600	154.00	554,400	
日鉄鉱業	400	5,540.00	2,216,000	
三井松島産業	700	1,603.00	1,122,100	
国際石油開発帝石	62,600	1,174.50	73,523,700	
石油資源開発	2,000	2,804.00	5,608,000	
K & O エナジーグループ	800	1,871.00	1,496,800	
ヒノキヤグループ	300	2,872.00	861,600	
ショーボンドホールディングス	1,200	7,640.00	9,168,000	
ミライト・ホールディングス	4,000	1,785.00	7,140,000	
サンヨーホームズ	300	1,148.00	344,400	

日本アクア	400	392.00	156,800
ファーストコーポレーション	500	1,148.00	574,000
ベステラ	300	1,486.00	445,800
TATERU	1,200	2,158.00	2,589,600
ダイセキ環境ソリューション	300	1,150.00	345,000
第一カッター興業	200	3,110.00	622,000
安藤・間	10,100	975.00	9,847,500
東急建設	5,000	1,083.00	5,415,000
コムシスホールディングス	4,500	2,953.00	13,288,500
ミサワホーム	1,100	979.00	1,076,900
高松コンストラクショングループ	800	3,290.00	2,632,000
東建コーポレーション	500	9,820.00	4,910,000
ソネック	200	853.00	170,600
ヤマウラ	600	904.00	542,400
大成建設	12,800	6,170.00	78,976,000
大林組	38,600	1,142.00	44,081,200
清水建設	39,400	1,109.00	43,694,600
飛鳥建設	12,200	194.00	2,366,800
長谷工コーポレーション	15,000	1,609.00	24,135,000
松井建設	1,400	952.00	1,332,800
銭高組	200	6,000.00	1,200,000
鹿島建設	56,000	899.00	50,344,000
不動テトラ	10,200	199.00	2,029,800
大末建設	400	1,387.00	554,800
鉄建建設	800	2,981.00	2,384,800
西松建設	3,000	3,170.00	9,510,000
三井住友建設	9,400	766.00	7,200,400
大豊建設	5,000	646.00	3,230,000
前田建設工業	9,200	1,286.00	11,831,200
ナカノフドー建設	1,000	673.00	673,000
奥村組	2,100	3,785.00	7,948,500
東鉄工業	1,500	3,395.00	5,092,500
イチケン	200	2,670.00	534,000
浅沼組	5,000	390.00	1,950,000
戸田建設	15,000	988.00	14,820,000
熊谷組	2,100	3,850.00	8,085,000
青木あすなろ建設	900	1,006.00	905,400
北野建設	3,000	377.00	1,131,000
植木組	200	2,670.00	534,000
三井ホーム	2,000	713.00	1,426,000
矢作建設工業	1,800	900.00	1,620,000
ピーエス三菱	1,600	589.00	942,400

日本ハウスホールディングス	2,500	551.00	1,377,500
大東建託	4,600	18,190.00	83,674,000
新日本建設	1,500	1,330.00	1,995,000
N I P P O	3,000	2,078.00	6,234,000
東亜道路工業	300	3,850.00	1,155,000
前田道路	4,000	2,208.00	8,832,000
日本道路	300	6,000.00	1,800,000
東亜建設工業	1,000	2,873.00	2,873,000
若築建設	700	1,681.00	1,176,700
東洋建設	4,100	506.00	2,074,600
五洋建設	15,300	735.00	11,245,500
福田組	400	6,950.00	2,780,000
住友林業	8,200	1,660.00	13,612,000
日本基礎技術	1,500	374.00	561,000
日成ビルド工業	1,900	1,185.00	2,251,500
ヤマダ・エスバイエルホーム	6,000	71.00	426,000
巴コーポレーション	1,700	503.00	855,100
大和ハウス工業	38,000	3,963.00	150,594,000
ライト工業	2,500	1,120.00	2,800,000
積水ハウス	41,800	1,927.50	80,569,500
日特建設	1,200	624.00	748,800
北陸電気工事	700	1,191.00	833,700
ユアテック	1,800	917.00	1,650,600
西部電気工業	200	3,785.00	757,000
四電工	200	2,733.00	546,600
中電工	1,700	2,918.00	4,960,600
関電工	5,100	1,237.00	6,308,700
きんでん	8,600	1,818.00	15,634,800
東京エネシス	1,500	1,265.00	1,897,500
トーエネック	400	3,355.00	1,342,000
住友電設	1,000	1,999.00	1,999,000
日本電設工業	2,000	2,459.00	4,918,000
協和エクシオ	4,600	2,974.00	13,680,400
新日本空調	1,000	1,732.00	1,732,000
N D S	200	6,020.00	1,204,000
九電工	2,500	5,490.00	13,725,000
三機工業	2,700	1,099.00	2,967,300
日揮	11,100	2,181.00	24,209,100
中外炉工業	400	2,839.00	1,135,600
ヤマト	1,100	735.00	808,500
太平電業	900	3,040.00	2,736,000
高砂熱学工業	3,600	2,063.00	7,426,800

三晃金属工業	200	3,595.00	719,000
朝日工業社	300	3,440.00	1,032,000
明星工業	2,400	842.00	2,020,800
大気社	1,600	3,315.00	5,304,000
ダイダン	900	2,699.00	2,429,100
日比谷総合設備	1,400	2,216.00	3,102,400
東芝プラントシステム	2,800	2,594.00	7,263,200
OSJBホールディングス	5,800	290.00	1,682,000
東洋エンジニアリング	1,500	820.00	1,230,000
千代田化工建設	8,400	915.00	7,686,000
新興プランテック	2,500	1,011.00	2,527,500
日本製粉	3,800	1,913.00	7,269,400
日清製粉グループ本社	14,100	2,396.00	33,783,600
日東富士製粉	100	5,230.00	523,000
昭和産業	1,100	2,996.00	3,295,600
鳥越製粉	1,000	991.00	991,000
中部飼料	1,400	2,064.00	2,889,600
フィード・ワン	7,800	236.00	1,840,800
東洋精糖	200	1,236.00	247,200
日本甜菜製糖	700	2,319.00	1,623,300
三井製糖	900	3,560.00	3,204,000
塩水港精糖	1,600	263.00	420,800
日新製糖	500	2,130.00	1,065,000
森永製菓	2,700	5,360.00	14,472,000
中村屋	300	4,805.00	1,441,500
江崎グリコ	3,200	5,560.00	17,792,000
名糖産業	600	1,754.00	1,052,400
井村屋グループ	500	3,565.00	1,782,500
不二家	700	2,561.00	1,792,700
山崎製パン	9,400	2,813.00	26,442,200
第一屋製パン	200	1,188.00	237,600
モロゾフ	200	6,690.00	1,338,000
亀田製菓	700	6,110.00	4,277,000
寿スピリッツ	1,100	6,180.00	6,798,000
カルビー	5,300	3,885.00	20,590,500
森永乳業	2,300	4,295.00	9,878,500
六甲バター	800	2,431.00	1,944,800
ヤクルト本社	6,700	7,450.00	49,915,000
明治ホールディングス	7,600	9,630.00	73,188,000
雪印メグミルク	2,800	2,994.00	8,383,200
プリマハム	8,000	645.00	5,160,000
日本ハム	5,000	4,535.00	22,675,000

林兼産業	500	807.00	403,500
丸大食品	6,000	492.00	2,952,000
S Foods	800	4,455.00	3,564,000
伊藤ハム米久ホールディングス	7,400	962.00	7,118,800
サッポロホールディングス	4,200	2,860.00	12,012,000
アサヒグループホールディングス	24,100	5,702.00	137,418,200
キリンホールディングス	55,400	3,009.00	166,698,600
宝ホールディングス	8,600	1,460.00	12,556,000
オエノンホールディングス	3,300	437.00	1,442,100
養命酒製造	400	2,404.00	961,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	8,100	4,510.00	36,531,000
サントリー食品インターナショナル	8,800	4,900.00	43,120,000
ダイトーグループホールディングス	600	6,420.00	3,852,000
伊藤園	3,800	5,240.00	19,912,000
キーコーヒー	1,100	2,196.00	2,415,600
ユニカフェ	400	1,194.00	477,600
ジャパンフーズ	200	1,469.00	293,800
日清オイリオグループ	1,400	3,310.00	4,634,000
不二製油グループ本社	3,100	4,050.00	12,555,000
かどや製油	100	6,160.00	616,000
J - オイルミルズ	600	3,990.00	2,394,000
キッコーマン	9,000	5,540.00	49,860,000
味の素	26,500	2,157.50	57,173,750
キューピー	6,400	2,797.00	17,900,800
ハウス食品グループ本社	4,400	3,995.00	17,578,000
カゴメ	4,600	3,790.00	17,434,000
焼津水産化学工業	600	1,248.00	748,800
アリアケジャパン	1,100	9,780.00	10,758,000
ピエトロ	200	1,648.00	329,600
エバラ食品工業	300	2,391.00	717,300
ニチレイ	5,500	2,902.00	15,961,000
東洋水産	6,300	4,065.00	25,609,500
イトアンド	300	2,157.00	647,100
大冷	100	2,000.00	200,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	1,380.00	276,000
日清食品ホールディングス	5,000	8,280.00	41,400,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,500.00	1,500,000
一正蒲鉾	500	1,473.00	736,500
フジッコ	1,200	2,934.00	3,520,800
ロック・フィールド	1,200	1,988.00	2,385,600
日本たばこ産業	71,300	3,165.00	225,664,500
ケンコーマヨネーズ	800	4,235.00	3,388,000

わらべや日洋ホールディングス	700	2,701.00	1,890,700
なとり	700	1,907.00	1,334,900
イフジ産業	200	789.00	157,800
ピックルスコーポレーション	200	2,281.00	456,200
北の達人コーポレーション	3,500	859.00	3,006,500
ユーグレナ	4,600	909.00	4,181,400
ミヨシ油脂	500	1,445.00	722,500
理研ビタミン	400	4,525.00	1,810,000
片倉工業	1,400	1,336.00	1,870,400
ゲンゼ	900	7,210.00	6,489,000
東洋紡	4,400	1,843.00	8,109,200
ユニチカ	3,500	660.00	2,310,000
富士紡ホールディングス	700	3,895.00	2,726,500
倉敷紡績	12,000	362.00	4,344,000
シキボウ	600	1,316.00	789,600
日本毛織	3,400	1,097.00	3,729,800
ダイトウボウ	2,600	102.00	265,200
トーア紡コーポレーション	500	573.00	286,500
ダイドーリミテッド	1,400	460.00	644,000
帝国繊維	1,300	2,367.00	3,077,100
帝人	9,900	2,086.00	20,651,400
東レ	87,300	887.80	77,504,940
サカイオーベックス	300	2,310.00	693,000
住江織物	300	2,853.00	855,900
日本フェルト	600	530.00	318,000
イチカワ	1,000	362.00	362,000
日東製網	100	1,855.00	185,500
アツギ	800	1,206.00	964,800
ダイニック	500	1,061.00	530,500
セーレン	2,800	1,899.00	5,317,200
ソトー	400	1,044.00	417,600
東海染工	200	1,452.00	290,400
小松精練	1,800	1,008.00	1,814,400
ワコールホールディングス	3,300	3,405.00	11,236,500
ホギメディカル	1,500	5,000.00	7,500,000
レナウン	3,400	155.00	527,000
クラウディアホールディングス	300	598.00	179,400
T S Iホールディングス	4,100	818.00	3,353,800
マツオカコーポレーション	300	3,975.00	1,192,500
三陽商会	600	2,419.00	1,451,400
ナイガイ	500	567.00	283,500
オンワードホールディングス	7,000	895.00	6,265,000

ルックホールディングス	2,000	303.00	606,000
キムラタン	6,400	39.00	249,600
ゴールドウイン	700	9,660.00	6,762,000
デサント	2,700	2,066.00	5,578,200
キング	600	527.00	316,200
ヤマトインターナショナル	800	617.00	493,600
特種東海製紙	700	4,640.00	3,248,000
王子ホールディングス	51,000	715.00	36,465,000
日本製紙	5,400	1,867.00	10,081,800
三菱製紙	1,800	649.00	1,168,200
北越紀州製紙	6,700	591.00	3,959,700
中越パルプ工業	500	1,799.00	899,500
巴川製紙所	2,000	265.00	530,000
大王製紙	4,800	1,590.00	7,632,000
阿波製紙	300	645.00	193,500
レンゴー	11,600	1,019.00	11,820,400
トーモク	700	2,195.00	1,536,500
ザ・パック	900	3,800.00	3,420,000
クラレ	20,200	1,653.00	33,390,600
旭化成	75,000	1,446.00	108,450,000
共和レザー	700	1,039.00	727,300
昭和電工	8,000	4,960.00	39,680,000
住友化学	88,000	644.00	56,672,000
住友精化	500	5,790.00	2,895,000
日産化学工業	7,000	5,150.00	36,050,000
ラサ工業	500	3,105.00	1,552,500
クレハ	1,100	7,410.00	8,151,000
多木化学	200	5,260.00	1,052,000
テイカ	900	2,546.00	2,291,400
石原産業	2,200	1,120.00	2,464,000
片倉コープアグリ	300	1,218.00	365,400
日東エフシー	700	756.00	529,200
日本曹達	8,000	608.00	4,864,000
東ソー	17,400	1,807.00	31,441,800
トクヤマ	3,500	3,715.00	13,002,500
セントラル硝子	2,400	2,378.00	5,707,200
東亜合成	7,100	1,303.00	9,251,300
大阪ソーダ	1,200	3,100.00	3,720,000
関東電化工業	2,900	1,064.00	3,085,600
デンカ	4,400	3,885.00	17,094,000
信越化学工業	20,000	10,430.00	208,600,000
日本カーバイド工業	400	2,023.00	809,200

堺化学工業	800	2,906.00	2,324,800
エア・ウォーター	9,900	2,110.00	20,889,000
大陽日酸	9,300	1,686.00	15,679,800
日本化学工業	500	4,165.00	2,082,500
東邦アセチレン	200	1,561.00	312,200
日本パーカラライジング	6,100	1,691.00	10,315,100
高压ガス工業	1,800	1,010.00	1,818,000
四国化成工業	1,700	1,540.00	2,618,000
戸田工業	200	2,901.00	580,200
ステラ ケミファ	600	3,900.00	2,340,000
保土谷化学工業	400	3,620.00	1,448,000
日本触媒	1,900	8,290.00	15,751,000
大日精化工業	900	3,595.00	3,235,500
カネカ	16,000	1,064.00	17,024,000
三菱瓦斯化学	9,900	2,712.00	26,848,800
三井化学	10,900	3,045.00	33,190,500
J S R	12,100	1,921.00	23,244,100
東京応化工業	2,100	4,230.00	8,883,000
大阪有機化学工業	1,000	1,540.00	1,540,000
三菱ケミカルホールディングス	80,500	970.20	78,101,100
K Hネオケム	1,900	3,290.00	6,251,000
ダイセル	16,200	1,225.00	19,845,000
住友ベークライト	10,000	1,070.00	10,700,000
積水化学工業	25,000	1,856.00	46,400,000
日本ゼオン	10,100	1,387.00	14,008,700
アイカ工業	3,400	4,050.00	13,770,000
宇部興産	6,000	3,085.00	18,510,000
積水樹脂	1,900	2,418.00	4,594,200
タキロンシーアイ	2,500	663.00	1,657,500
旭有機材	700	2,247.00	1,572,900
日立化成	5,900	2,373.00	14,000,700
ニチバン	600	3,000.00	1,800,000
リケンテクノス	2,600	576.00	1,497,600
大倉工業	3,000	531.00	1,593,000
積水化成成品工業	1,500	1,221.00	1,831,500
群栄化学工業	300	3,630.00	1,089,000
タイガースポリマー	600	807.00	484,200
ミライアル	400	1,410.00	564,000
ダイキアクシス	400	1,338.00	535,200
ダイキョーニシカワ	2,400	1,728.00	4,147,200
竹本容器	200	3,115.00	623,000
森六ホールディングス	600	3,245.00	1,947,000



日本化薬	7,800	1,198.00	9,344,400
カーリットホールディングス	1,100	1,025.00	1,127,500
日本精化	1,000	1,240.00	1,240,000
扶桑化学工業	1,100	2,868.00	3,154,800
トリケミカル研究所	300	4,575.00	1,372,500
A D E K A	5,200	1,904.00	9,900,800
日油	4,700	3,455.00	16,238,500
新日本理化	2,000	254.00	508,000
ハリマ化成グループ	900	912.00	820,800
花王	28,300	8,647.00	244,710,100
第一工業製薬	2,000	766.00	1,532,000
石原ケミカル	300	2,247.00	674,100
日華化学	400	1,203.00	481,200
ニイタカ	200	1,752.00	350,400
三洋化成工業	800	5,070.00	4,056,000
有機合成薬品工業	800	283.00	226,400
大日本塗料	1,400	1,538.00	2,153,200
日本ペイントホールディングス	9,300	4,700.00	43,710,000
関西ペイント	12,700	2,271.00	28,841,700
神東塗料	900	228.00	205,200
中国塗料	3,500	1,067.00	3,734,500
日本特殊塗料	800	2,418.00	1,934,400
藤倉化成	1,500	685.00	1,027,500
太陽ホールディングス	900	4,660.00	4,194,000
D I C	4,700	3,625.00	17,037,500
サカタインクス	2,500	1,524.00	3,810,000
東洋インキ S C ホールディングス	12,000	606.00	7,272,000
T & K T O K A	800	1,228.00	982,400
富士フイルムホールディングス	23,900	4,312.00	103,056,800
資生堂	21,400	8,993.00	192,450,200
ライオン	16,000	2,131.00	34,096,000
高砂香料工業	700	3,765.00	2,635,500
マンダム	2,200	3,570.00	7,854,000
ミルボン	1,500	5,070.00	7,605,000
ファンケル	2,800	5,720.00	16,016,000
コーセー	1,900	25,760.00	48,944,000
コタ	600	1,499.00	899,400
シーズ・ホールディングス	1,400	4,990.00	6,986,000
シーボン	100	3,020.00	302,000
ポーラ・オルビスホールディングス	4,900	5,220.00	25,578,000
ノエビアホールディングス	700	8,250.00	5,775,000
アジュバンコスメジャパン	300	1,121.00	336,300

エステー	800	3,020.00	2,416,000	
アグロ カネショウ	500	2,849.00	1,424,500	
コニシ	1,900	1,874.00	3,560,600	
長谷川香料	1,400	2,202.00	3,082,800	
星光P M C	700	1,125.00	787,500	
小林製薬	3,200	9,950.00	31,840,000	
荒川化学工業	1,000	1,930.00	1,930,000	
メック	800	2,060.00	1,648,000	
日本高純度化学	300	2,465.00	739,500	
タカラバイオ	3,000	2,458.00	7,374,000	
J C U	1,400	2,658.00	3,721,200	
新田ゼラチン	800	842.00	673,600	
O A T アグリオ	200	3,545.00	709,000	
デクセリアルズ	3,000	1,102.00	3,306,000	
アース製薬	900	5,710.00	5,139,000	
北興化学工業	1,200	654.00	784,800	
大成ラミック	400	3,160.00	1,264,000	
クミアイ化学工業	5,200	854.00	4,440,800	
日本農薬	2,800	663.00	1,856,400	
アキレス	900	2,319.00	2,087,100	
有沢製作所	1,900	1,223.00	2,323,700	
日東電工	8,700	8,706.00	75,742,200	
レック	700	4,610.00	3,227,000	
きもと	2,100	313.00	657,300	
藤森工業	1,000	3,795.00	3,795,000	
前澤化成工業	800	1,250.00	1,000,000	
ウェーブロックホールディングス	200	1,158.00	231,600	
J S P	700	3,445.00	2,411,500	
エフピコ	900	6,410.00	5,769,000	
天馬	900	2,013.00	1,811,700	
信越ポリマー	2,300	1,128.00	2,594,400	
東リ	2,800	353.00	988,400	
ニフコ	4,200	3,805.00	15,981,000	
日本バルカー工業	900	3,295.00	2,965,500	
ユニ・チャーム	24,400	3,462.00	84,472,800	
協和発酵キリン	14,400	2,357.00	33,940,800	
武田薬品工業	42,300	4,365.00	184,639,500	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	118,100	1,768.00	208,800,800	
大日本住友製薬	8,500	2,365.00	20,102,500	
塩野義製薬	16,200	5,786.00	93,733,200	
田辺三菱製薬	14,000	1,915.00	26,810,000	
わかもと製薬	1,500	290.00	435,000	

あすか製薬	1,300	1,302.00	1,692,600
日本新薬	3,000	7,530.00	22,590,000
ピオフェルミン製薬	200	2,929.00	585,800
中外製薬	12,000	6,020.00	72,240,000
科研製薬	2,100	5,850.00	12,285,000
エーザイ	13,700	8,174.00	111,983,800
ロート製薬	6,300	3,540.00	22,302,000
小野薬品工業	27,100	2,673.00	72,438,300
久光製薬	3,400	9,590.00	32,606,000
持田製薬	800	8,160.00	6,528,000
参天製薬	21,800	2,059.00	44,886,200
扶桑薬品工業	400	2,974.00	1,189,600
日本ケミファ	200	4,680.00	936,000
ツムラ	4,100	3,905.00	16,010,500
日医工	3,000	1,698.00	5,094,000
キッセイ薬品工業	2,000	3,105.00	6,210,000
生化学工業	2,200	1,570.00	3,454,000
栄研化学	1,900	2,549.00	4,843,100
日水製薬	500	1,425.00	712,500
鳥居薬品	700	2,841.00	1,988,700
JCRファーマ	800	7,130.00	5,704,000
東和薬品	500	6,390.00	3,195,000
富士製薬工業	400	4,140.00	1,656,000
沢井製薬	2,300	5,000.00	11,500,000
ゼリア新薬工業	2,500	2,295.00	5,737,500
第一三共	32,900	4,017.00	132,159,300
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,344.00	7,500,800
大幸薬品	600	2,152.00	1,291,200
ダイト	700	3,720.00	2,604,000
大塚ホールディングス	23,900	5,474.00	130,828,600
大正製薬ホールディングス	2,600	12,370.00	32,162,000
ペプチドリーム	5,200	4,865.00	25,298,000
日本コークス工業	9,800	118.00	1,156,400
昭和シェル石油	10,800	1,607.00	17,355,600
ニチレキ	1,500	1,233.00	1,849,500
ユシロ化学工業	600	1,652.00	991,200
ビーピー・カストロール	500	1,683.00	841,500
富士石油	2,800	387.00	1,083,600
MORESCO	400	1,892.00	756,800
出光興産	9,700	3,780.00	36,666,000
JXTGホールディングス	183,300	764.00	140,041,200
コスモエネルギーホールディングス	3,300	3,690.00	12,177,000

横浜ゴム	6,600	2,412.00	15,919,200
東洋ゴム工業	6,800	1,673.00	11,376,400
ブリヂストン	38,000	4,424.00	168,112,000
住友ゴム工業	11,800	1,858.00	21,924,400
藤倉ゴム工業	1,000	691.00	691,000
オカモト	4,000	1,256.00	5,024,000
フコク	500	998.00	499,000
ニッタ	1,200	4,325.00	5,190,000
住友理工	2,200	1,169.00	2,571,800
三ツ星ベルト	3,000	1,412.00	4,236,000
バンドー化学	2,200	1,348.00	2,965,600
日東紡績	1,700	2,622.00	4,457,400
旭硝子	11,600	4,535.00	52,606,000
日本板硝子	5,800	1,106.00	6,414,800
石塚硝子	200	2,477.00	495,400
日本山村硝子	5,000	184.00	920,000
日本電気硝子	5,000	3,180.00	15,900,000
オハラ	500	2,719.00	1,359,500
住友大阪セメント	22,000	530.00	11,660,000
太平洋セメント	7,300	4,055.00	29,601,500
日本ヒューム	1,200	901.00	1,081,200
日本コンクリート工業	2,600	364.00	946,400
三谷セキサン	600	2,693.00	1,615,800
アジアパイルホールディングス	1,500	745.00	1,117,500
東海カーボン	10,500	2,121.00	22,270,500
日本カーボン	600	6,850.00	4,110,000
東洋炭素	800	3,440.00	2,752,000
ノリタケカンパニーリミテド	600	5,240.00	3,144,000
TOTO	8,900	5,630.00	50,107,000
日本碍子	14,000	2,012.00	28,168,000
日本特殊陶業	9,900	3,055.00	30,244,500
ダントーホールディングス	1,100	147.00	161,700
MARUWA	400	9,060.00	3,624,000
品川リフラクトリーズ	300	3,835.00	1,150,500
黒崎播磨	200	6,330.00	1,266,000
ヨータイ	1,000	694.00	694,000
イソライト工業	600	755.00	453,000
東京窯業	1,500	389.00	583,500
ニッカトー	500	1,151.00	575,500
フジインコーポレーテッド	1,000	2,646.00	2,646,000
クニミネ工業	300	1,126.00	337,800
エーアンドエーマテリアル	300	1,268.00	380,400

ニチアス	6,000	1,437.00	8,622,000
ニチハ	1,700	4,365.00	7,420,500
新日鐵住金	50,800	2,255.00	114,554,000
神戸製鋼所	20,800	1,142.00	23,753,600
合同製鐵	600	2,280.00	1,368,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	30,700	2,281.00	70,026,700
日新製鋼	3,200	1,581.00	5,059,200
東京製鐵	6,100	1,007.00	6,142,700
共英製鋼	1,300	2,259.00	2,936,700
大和工業	2,400	3,575.00	8,580,000
東京鐵鋼	500	1,672.00	836,000
大阪製鐵	800	2,194.00	1,755,200
淀川製鋼所	1,700	2,908.00	4,943,600
東洋鋼鋳	2,900	717.00	2,079,300
丸一鋼管	4,000	3,765.00	15,060,000
モリ工業	400	3,235.00	1,294,000
大同特殊鋼	2,000	5,320.00	10,640,000
日本高周波鋼業	500	833.00	416,500
日本冶金工業	9,500	339.00	3,220,500
山陽特殊製鋼	1,300	2,764.00	3,593,200
愛知製鋼	600	4,375.00	2,625,000
日立金属	12,200	1,208.00	14,737,600
日本金属	300	2,014.00	604,200
大平洋金属	700	3,990.00	2,793,000
新日本電工	6,900	329.00	2,270,100
栗本鐵工所	600	1,971.00	1,182,600
虹技	200	1,984.00	396,800
日本鑄鉄管	1,000	160.00	160,000
三菱製鋼	900	2,286.00	2,057,400
日亜鋼業	1,800	347.00	624,600
日本精線	200	4,455.00	891,000
シンニッタン	1,800	485.00	873,000
新家工業	300	2,121.00	636,300
大紀アルミニウム工業所	1,900	732.00	1,390,800
日本軽金属ホールディングス	33,200	254.00	8,432,800
三井金属鉱業	3,100	5,150.00	15,965,000
東邦亜鉛	600	4,335.00	2,601,000
三菱マテリアル	7,500	3,145.00	23,587,500
住友金属鉱山	14,500	4,610.00	66,845,000
D O W Aホールディングス	2,900	3,645.00	10,570,500
古河機械金属	1,900	1,635.00	3,106,500
エス・サイエンス	5,600	77.00	431,200

大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	1,699.00	2,038,800
東邦チタニウム	2,100	1,005.00	2,110,500
U A C J	1,700	2,579.00	4,384,300
C Kサンエツ	200	3,700.00	740,000
古河電気工業	3,800	4,040.00	15,352,000
住友電気工業	42,500	1,692.50	71,931,250
フジクラ	13,700	756.00	10,357,200
昭和電線ホールディングス	1,500	808.00	1,212,000
タツタ電線	2,300	626.00	1,439,800
カナレ電気	200	2,450.00	490,000
平河ヒューテック	600	1,383.00	829,800
リョービ	1,400	3,635.00	5,089,000
アーレスティ	1,400	1,051.00	1,471,400
アサヒホールディングス	2,000	2,123.00	4,246,000
稲葉製作所	700	1,440.00	1,008,000
宮地エンジニアリンググループ	300	2,132.00	639,600
トーカロ	3,200	1,315.00	4,208,000
アルファC o	400	1,672.00	668,800
S U M C O	10,500	2,349.00	24,664,500
川田テクノロジーズ	200	7,780.00	1,556,000
R S T e c h n o l o g i e s	200	6,280.00	1,256,000
東洋製罐グループホールディングス	7,800	1,870.00	14,586,000
ホッカンホールディングス	3,000	370.00	1,110,000
コロナ	600	1,215.00	729,000
横河ブリッジホールディングス	2,100	2,657.00	5,579,700
駒井ハルテック	300	2,378.00	713,400
高田機工	100	3,240.00	324,000
三和ホールディングス	10,900	1,209.00	13,178,100
文化シャッター	3,400	1,017.00	3,457,800
三協立山	1,600	1,473.00	2,356,800
アルインコ	800	1,080.00	864,000
東洋シャッター	400	685.00	274,000
L I X I L グループ	16,800	2,313.00	38,858,400
日本フィルコン	900	613.00	551,700
ノーリツ	2,500	1,888.00	4,720,000
長府製作所	1,300	2,372.00	3,083,600
リンナイ	2,000	10,280.00	20,560,000
ダイニチ工業	700	809.00	566,300
日東精工	1,600	765.00	1,224,000
三洋工業	200	2,198.00	439,600
岡部	2,300	1,007.00	2,316,100
ジーテクト	1,200	1,960.00	2,352,000

中国工業	200	684.00	136,800
東プレ	2,100	3,015.00	6,331,500
高周波熱錬	2,200	1,032.00	2,270,400
東京製綱	800	1,937.00	1,549,600
サンコール	700	727.00	508,900
モリテック スチール	900	647.00	582,300
パイオラックス	1,700	2,723.00	4,629,100
エイチワン	1,100	1,313.00	1,444,300
日本発條	11,300	1,089.00	12,305,700
中央発條	100	3,805.00	380,500
アドバネクス	200	2,303.00	460,600
立川ブラインド工業	500	1,448.00	724,000
三益半導体工業	900	1,812.00	1,630,800
日本ドライケミカル	200	2,349.00	469,800
日本製鋼所	3,700	3,070.00	11,359,000
三浦工業	4,900	2,831.00	13,871,900
タクマ	3,800	1,323.00	5,027,400
ツガミ	3,000	1,078.00	3,234,000
オークマ	1,300	6,020.00	7,826,000
東芝機械	6,000	571.00	3,426,000
アマダホールディングス	17,500	1,132.00	19,810,000
アイダエンジニアリング	2,900	1,175.00	3,407,500
滝澤鉄工所	400	1,864.00	745,600
F U J I	3,400	2,048.00	6,963,200
牧野フライス製作所	6,000	906.00	5,436,000
オーエスジー	5,200	2,422.00	12,594,400
ダイジェット工業	200	1,820.00	364,000
旭ダイヤモンド工業	3,400	865.00	2,941,000
D M G 森精機	6,300	1,692.00	10,659,600
ソディック	2,500	1,077.00	2,692,500
ディスコ	1,500	19,970.00	29,955,000
日東工器	700	2,769.00	1,938,300
日進工具	300	2,724.00	817,200
パンチ工業	1,000	1,204.00	1,204,000
富士ダイス	600	878.00	526,800
豊和工業	600	1,052.00	631,200
O K K	500	1,248.00	624,000
東洋機械金属	900	722.00	649,800
津田駒工業	300	1,995.00	598,500
島精機製作所	1,400	5,470.00	7,658,000
オプトラン	1,100	4,095.00	4,504,500
N C ホールディングス	400	779.00	311,600

フリー	800	1,042.00	833,600
ヤマシンフィルタ	1,700	1,150.00	1,955,000
日阪製作所	1,600	1,052.00	1,683,200
やまびこ	2,200	1,449.00	3,187,800
平田機工	400	7,430.00	2,972,000
ペガサスマシン製造	1,100	949.00	1,043,900
ナブテスコ	6,200	3,425.00	21,235,000
三井海洋開発	1,200	2,903.00	3,483,600
レオン自動機	1,000	2,175.00	2,175,000
S M C	3,600	39,150.00	140,940,000
新川	900	981.00	882,900
ホソカワミクロン	400	7,340.00	2,936,000
ユニオンツール	500	3,800.00	1,900,000
オイレス工業	1,500	2,326.00	3,489,000
日精エー・エス・ピー機械	300	5,940.00	1,782,000
サトーホールディングス	1,500	3,215.00	4,822,500
技研製作所	800	2,608.00	2,086,400
日本エアージェット	500	874.00	437,000
カワタ	300	1,709.00	512,700
日精樹脂工業	1,000	1,266.00	1,266,000
オカダアイヨン	400	1,649.00	659,600
ワイエイシイホールディングス	400	977.00	390,800
小松製作所	55,500	3,393.00	188,311,500
住友重機械工業	6,600	3,840.00	25,344,000
日立建機	5,400	3,720.00	20,088,000
日工	300	2,575.00	772,500
巴工業	500	2,272.00	1,136,000
井関農機	1,200	2,043.00	2,451,600
T O W A	900	1,296.00	1,166,400
丸山製作所	300	1,827.00	548,100
北川鉄工所	600	2,756.00	1,653,600
ローツェ	600	2,438.00	1,462,800
タカキタ	400	773.00	309,200
クボタ	61,600	1,843.00	113,528,800
荏原実業	300	2,357.00	707,100
三菱化工機	400	2,112.00	844,800
月島機械	2,300	1,739.00	3,999,700
帝国電機製作所	800	1,425.00	1,140,000
新東工業	2,700	1,019.00	2,751,300
澁谷工業	1,000	3,515.00	3,515,000
アイチ コーポレーション	2,000	715.00	1,430,000
小森コーポレーション	2,900	1,364.00	3,955,600



鶴見製作所	1,000	1,886.00	1,886,000
住友精密工業	2,000	374.00	748,000
酒井重工業	200	3,905.00	781,000
荏原製作所	4,700	3,525.00	16,567,500
石井鐵工所	200	2,067.00	413,400
西島製作所	1,200	1,032.00	1,238,400
北越工業	1,300	1,076.00	1,398,800
ダイキン工業	15,700	13,295.00	208,731,500
オルガノ	400	3,085.00	1,234,000
トーヨーカネツ	500	3,765.00	1,882,500
栗田工業	6,200	3,060.00	18,972,000
椿本チエイン	7,000	881.00	6,167,000
大同工業	500	1,529.00	764,500
木村化工機	1,000	447.00	447,000
アネスト岩田	1,900	1,136.00	2,158,400
ダイフク	5,900	5,170.00	30,503,000
サムコ	400	1,255.00	502,000
加藤製作所	500	2,885.00	1,442,500
油研工業	200	2,800.00	560,000
タダノ	5,600	1,447.00	8,103,200
フジテック	3,700	1,438.00	5,320,600
C K D	3,200	2,027.00	6,486,400
キトー	900	2,419.00	2,177,100
平和	3,600	2,623.00	9,442,800
理想科学工業	1,100	2,257.00	2,482,700
S A N K Y O	2,900	4,470.00	12,963,000
日本金銭機械	1,100	1,276.00	1,403,600
マースエンジニアリング	700	2,642.00	1,849,400
福島工業	700	5,060.00	3,542,000
オーイズミ	500	588.00	294,000
ダイコク電機	500	1,920.00	960,000
竹内製作所	1,900	2,385.00	4,531,500
アマノ	3,600	2,688.00	9,676,800
J U K I	1,700	1,189.00	2,021,300
サンデンホールディングス	1,400	1,549.00	2,168,600
蛇の目マシン工業	1,100	732.00	805,200
マックス	1,800	1,476.00	2,656,800
グローリー	3,400	3,210.00	10,914,000
新晃工業	1,200	1,916.00	2,299,200
大和冷機工業	1,900	1,295.00	2,460,500
セガサミーホールディングス	11,400	1,967.00	22,423,800
日本ピストンリング	400	2,339.00	935,600

リケン	500	5,960.00	2,980,000
T P R	1,300	2,844.00	3,697,200
ツバキ・ナカシマ	1,200	2,656.00	3,187,200
ホシザキ	3,600	11,510.00	41,436,000
大豊工業	900	1,325.00	1,192,500
日本精工	23,600	1,190.00	28,084,000
N T N	26,600	466.00	12,395,600
ジェイテクト	12,200	1,577.00	19,239,400
不二越	1,100	5,170.00	5,687,000
日本トムソン	3,700	924.00	3,418,800
T H K	7,200	3,500.00	25,200,000
ユーシン精機	1,000	1,414.00	1,414,000
前澤給装工業	400	1,974.00	789,600
イーグル工業	1,400	1,819.00	2,546,600
前澤工業	900	462.00	415,800
日本ピラー工業	1,200	1,579.00	1,894,800
キッツ	4,700	941.00	4,422,700
マキタ	15,000	5,130.00	76,950,000
日立造船	9,100	531.00	4,832,100
三菱重工業	19,200	4,156.00	79,795,200
I H I	8,800	4,075.00	35,860,000
スター精密	1,800	1,799.00	3,238,200
日清紡ホールディングス	7,000	1,252.00	8,764,000
イビデン	7,000	1,820.00	12,740,000
コニカミノルタ	26,900	1,062.00	28,567,800
ブラザー工業	14,000	2,297.00	32,158,000
ミネベアミツミ	21,300	1,955.00	41,641,500
日立製作所	276,000	817.90	225,740,400
三菱電機	114,900	1,521.00	174,762,900
富士電機	35,000	857.00	29,995,000
東洋電機製造	500	1,900.00	950,000
安川電機	13,300	4,195.00	55,793,500
シンフォニアテクノロジー	7,000	406.00	2,842,000
明電舎	10,000	408.00	4,080,000
オリジン電気	300	2,482.00	744,600
山洋電気	500	8,930.00	4,465,000
デンヨー	1,100	1,918.00	2,109,800
東芝テック	8,000	670.00	5,360,000
芝浦メカトロニクス	1,000	414.00	414,000
マブチモーター	3,200	5,120.00	16,384,000
日本電産	13,800	17,370.00	239,706,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	400	2,610.00	1,044,000

トレックス・セミコンダクター	300	1,516.00	454,800
東光高岳	600	1,949.00	1,169,400
ダブル・スコープ	1,700	1,889.00	3,211,300
ダイヘン	6,000	728.00	4,368,000
ヤーマン	1,700	1,990.00	3,383,000
JVCケンウッド	8,500	333.00	2,830,500
ミマキエンジニアリング	1,000	913.00	913,000
第一精工	500	2,090.00	1,045,000
日新電機	2,700	1,141.00	3,080,700
大崎電気工業	2,500	865.00	2,162,500
オムロン	12,200	5,530.00	67,466,000
日東工業	1,900	2,045.00	3,885,500
I D E C	1,400	2,819.00	3,946,600
不二電機工業	100	1,408.00	140,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	21,000	506.00	10,626,000
サクサホールディングス	300	2,400.00	720,000
メルコホールディングス	600	4,155.00	2,493,000
テクノメディカ	300	2,025.00	607,500
日本電気	14,900	3,125.00	46,562,500
富士通	118,000	708.30	83,579,400
沖電気工業	4,700	1,253.00	5,889,100
岩崎通信機	500	818.00	409,000
電気興業	600	3,385.00	2,031,000
サンケン電気	7,000	608.00	4,256,000
ナカヨ	200	1,851.00	370,200
アイホン	700	1,763.00	1,234,100
ルネサスエレクトロニクス	6,000	1,109.00	6,654,000
セイコーエプソン	17,100	1,944.00	33,242,400
ワコム	8,900	634.00	5,642,600
アルバック	2,600	4,710.00	12,246,000
アクセル	500	891.00	445,500
E I Z O	1,100	4,680.00	5,148,000
ジャパンディスプレイ	23,700	149.00	3,531,300
日本信号	3,200	1,094.00	3,500,800
京三製作所	2,700	829.00	2,238,300
能美防災	1,500	2,513.00	3,769,500
ホーチキ	800	2,178.00	1,742,400
星和電機	400	580.00	232,000
エレコム	1,000	2,706.00	2,706,000
パナソニック	131,200	1,566.00	205,459,200
シャープ	10,700	2,803.00	29,992,100
アンリツ	8,400	1,550.00	13,020,000

富士通ゼネラル	3,500	1,680.00	5,880,000
ソニー	76,900	5,445.00	418,720,500
TDK	6,000	11,490.00	68,940,000
帝国通信工業	500	1,325.00	662,500
タムラ製作所	4,500	760.00	3,420,000
アルプス電気	9,900	2,802.00	27,739,800
池上通信機	4,000	156.00	624,000
パイオニア	19,300	161.00	3,107,300
日本電波工業	1,100	615.00	676,500
鈴木	600	1,007.00	604,200
日本トリム	300	4,785.00	1,435,500
ローランド ディー・ジー・	600	2,514.00	1,508,400
フォスター電機	1,300	1,679.00	2,182,700
クラリオン	6,000	288.00	1,728,000
SMK	3,000	398.00	1,194,000
ヨコオ	800	2,175.00	1,740,000
ホシデン	2,900	1,017.00	2,949,300
ヒロセ電機	2,000	14,580.00	29,160,000
日本航空電子工業	3,000	1,795.00	5,385,000
TOA	1,200	1,178.00	1,413,600
マクセルホールディングス	2,300	1,785.00	4,105,500
古野電気	1,400	948.00	1,327,200
ユニデンホールディングス	3,000	344.00	1,032,000
アルパイン	2,700	2,089.00	5,640,300
スミダコーポレーション	1,200	1,255.00	1,506,000
アイコム	600	2,720.00	1,632,000
リオン	500	2,298.00	1,149,000
本多通信工業	900	960.00	864,000
船井電機	1,200	670.00	804,000
横河電機	11,500	2,008.00	23,092,000
新電元工業	400	5,770.00	2,308,000
アズビル	3,400	5,330.00	18,122,000
東亜ディーケーケー	600	1,270.00	762,000
日本光電工業	4,800	3,055.00	14,664,000
チノー	400	1,714.00	685,600
共和電業	1,300	444.00	577,200
日本電子材料	500	809.00	404,500
堀場製作所	2,300	8,250.00	18,975,000
アドバンテスト	6,400	2,322.00	14,860,800
小野測器	500	894.00	447,000
エスベック	1,000	2,201.00	2,201,000
キーエンス	5,600	67,560.00	378,336,000

日置電機	600	4,650.00	2,790,000
シスメックス	9,000	10,390.00	93,510,000
日本マイクロニクス	1,900	1,024.00	1,945,600
メガチップス	900	2,977.00	2,679,300
OBARA GROUP	700	6,240.00	4,368,000
澤藤電機	100	2,275.00	227,500
コーセル	1,600	1,379.00	2,206,400
イリソ電子工業	1,000	6,840.00	6,840,000
新日本無線	700	803.00	562,100
オブテックスグループ	1,900	2,990.00	5,681,000
千代田インテグレ	500	2,365.00	1,182,500
アイ・オー・データ機器	500	1,278.00	639,000
レーザーテック	2,400	3,230.00	7,752,000
スタンレー電気	8,800	3,945.00	34,716,000
岩崎電気	500	1,667.00	833,500
ウシオ電機	6,900	1,408.00	9,715,200
岡谷電機産業	900	546.00	491,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	733.00	733,000
日本セラミック	1,200	3,015.00	3,618,000
遠藤照明	600	949.00	569,400
古河電池	800	917.00	733,600
双信電機	500	597.00	298,500
山一電機	800	1,667.00	1,333,600
図研	800	1,831.00	1,464,800
日本電子	4,000	1,137.00	4,548,000
カシオ計算機	9,200	1,703.00	15,667,600
ファナック	10,900	22,630.00	246,667,000
日本シイエムケイ	2,000	743.00	1,486,000
エンプラス	500	3,200.00	1,600,000
大真空	400	1,452.00	580,800
ローム	5,200	9,630.00	50,076,000
浜松ホトニクス	8,200	4,710.00	38,622,000
三井ハイテック	1,500	1,416.00	2,124,000
新光電気工業	4,300	992.00	4,265,600
京セラ	18,900	6,540.00	123,606,000
太陽誘電	5,200	2,935.00	15,262,000
村田製作所	12,100	18,240.00	220,704,000
ユーシン	1,700	726.00	1,234,200
双葉電子工業	1,900	2,011.00	3,820,900
北陸電気工業	500	1,309.00	654,500
ニチコン	3,600	1,425.00	5,130,000
日本ケミコン	900	4,255.00	3,829,500

K O A	1,600	2,675.00	4,280,000	
市光工業	1,700	1,488.00	2,529,600	
小糸製作所	6,900	7,820.00	53,958,000	
ミツバ	2,100	1,077.00	2,261,700	
S C R E E Nホールディングス	2,200	8,620.00	18,964,000	
キャノン電子	1,100	2,388.00	2,626,800	
キャノン	61,800	3,752.00	231,873,600	代用有価証券 10,000株
リコー	34,600	1,014.00	35,084,400	
象印マホービン	2,200	1,589.00	3,495,800	
M U T O Hホールディングス	200	2,414.00	482,800	
東京エレクトロン	7,700	19,080.00	146,916,000	
トヨタ紡織	3,300	2,134.00	7,042,200	
芦森工業	300	2,638.00	791,400	
ユニプレス	2,200	2,355.00	5,181,000	
豊田自動織機	9,300	6,490.00	60,357,000	
モリタホールディングス	1,800	2,282.00	4,107,600	
三櫻工業	1,500	741.00	1,111,500	
デンソー	25,500	5,535.00	141,142,500	
東海理化電機製作所	3,000	2,116.00	6,348,000	
三井E & Sホールディングス	4,100	1,479.00	6,063,900	
川崎重工業	9,000	3,415.00	30,735,000	
名村造船所	3,500	491.00	1,718,500	
サノヤスホールディングス	1,400	245.00	343,000	
日本車輛製造	4,000	283.00	1,132,000	
三菱ロジスネクスト	1,400	1,239.00	1,734,600	
近畿車輛	200	2,492.00	498,400	
日産自動車	135,400	1,091.00	147,721,400	
いすゞ自動車	33,300	1,526.00	50,815,800	
トヨタ自動車	139,700	7,562.00	1,056,411,400	代用有価証券 35,000株
日野自動車	16,400	1,211.00	19,860,400	
三菱自動車工業	42,600	882.00	37,573,200	
エフテック	700	1,493.00	1,045,100	
レシップホールディングス	500	885.00	442,500	
G M B	200	1,521.00	304,200	
ファルテック	200	1,239.00	247,800	
武蔵精密工業	1,200	4,040.00	4,848,000	
日産車体	4,500	1,031.00	4,639,500	
新明和工業	5,000	1,306.00	6,530,000	
極東開発工業	2,100	1,693.00	3,555,300	
日信工業	2,300	2,060.00	4,738,000	
トビー工業	1,000	3,200.00	3,200,000	

ティラド	400	3,730.00	1,492,000
曙ブレーキ工業	5,400	341.00	1,841,400
タチエス	1,900	1,940.00	3,686,000
N O K	6,100	2,090.00	12,749,000
フタバ産業	3,500	782.00	2,737,000
K Y B	1,200	5,270.00	6,324,000
大同メタル工業	1,500	1,155.00	1,732,500
プレス工業	6,100	649.00	3,958,900
ミクニ	1,500	620.00	930,000
太平洋工業	2,400	1,803.00	4,327,200
ケーヒン	2,600	2,295.00	5,967,000
河西工業	1,400	1,485.00	2,079,000
アイシン精機	9,400	5,590.00	52,546,000
マツダ	36,100	1,425.00	51,442,500
今仙電機製作所	1,100	1,260.00	1,386,000
本田技研工業	103,400	3,533.00	365,312,200
スズキ	22,800	6,428.00	146,558,400
S U B A R U	35,700	3,389.00	120,987,300
安永	600	2,079.00	1,247,400
ヤマハ発動機	16,200	3,020.00	48,924,000
ショーワ	3,000	2,066.00	6,198,000
T B K	1,400	544.00	761,600
エクセディ	1,400	3,630.00	5,082,000
豊田合成	4,200	2,891.00	12,142,200
愛三工業	2,000	1,038.00	2,076,000
盟和産業	200	1,313.00	262,600
日本プラスト	600	1,037.00	622,200
ヨロズ	1,200	1,767.00	2,120,400
エフ・シー・シー	1,900	3,145.00	5,975,500
シマノ	4,600	16,510.00	75,946,000
テイ・エス テック	2,700	4,825.00	13,027,500
ジャムコ	600	2,388.00	1,432,800
テルモ	17,600	6,720.00	118,272,000
クリエートメディック	400	1,440.00	576,000
日機装	4,000	1,195.00	4,780,000
島津製作所	13,700	3,135.00	42,949,500
J M S	1,000	651.00	651,000
長野計器	900	1,341.00	1,206,900
ブイ・テクノロジー	300	22,550.00	6,765,000
東京計器	700	1,252.00	876,400
愛知時計電機	100	4,150.00	415,000
インターアクション	600	1,400.00	840,000

オーバル	1,200	332.00	398,400
東京精密	2,100	4,015.00	8,431,500
マニー	1,400	5,230.00	7,322,000
ニコン	20,000	1,802.00	36,040,000
トプコン	6,200	1,975.00	12,245,000
オリンパス	17,100	4,130.00	70,623,000
理研計器	1,100	2,589.00	2,847,900
タムロン	900	2,062.00	1,855,800
H O Y A	23,100	6,433.00	148,602,300
シード	200	7,080.00	1,416,000
ノーリツ鋼機	1,200	1,987.00	2,384,400
エー・アンド・デイ	1,100	1,111.00	1,222,100
シチズン時計	13,700	730.00	10,001,000
リズム時計工業	400	2,372.00	948,800
大研医器	1,100	749.00	823,900
メニコン	1,600	3,010.00	4,816,000
シンシア	100	645.00	64,500
松風	500	1,423.00	711,500
セイコーホールディングス	1,800	2,537.00	4,566,600
ニプロ	7,900	1,318.00	10,412,200
中本パックス	300	1,736.00	520,800
スノーピーク	400	1,556.00	622,400
パラマウントベッドホールディングス	1,200	4,825.00	5,790,000
トランザクション	600	1,027.00	616,200
S H O - B I	400	446.00	178,400
ニホンフラッシュ	600	2,883.00	1,729,800
前田工織	1,300	1,958.00	2,545,400
永大産業	1,400	544.00	761,600
アートネイチャー	1,200	717.00	860,400
バンダイナムコホールディングス	11,900	4,620.00	54,978,000
アイフィスジャパン	300	717.00	215,100
共立印刷	1,800	381.00	685,800
S H O E I	500	4,030.00	2,015,000
フランスベッドホールディングス	1,400	956.00	1,338,400
パイロットコーポレーション	2,000	6,400.00	12,800,000
萩原工業	600	1,869.00	1,121,400
トッパン・フォームズ	2,400	1,129.00	2,709,600
フジシールインターナショナル	2,600	4,110.00	10,686,000
タカラトミー	4,800	956.00	4,588,800
廣濟堂	1,100	528.00	580,800
A s - m e エステール	400	777.00	310,800
アーケ	6,000	125.00	750,000



タカノ	500	1,044.00	522,000
プロネクサス	1,100	1,342.00	1,476,200
ホクシン	1,000	172.00	172,000
ウッドワン	400	1,418.00	567,200
大建工業	900	2,616.00	2,354,400
凸版印刷	32,000	897.00	28,704,000
大日本印刷	15,000	2,469.00	37,035,000
図書印刷	800	1,050.00	840,000
共同印刷	300	2,968.00	890,400
N I S S H A	2,400	2,250.00	5,400,000
光村印刷	100	2,235.00	223,500
宝印刷	600	1,874.00	1,124,400
アシックス	11,400	1,763.00	20,098,200
ツツミ	400	1,884.00	753,600
小松ウオール工業	400	2,154.00	861,600
ヤマハ	7,700	5,940.00	45,738,000
河合楽器製作所	400	5,510.00	2,204,000
クリナップ	1,100	849.00	933,900
ピジョン	6,900	5,530.00	38,157,000
兼松サステック	100	2,011.00	201,100
キングジム	1,000	1,102.00	1,102,000
リンテック	2,700	3,210.00	8,667,000
イトーキ	2,500	658.00	1,645,000
任天堂	7,100	37,760.00	268,096,000
三菱鉛筆	1,900	2,251.00	4,276,900
タカラスタンダード	2,400	1,877.00	4,504,800
コクヨ	5,500	2,002.00	11,011,000
ナカバヤシ	1,200	739.00	886,800
オカムラ	4,000	1,618.00	6,472,000
美津濃	1,100	4,135.00	4,548,500
東京電力ホールディングス	91,800	507.00	46,542,600
中部電力	35,200	1,695.50	59,681,600
関西電力	46,900	1,625.00	76,212,500
中国電力	15,900	1,460.00	23,214,000
北陸電力	11,300	1,159.00	13,096,700
東北電力	27,000	1,374.00	37,098,000
四国電力	10,400	1,590.00	16,536,000
九州電力	25,400	1,262.00	32,054,800
北海道電力	11,600	770.00	8,932,000
沖縄電力	2,250	2,294.00	5,161,500
電源開発	9,100	2,898.00	26,371,800
エフオン	600	1,651.00	990,600

イーレックス	1,900	1,178.00	2,238,200
東京瓦斯	24,500	2,994.50	73,365,250
大阪瓦斯	22,300	2,353.50	52,483,050
東邦瓦斯	5,700	3,795.00	21,631,500
北海道瓦斯	3,000	309.00	927,000
広島ガス	2,400	390.00	936,000
西部瓦斯	1,400	3,030.00	4,242,000
静岡ガス	3,300	1,081.00	3,567,300
メタウォーター	700	3,135.00	2,194,500
SBSホールディングス	1,100	1,286.00	1,414,600
東武鉄道	12,100	3,605.00	43,620,500
相鉄ホールディングス	3,700	3,510.00	12,987,000
東京急行電鉄	31,200	2,029.00	63,304,800
京浜急行電鉄	15,800	1,956.00	30,904,800
小田急電鉄	17,100	2,475.00	42,322,500
京王電鉄	6,400	5,460.00	34,944,000
京成電鉄	8,000	3,955.00	31,640,000
富士急行	1,600	3,510.00	5,616,000
東日本旅客鉄道	20,600	11,080.00	228,248,000
西日本旅客鉄道	10,400	8,202.00	85,300,800
東海旅客鉄道	10,300	24,020.00	247,406,000
西武ホールディングス	14,700	1,948.00	28,635,600
鴻池運輸	1,600	1,765.00	2,824,000
西日本鉄道	3,200	3,125.00	10,000,000
ハマキョウレックス	800	3,575.00	2,860,000
サカイ引越センター	600	5,770.00	3,462,000
近鉄グループホールディングス	10,900	4,740.00	51,666,000
阪急阪神ホールディングス	14,500	4,755.00	68,947,500
南海電気鉄道	5,200	3,245.00	16,874,000
京阪ホールディングス	4,900	4,015.00	19,673,500
神戸電鉄	300	4,015.00	1,204,500
名古屋鉄道	8,700	3,035.00	26,404,500
山陽電気鉄道	800	2,754.00	2,203,200
日本通運	4,300	8,960.00	38,528,000
ヤマトホールディングス	19,100	3,420.00	65,322,000
山九	2,800	6,280.00	17,584,000
丸運	600	368.00	220,800
丸全昭和運輸	4,000	526.00	2,104,000
センコーグループホールディングス	6,600	924.00	6,098,400
トナミホールディングス	300	7,360.00	2,208,000
ニッコンホールディングス	4,100	3,080.00	12,628,000
日本石油輸送	100	3,280.00	328,000

福山通運	1,600	5,880.00	9,408,000
セイノーホールディングス	8,100	2,142.00	17,350,200
エスライン	300	1,208.00	362,400
神奈川中央交通	300	3,740.00	1,122,000
日立物流	2,400	3,010.00	7,224,000
丸和運輸機関	600	4,020.00	2,412,000
C & F ロジホールディングス	1,200	1,390.00	1,668,000
九州旅客鉄道	9,100	3,590.00	32,669,000
S Gホールディングス	10,300	2,489.00	25,636,700
日本郵船	9,100	2,340.00	21,294,000
商船三井	6,900	2,940.00	20,286,000
川崎汽船	5,000	2,271.00	11,355,000
N S ユナイテッド海運	500	2,175.00	1,087,500
明治海運	1,200	414.00	496,800
飯野海運	5,600	514.00	2,878,400
共栄タンカー	100	1,960.00	196,000
乾汽船	900	1,114.00	1,002,600
日本航空	20,200	4,294.00	86,738,800
A N Aホールディングス	21,100	4,450.00	93,895,000
パスコ	1,000	319.00	319,000
トランコム	300	8,340.00	2,502,000
日新	900	2,467.00	2,220,300
三菱倉庫	3,800	2,380.00	9,044,000
三井倉庫ホールディングス	6,000	357.00	2,142,000
住友倉庫	7,000	695.00	4,865,000
澁澤倉庫	600	1,848.00	1,108,800
東陽倉庫	2,000	369.00	738,000
日本トランスシティ	2,600	542.00	1,409,200
ケイヒン	200	1,648.00	329,600
中央倉庫	600	1,244.00	746,400
川西倉庫	200	1,907.00	381,400
安田倉庫	1,000	947.00	947,000
東洋埠頭	300	1,736.00	520,800
宇徳	900	514.00	462,600
上組	6,700	2,465.00	16,515,500
サンリツ	300	824.00	247,200
キムラユニティー	300	1,164.00	349,200
キューソー流通システム	300	2,760.00	828,000
近鉄エクスプレス	2,100	2,403.00	5,046,300
東海運	600	405.00	243,000
エーアイティー	800	1,187.00	949,600
内外トランスライン	400	1,608.00	643,200

日本コンセプト	200	1,479.00	295,800
NEC ネットエスアイ	1,200	2,522.00	3,026,400
システナ	3,600	1,254.00	4,514,400
デジタルアーツ	600	5,940.00	3,564,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,700	3,055.00	5,193,500
キューブシステム	700	1,021.00	714,700
エイジア	300	1,613.00	483,900
コア	500	1,429.00	714,500
ソリトンシステムズ	500	1,166.00	583,000
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,783.00	1,069,800
T I S	3,700	5,240.00	19,388,000
ネオス	500	441.00	220,500
電算システム	400	2,144.00	857,600
グリー	6,100	633.00	3,861,300
コーエーテクモホールディングス	1,900	2,231.00	4,238,900
三菱総合研究所	400	4,975.00	1,990,000
ボルテージ	300	851.00	255,300
電算	100	2,234.00	223,400
A G S	600	881.00	528,600
ファインデックス	900	861.00	774,900
ヒト・コミュニケーションズ	300	2,158.00	647,400
ブレインパッド	300	3,460.00	1,038,000
K L a b	2,100	1,647.00	3,458,700
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	2,446.00	1,956,800
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,222.00	244,400
ネクソン	25,400	1,764.00	44,805,600
アイスタイル	2,900	1,222.00	3,543,800
エムアップ	400	1,733.00	693,200
エイチーム	700	2,647.00	1,852,900
テクノスジャパン	1,000	1,036.00	1,036,000
コロプラ	3,200	772.00	2,470,400
モバイルクリエイト	1,000	332.00	332,000
オルトプラス	700	825.00	577,500
ブロードリーフ	5,600	602.00	3,371,200
クロス・マーケティンググループ	300	714.00	214,200
ハーツユナイテッドグループ	600	1,699.00	1,019,400
メディアドゥホールディングス	400	2,378.00	951,200
ブイキューブ	700	583.00	408,100
サイバーリンクス	200	1,210.00	242,000
ディー・エル・イー	800	548.00	438,400
フィックスターズ	1,100	1,613.00	1,774,300
VOYAGE GROUP	600	1,235.00	741,000

オブティム	200	2,924.00	584,800
セレス	400	1,998.00	799,200
ベリサーブ	200	3,515.00	703,000
ティーガイア	1,100	3,115.00	3,426,500
セック	100	2,963.00	296,300
日本アジアグループ	1,200	500.00	600,000
豆蔵ホールディングス	800	1,047.00	837,600
テクマトリックス	600	2,422.00	1,453,200
プロシップ	200	2,667.00	533,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,700	283.00	8,688,100
GMOペイメントゲートウェイ	900	11,850.00	10,665,000
ザッパラス	600	372.00	223,200
システムリサーチ	100	2,993.00	299,300
インターネットイニシアティブ	1,800	2,349.00	4,228,200
さくらインターネット	1,400	863.00	1,208,200
ヴィンクス	300	1,190.00	357,000
GMOクラウド	200	3,495.00	699,000
SRAホールディングス	600	2,971.00	1,782,600
Minorityソリューションズ	200	1,596.00	319,200
システムインテグレータ	200	1,096.00	219,200
朝日ネット	1,000	532.00	532,000
eBASE	300	1,637.00	491,100
アバント	300	968.00	290,400
アドソル日進	400	1,784.00	713,600
フリービット	800	1,445.00	1,156,000
コムチュア	600	3,070.00	1,842,000
サイバーコム	200	2,102.00	420,400
インフォテリア	600	1,237.00	742,200
メディカル・データ・ビジョン	900	1,646.00	1,481,400
gumi	1,300	826.00	1,073,800
ショーケース・ティービー	200	1,353.00	270,600
モバイルファクトリー	300	1,748.00	524,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,155.00	577,500
PCIホールディングス	200	3,470.00	694,000
パイプHD	200	1,051.00	210,200
アイビーシー	200	2,041.00	408,200
ネオジャパン	300	1,884.00	565,200
オープンドア	500	2,034.00	1,017,000
マイネット	300	1,235.00	370,500
アカツキ	300	4,535.00	1,360,500
ベネフィットジャパン	100	1,366.00	136,600
Ubicomホールディングス	200	1,036.00	207,200

L I N E	3,400	4,325.00	14,705,000
シンクロ・フード	400	971.00	388,400
オークネット	500	1,477.00	738,500
A O I T Y O H o l d i n g s	900	1,456.00	1,310,400
マクロミル	1,400	2,500.00	3,500,000
ビーグリー	300	1,560.00	468,000
オロ	100	3,535.00	353,500
ソルクシーズ	400	1,499.00	599,600
フェイス	400	1,426.00	570,400
ハイマックス	200	1,889.00	377,800
野村総合研究所	7,200	5,740.00	41,328,000
サイバネットシステム	900	943.00	848,700
C E ホールディングス	300	821.00	246,300
日本システム技術	200	1,450.00	290,000
インテージホールディングス	1,300	1,173.00	1,524,900
東邦システムサイエンス	400	873.00	349,200
ソースネクスト	1,600	831.00	1,329,600
フォーカスシステムズ	700	854.00	597,800
クレスコ	300	3,385.00	1,015,500
フジ・メディア・ホールディングス	11,800	1,892.00	22,325,600
オービック	3,500	9,630.00	33,705,000
ジャストシステム	1,800	2,352.00	4,233,600
T D C ソフト	500	1,678.00	839,000
ヤフー	81,200	381.00	30,937,200
トレンドマイクロ	5,500	6,470.00	35,585,000
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,436.00	430,800
日本オラクル	1,800	8,820.00	15,876,000
アルファシステムズ	400	2,301.00	920,400
フューチャー	1,500	1,445.00	2,167,500
C A C H o l d i n g s	800	1,096.00	876,800
ソフトバンク・テクノロジー	500	1,764.00	882,000
トーセ	300	1,180.00	354,000
オービックビジネスコンサルタント	600	8,490.00	5,094,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,100	2,013.00	10,266,300
アイティフォー	1,400	1,347.00	1,885,800
東計電算	200	3,185.00	637,000
エクスネット	200	905.00	181,000
大塚商会	6,800	4,610.00	31,348,000
サイボウズ	1,500	544.00	816,000
ソフトブレーン	900	624.00	561,600
電通国際情報サービス	700	3,570.00	2,499,000
デジタルガレージ	2,000	4,765.00	9,530,000

EMシステムズ	800	1,107.00	885,600
ウェザーニューズ	400	3,355.00	1,342,000
C I J	900	704.00	633,600
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,025.00	202,500
日本エンタープライズ	1,300	221.00	287,300
WOWOW	500	3,420.00	1,710,000
スカラ	900	897.00	807,300
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,000	1,012.00	1,012,000
ネットワンシステムズ	4,600	1,901.00	8,744,600
システムソフト	2,800	143.00	400,400
アルゴグラフィックス	500	3,635.00	1,817,500
マーベラス	1,900	946.00	1,797,400
エイベックス	2,100	1,524.00	3,200,400
日本ユニシス	3,100	2,773.00	8,596,300
兼松エレクトロニクス	700	3,975.00	2,782,500
東京放送ホールディングス	6,200	2,524.00	15,648,800
日本テレビホールディングス	10,300	1,891.00	19,477,300
朝日放送グループホールディングス	1,100	850.00	935,000
テレビ朝日ホールディングス	3,100	2,431.00	7,536,100
スカパーJ S A Tホールディングス	8,500	519.00	4,411,500
テレビ東京ホールディングス	900	3,365.00	3,028,500
日本BS放送	400	1,400.00	560,000
ビジョン	300	3,835.00	1,150,500
USEN-NEXT HOLDINGS	300	1,156.00	346,800
ワイヤレスゲート	600	1,461.00	876,600
コネクシオ	800	1,995.00	1,596,000
クロップス	300	891.00	267,300
日本電信電話	80,900	5,236.00	423,592,400
KDDI	101,600	3,038.00	308,660,800
光通信	1,400	20,340.00	28,476,000
NTTドコモ	81,100	2,858.50	231,824,350
エムティーアイ	1,300	628.00	816,400
GMOインターネット	4,100	2,852.00	11,693,200
アйдママーケティングコミュニケーション	300	845.00	253,500
カドカワ	3,300	1,260.00	4,158,000
学研ホールディングス	400	5,380.00	2,152,000
ゼンリン	2,000	2,616.00	5,232,000
昭文社	600	808.00	484,800
インプレスホールディングス	1,100	180.00	198,000
アイネット	600	1,848.00	1,108,800
松竹	700	16,410.00	11,487,000
東宝	7,400	3,770.00	27,898,000

東映	400	11,690.00	4,676,000
エヌ・ティ・ティ・データ	35,000	1,287.00	45,045,000
ピー・シー・エー	200	1,898.00	379,600
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,280.00	456,000
D T S	1,200	4,475.00	5,370,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,300	5,550.00	29,415,000
シーイーシー	700	4,430.00	3,101,000
カプコン	4,800	2,541.00	12,196,800
アイ・エス・ビー	200	2,028.00	405,600
ジャステック	600	1,184.00	710,400
S C S K	2,600	5,370.00	13,962,000
日本システムウエア	400	2,419.00	967,600
アイネス	1,400	1,175.00	1,645,000
T K C	1,000	4,390.00	4,390,000
富士ソフト	1,600	4,755.00	7,608,000
N S D	1,800	2,545.00	4,581,000
コナミホールディングス	4,600	5,530.00	25,438,000
福井コンピュータホールディングス	300	2,010.00	603,000
J B C Cホールディングス	900	1,211.00	1,089,900
ミロク情報サービス	1,000	3,100.00	3,100,000
ソフトバンクグループ	51,000	8,324.00	424,524,000
ハウスイ	100	1,177.00	117,700
高千穂交易	400	1,197.00	478,800
伊藤忠食品	300	6,200.00	1,860,000
エレマテック	500	2,629.00	1,314,500
J A L U X	300	3,120.00	936,000
あらた	600	6,850.00	4,110,000
トーメンデバイス	200	2,902.00	580,400
東京エレクトロン デバイス	400	2,075.00	830,000
フィールズ	900	1,019.00	917,100
双日	67,000	412.00	27,604,000
アルフレッサ ホールディングス	12,600	2,753.00	34,687,800
横浜冷凍	2,900	1,052.00	3,050,800
神栄	200	1,458.00	291,600
ラサ商事	500	974.00	487,000
ラクーン	700	608.00	425,600
アルコニックス	1,200	1,802.00	2,162,400
神戸物産	700	5,280.00	3,696,000
ペッパーフードサービス	800	5,080.00	4,064,000
あい ホールディングス	1,800	2,595.00	4,671,000
ディーブイエックス	400	1,398.00	559,200
ダイワボウホールディングス	1,000	6,290.00	6,290,000



マクニカ・富士エレホールディングス	2,200	1,878.00	4,131,600
ラクト・ジャパン	200	5,650.00	1,130,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,100	1,164.00	2,444,400
八洲電機	900	954.00	858,600
メディアスホールディングス	600	1,105.00	663,000
U K Cホールディングス	700	2,292.00	1,604,400
ジューテックホールディングス	300	1,182.00	354,600
大光	300	807.00	242,100
O C H Iホールディングス	300	1,474.00	442,200
T O K A Iホールディングス	6,000	1,133.00	6,798,000
C o m i n i x	200	968.00	193,600
三洋貿易	600	2,198.00	1,318,800
ビューティガレージ	200	2,722.00	544,400
ウイン・パートナーズ	800	1,414.00	1,131,200
ミタチ産業	300	1,023.00	306,900
シップヘルスケアホールディングス	2,300	4,240.00	9,752,000
明治電機工業	400	2,067.00	826,800
デリカフーズホールディングス	300	1,608.00	482,400
スターティアホールディングス	300	724.00	217,200
コメダホールディングス	2,100	2,165.00	4,546,500
富士興産	400	640.00	256,000
協栄産業	100	2,145.00	214,500
小野建	1,000	2,016.00	2,016,000
佐島電機	800	1,045.00	836,000
エコートレーディング	200	719.00	143,800
伯東	700	1,716.00	1,201,200
コンドーテック	900	1,032.00	928,800
中山福	700	746.00	522,200
ナガイレーベン	1,600	2,926.00	4,681,600
三菱食品	1,200	3,015.00	3,618,000
松田産業	800	1,674.00	1,339,200
第一興商	1,700	5,160.00	8,772,000
メディバルホールディングス	11,300	2,518.00	28,453,400
S P K	200	2,840.00	568,000
萩原電気ホールディングス	400	3,340.00	1,336,000
アズワン	900	8,060.00	7,254,000
スズデン	400	1,628.00	651,200
シモジマ	700	1,104.00	772,800
ドウシシャ	1,200	2,494.00	2,992,800
小津産業	300	2,145.00	643,500
高速	700	1,363.00	954,100
たけびし	400	1,727.00	690,800

リックス	200	2,066.00	413,200
丸文	1,000	908.00	908,000
ハピネット	800	1,410.00	1,128,000
橋本総業ホールディングス	300	1,868.00	560,400
日本ライフライン	3,200	2,666.00	8,531,200
エクセル	500	2,549.00	1,274,500
マルカキカイ	400	2,011.00	804,400
I D O M	3,400	685.00	2,329,000
日本エム・ディ・エム	800	1,133.00	906,400
進和	700	2,570.00	1,799,000
エスケイジャパン	300	487.00	146,100
ダイトロン	500	2,561.00	1,280,500
シークス	1,400	2,192.00	3,068,800
田中商事	400	723.00	289,200
オーハシテクニカ	700	1,853.00	1,297,100
白銅	400	2,356.00	942,400
伊藤忠商事	83,000	2,134.50	177,163,500
丸紅	92,900	876.10	81,389,690
高島	200	2,184.00	436,800
長瀬産業	6,800	1,871.00	12,722,800
蝶理	700	1,923.00	1,346,100
豊田通商	12,600	3,940.00	49,644,000
三共生興	1,900	474.00	900,600
兼松	4,800	1,640.00	7,872,000
ツカモトコーポレーション	200	1,254.00	250,800
三井物産	93,200	1,920.00	178,944,000
日本紙パルプ商事	600	5,190.00	3,114,000
日立ハイテクノロジーズ	3,900	4,740.00	18,486,000
カメイ	1,500	1,738.00	2,607,000
東都水産	200	1,900.00	380,000
O U G ホールディングス	200	2,753.00	550,600
スターゼン	400	6,510.00	2,604,000
山善	4,400	1,167.00	5,134,800
椿本興業	300	4,130.00	1,239,000
住友商事	71,400	1,910.00	136,374,000
内田洋行	500	3,295.00	1,647,500
三菱商事	79,400	3,205.00	254,477,000
第一実業	500	3,450.00	1,725,000
キャノンマーケティングジャパン	3,200	2,339.00	7,484,800
西華産業	700	2,670.00	1,869,000
佐藤商事	1,000	1,228.00	1,228,000
菱洋エレクトロ	1,100	1,811.00	1,992,100

東京産業	1,200	621.00	745,200
ユアサ商事	1,100	3,750.00	4,125,000
神鋼商事	300	3,075.00	922,500
小林産業	800	342.00	273,600
阪和興業	2,100	4,440.00	9,324,000
正栄食品工業	600	3,850.00	2,310,000
カナデン	1,100	1,518.00	1,669,800
菱電商事	800	1,853.00	1,482,400
フルサト工業	600	1,812.00	1,087,200
岩谷産業	2,500	3,930.00	9,825,000
すてきナイスグループ	500	1,357.00	678,500
昭光通商	5,000	109.00	545,000
ニチモウ	200	1,703.00	340,600
極東貿易	1,000	466.00	466,000
イワキ	1,600	436.00	697,600
三愛石油	3,000	1,433.00	4,299,000
稲畑産業	2,700	1,602.00	4,325,400
G S Iクレオス	300	1,630.00	489,000
明和産業	1,100	509.00	559,900
ワキタ	2,400	1,209.00	2,901,600
東邦ホールディングス	3,300	2,762.00	9,114,600
サンゲツ	3,800	2,260.00	8,588,000
ミツウロコグループホールディングス	1,600	882.00	1,411,200
シナネンホールディングス	500	2,810.00	1,405,000
伊藤忠エネクス	2,500	1,105.00	2,762,500
サンリオ	3,200	2,095.00	6,704,000
サンワテクノス	700	1,626.00	1,138,200
リョーサン	1,400	3,810.00	5,334,000
新光商事	1,200	1,785.00	2,142,000
トーヨー	500	2,584.00	1,292,000
三信電気	1,100	1,938.00	2,131,800
東陽テクニカ	1,300	900.00	1,170,000
モスフードサービス	1,500	3,340.00	5,010,000
加賀電子	1,000	2,826.00	2,826,000
ソーダニッカ	1,200	713.00	855,600
立花エレテック	800	2,126.00	1,700,800
フォーバル	500	917.00	458,500
P A L T A C	1,600	6,220.00	9,952,000
三谷産業	1,300	353.00	458,900
太平洋興発	500	989.00	494,500
西本W i s m e t t a cホールディングス	300	5,720.00	1,716,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,502.00	150,200

ヤマタネ	600	2,203.00	1,321,800
丸紅建材リース	1,000	244.00	244,000
日鉄住金物産	900	5,740.00	5,166,000
泉州電業	400	3,405.00	1,362,000
トラスコ中山	2,300	2,871.00	6,603,300
オートバックスセブン	4,500	2,022.00	9,099,000
モリト	900	1,025.00	922,500
加藤産業	1,700	3,905.00	6,638,500
イノテック	1,000	1,419.00	1,419,000
イエローハット	1,100	3,370.00	3,707,000
J Kホールディングス	1,100	887.00	975,700
日伝	900	2,156.00	1,940,400
北沢産業	1,000	269.00	269,000
杉本商事	600	1,994.00	1,196,400
因幡電機産業	1,500	4,805.00	7,207,500
バイテックホールディングス	500	2,413.00	1,206,500
東テク	400	2,709.00	1,083,600
ミスミグループ本社	13,200	3,160.00	41,712,000
アルテック	1,000	324.00	324,000
タキヒヨー	400	2,417.00	966,800
蔵王産業	200	1,723.00	344,600
スズケン	5,100	4,850.00	24,735,000
ジェコス	800	1,047.00	837,600
ルネサスイーストン	1,000	602.00	602,000
ローソン	2,900	6,940.00	20,126,000
サンエー	800	5,710.00	4,568,000
カワチ薬品	900	2,427.00	2,184,300
エービーシー・マート	2,100	6,420.00	13,482,000
ハードオフコーポレーション	500	1,068.00	534,000
アスクル	1,000	3,450.00	3,450,000
ゲオホールディングス	2,100	1,563.00	3,282,300
アダストリア	1,700	1,471.00	2,500,700
ジーフット	700	764.00	534,800
シー・ヴィー・エス・ベイエリア	200	802.00	160,400
くらコーポレーション	700	7,700.00	5,390,000
キャンドウ	500	1,801.00	900,500
パルグループホールディングス	600	2,808.00	1,684,800
エディオン	4,400	1,142.00	5,024,800
サーラコーポレーション	2,000	702.00	1,404,000
ワッツ	400	1,127.00	450,800
ハローズ	400	2,580.00	1,032,000
あみやき亭	300	5,030.00	1,509,000

ひらまつ	1,600	525.00	840,000
大黒天物産	300	5,470.00	1,641,000
ハニーズホールディングス	1,100	1,005.00	1,105,500
ファーマライズホールディングス	300	678.00	203,400
アルペン	900	2,475.00	2,227,500
ハブ	300	1,314.00	394,200
クオール	1,200	2,299.00	2,758,800
ジーンズ	800	6,810.00	5,448,000
ビックカメラ	6,000	1,757.00	10,542,000
D C Mホールディングス	6,000	1,065.00	6,390,000
MonotaRO	4,000	4,835.00	19,340,000
東京一番フーズ	300	681.00	204,300
DDホールディングス	300	2,952.00	885,600
きちり	400	1,049.00	419,600
アークランドサービスホールディングス	900	2,489.00	2,240,100
J.フロント リテイリング	13,500	1,819.00	24,556,500
ドトール・日レスホールディングス	2,000	2,268.00	4,536,000
マツモトキヨシホールディングス	4,700	5,250.00	24,675,000
ブロンコビリー	600	4,660.00	2,796,000
スタートトゥデイ	11,100	4,380.00	48,618,000
トレジャー・ファクトリー	300	760.00	228,000
物語コーポレーション	300	11,220.00	3,366,000
ココカラファイン	1,200	7,480.00	8,976,000
三越伊勢丹ホールディングス	21,200	1,425.00	30,210,000
Hamee	300	1,650.00	495,000
ウエルシアホールディングス	3,000	6,030.00	18,090,000
クリエイティブSDホールディングス	1,700	3,345.00	5,686,500
丸善C H Iホールディングス	1,200	376.00	451,200
ミサワ	300	477.00	143,100
ティーライフ	200	1,376.00	275,200
エー・ピーカンパニー	200	713.00	142,600
チムニー	300	2,928.00	878,400
シュッピン	700	1,589.00	1,112,300
ネクステージ	1,200	1,261.00	1,513,200
ジョイフル本田	1,600	3,770.00	6,032,000
鳥貴族	400	2,742.00	1,096,800
キリン堂ホールディングス	400	2,738.00	1,095,200
ホットランド	700	1,413.00	989,100
すかいらーく	7,000	1,699.00	11,893,000
綿半ホールディングス	400	3,465.00	1,386,000
ヨシックス	200	3,610.00	722,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,700	1,453.00	5,376,100

ブックオフコーポレーション	700	815.00	570,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	400	1,248.00	499,200
B E E N O S	300	1,776.00	532,800
あさひ	900	1,454.00	1,308,600
日本調剤	400	3,000.00	1,200,000
コスモス薬品	600	23,950.00	14,370,000
トーエル	600	961.00	576,600
一六堂	300	411.00	123,300
オンリー	200	965.00	193,000
セブン&アイ・ホールディングス	47,400	4,946.00	234,440,400
薬王堂	500	3,895.00	1,947,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,000	1,607.00	4,821,000
ツルハホールディングス	2,500	16,120.00	40,300,000
サンマルクホールディングス	800	2,887.00	2,309,600
フェリシモ	300	1,382.00	414,600
トリドールホールディングス	1,400	2,917.00	4,083,800
T O K Y O B A S E	1,000	1,034.00	1,034,000
サツドラホールディングス	200	2,387.00	477,400
ダイユー・リックホールディングス	500	1,138.00	569,000
パロックジャパンリミテッド	900	1,063.00	956,700
クスリのアオキホールディングス	900	7,890.00	7,101,000
力の源ホールディングス	200	1,617.00	323,400
スシローグローバルホールディングス	1,200	6,890.00	8,268,000
L I X I L ビバ	1,400	1,864.00	2,609,600
メディカルシステムネットワーク	1,300	512.00	665,600
総合メディカル	1,000	2,448.00	2,448,000
はるやまホールディングス	500	1,047.00	523,500
ノジマ	2,000	2,634.00	5,268,000
カップ・クリエイト	1,400	1,485.00	2,079,000
ライトオン	1,000	1,020.00	1,020,000
ジーンズメイト	400	819.00	327,600
良品計画	1,500	40,500.00	60,750,000
三城ホールディングス	1,400	501.00	701,400
アドヴァン	1,100	958.00	1,053,800
アルビス	400	3,355.00	1,342,000
コナカ	1,400	542.00	758,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,813.00	362,600
G - 7 ホールディングス	300	3,150.00	945,000
イオン北海道	1,100	818.00	899,800
コジマ	1,700	568.00	965,600
ヒマラヤ	400	1,161.00	464,400
コーナン商事	1,600	2,730.00	4,368,000

エコス	500	1,793.00	896,500
ワタミ	1,400	1,457.00	2,039,800
マルシェ	400	818.00	327,200
ドンキホーテホールディングス	7,300	5,810.00	42,413,000
西松屋チェーン	2,500	1,338.00	3,345,000
ゼンショーホールディングス	5,900	2,845.00	16,785,500
幸楽苑ホールディングス	700	1,775.00	1,242,500
ハークスレイ	200	1,102.00	220,400
サイゼリヤ	1,900	2,569.00	4,881,100
V Tホールディングス	3,900	567.00	2,211,300
魚力	300	1,436.00	430,800
ポブラ	300	883.00	264,900
フジ・コーポレーション	200	2,716.00	543,200
ユナイテッドアローズ	1,400	4,105.00	5,747,000
ハイデイ日高	1,500	2,774.00	4,161,000
京都きもの友禅	800	641.00	512,800
コロワイド	3,800	3,070.00	11,666,000
ピーシーデポコーポレーション	1,700	575.00	977,500
壱番屋	800	5,220.00	4,176,000
トップカルチャー	500	420.00	210,000
P L A N T	300	1,323.00	396,900
スギホールディングス	2,500	6,690.00	16,725,000
ヴィア・ホールディングス	1,400	720.00	1,008,000
スクロール	1,800	609.00	1,096,200
ヨンドシーホールディングス	1,100	2,867.00	3,153,700
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,600	12,050.00	43,380,000
木曾路	1,400	2,872.00	4,020,800
S R Sホールディングス	1,400	1,016.00	1,422,400
千趣会	2,100	547.00	1,148,700
タカキュー	900	217.00	195,300
ケーヨー	2,100	559.00	1,173,900
上新電機	1,300	3,880.00	5,044,000
日本瓦斯	2,100	6,310.00	13,251,000
ロイヤルホールディングス	2,000	3,050.00	6,100,000
東天紅	100	1,839.00	183,900
いなげや	1,200	1,889.00	2,266,800
島忠	2,600	3,500.00	9,100,000
チヨダ	1,300	2,649.00	3,443,700
ライフコーポレーション	800	2,818.00	2,254,400
リンガーハット	1,400	2,635.00	3,689,000
さが美グループホールディングス	1,000	149.00	149,000
Mr M a x H D	1,400	695.00	973,000

テンアライド	1,200	481.00	577,200
AOKIホールディングス	2,200	1,674.00	3,682,800
オークワ	2,000	1,132.00	2,264,000
コメリ	1,700	2,896.00	4,923,200
青山商事	2,200	3,960.00	8,712,000
しまむら	1,300	11,590.00	15,067,000
はせがわ	600	494.00	296,400
高島屋	18,000	945.00	17,010,000
松屋	2,300	1,685.00	3,875,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,300	1,842.00	9,762,600
近鉄百貨店	400	4,145.00	1,658,000
パルコ	1,100	1,382.00	1,520,200
丸井グループ	10,800	2,400.00	25,920,000
アクシアル リテイリング	900	4,165.00	3,748,500
イオン	43,500	2,410.50	104,856,750
イズミ	2,000	7,070.00	14,140,000
東武ストア	100	3,100.00	310,000
平和堂	2,300	2,679.00	6,161,700
フジ	1,300	2,335.00	3,035,500
ヤオコー	1,300	6,150.00	7,995,000
ゼビオホールディングス	1,500	1,835.00	2,752,500
ケーズホールディングス	9,900	1,258.00	12,454,200
Olympicグループ	700	621.00	434,700
日産東京販売ホールディングス	1,700	373.00	634,100
Genky DrugStores	500	4,485.00	2,242,500
アインホールディングス	1,500	8,310.00	12,465,000
元気寿司	300	3,505.00	1,051,500
ヤマダ電機	37,900	557.00	21,110,300
アークランドサカモト	1,900	1,684.00	3,199,600
ニトリホールディングス	4,500	19,580.00	88,110,000
愛眼	900	489.00	440,100
ケーユーホールディングス	600	977.00	586,200
吉野家ホールディングス	3,700	2,222.00	8,221,400
松屋フーズ	500	3,750.00	1,875,000
サガミチェーン	1,500	1,429.00	2,143,500
関西スーパーマーケット	900	1,220.00	1,098,000
王将フードサービス	800	6,280.00	5,024,000
プレナス	1,300	1,870.00	2,431,000
ミニストップ	800	2,302.00	1,841,600
アークス	2,100	3,070.00	6,447,000
バローホールディングス	2,600	2,633.00	6,845,800
藤久	100	1,550.00	155,000



ベルク	500	5,980.00	2,990,000	
大庄	600	1,773.00	1,063,800	
ファーストリテイリング	1,500	51,350.00	77,025,000	
サンドラッグ	4,800	4,865.00	23,352,000	
サクスパー ホールディングス	1,100	1,008.00	1,108,800	
ヤマザワ	200	1,840.00	368,000	
やまや	200	3,455.00	691,000	
ペルーナ	2,800	1,511.00	4,230,800	
島根銀行	300	1,260.00	378,000	
じもとホールディングス	7,800	178.00	1,388,400	
めぶきフィナンシャルグループ	58,900	393.00	23,147,700	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,500	2,619.00	3,928,500	
九州フィナンシャルグループ	18,700	543.00	10,154,100	
ゆうちょ銀行	32,000	1,344.00	43,008,000	
富山第一銀行	2,800	502.00	1,405,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	67,700	641.00	43,395,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,200	1,312.00	9,446,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	4,900	878.00	4,302,200	
三十三フィナンシャルグループ	900	2,276.00	2,048,400	
新生銀行	9,800	1,759.00	17,238,200	
あおぞら銀行	6,800	4,395.00	29,886,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	793,200	658.70	522,480,840	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	124,400	653.10	81,245,640	
三井住友トラスト・ホールディングス	22,200	4,615.00	102,453,000	
三井住友フィナンシャルグループ	85,800	4,528.00	388,502,400	代用有価証券 10,000株
第四銀行	1,400	4,770.00	6,678,000	
北越銀行	1,100	2,435.00	2,678,500	
千葉銀行	40,200	865.00	34,773,000	
群馬銀行	23,000	638.00	14,674,000	
武蔵野銀行	1,800	3,625.00	6,525,000	
千葉興業銀行	3,200	508.00	1,625,600	
筑波銀行	4,800	286.00	1,372,800	
七十七銀行	3,500	2,596.00	9,086,000	
青森銀行	900	3,435.00	3,091,500	
秋田銀行	700	3,215.00	2,250,500	
山形銀行	1,300	2,473.00	3,214,900	
岩手銀行	800	4,415.00	3,532,000	
東邦銀行	10,100	426.00	4,302,600	
東北銀行	600	1,406.00	843,600	
みちのく銀行	700	1,772.00	1,240,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	46,000	604.00	27,784,000	

静岡銀行	29,900	1,097.00	32,800,300
十六銀行	1,500	3,050.00	4,575,000
スルガ銀行	11,600	1,056.00	12,249,600
八十二銀行	20,500	505.00	10,352,500
山梨中央銀行	7,000	475.00	3,325,000
大垣共立銀行	1,800	2,932.00	5,277,600
福井銀行	1,000	2,500.00	2,500,000
北國銀行	1,300	4,830.00	6,279,000
清水銀行	400	2,206.00	882,400
富山銀行	200	4,220.00	844,000
滋賀銀行	11,000	596.00	6,556,000
南都銀行	1,300	2,984.00	3,879,200
百五銀行	10,800	471.00	5,086,800
京都銀行	4,300	5,540.00	23,822,000
紀陽銀行	4,300	1,903.00	8,182,900
ほくほくフィナンシャルグループ	7,500	1,621.00	12,157,500
広島銀行	16,700	808.00	13,493,600
山陰合同銀行	6,700	1,043.00	6,988,100
中国銀行	7,800	1,272.00	9,921,600
鳥取銀行	400	1,725.00	690,000
伊予銀行	16,100	796.00	12,815,600
百十四銀行	12,000	380.00	4,560,000
四国銀行	1,700	1,466.00	2,492,200
阿波銀行	9,000	745.00	6,705,000
大分銀行	600	3,915.00	2,349,000
宮崎銀行	800	3,655.00	2,924,000
佐賀銀行	700	2,530.00	1,771,000
十八銀行	7,000	305.00	2,135,000
沖縄銀行	1,100	4,365.00	4,801,500
琉球銀行	2,200	1,739.00	3,825,800
セブン銀行	42,600	348.00	14,824,800
みずほフィナンシャルグループ	1,539,400	191.90	295,410,860
高知銀行	400	1,253.00	501,200
山口フィナンシャルグループ	14,000	1,333.00	18,662,000
長野銀行	400	1,850.00	740,000
名古屋銀行	900	4,070.00	3,663,000
北洋銀行	17,100	389.00	6,651,900
愛知銀行	400	5,310.00	2,124,000
中京銀行	500	2,344.00	1,172,000
大光銀行	400	2,285.00	914,000
愛媛銀行	1,600	1,290.00	2,064,000
トマト銀行	400	1,565.00	626,000

京葉銀行	10,000	501.00	5,010,000
栃木銀行	5,900	412.00	2,430,800
北日本銀行	400	2,805.00	1,122,000
東和銀行	2,000	1,222.00	2,444,000
福島銀行	1,100	752.00	827,200
大東銀行	500	1,320.00	660,000
トモニホールディングス	9,400	508.00	4,775,200
フィデアホールディングス	11,000	174.00	1,914,000
池田泉州ホールディングス	12,000	395.00	4,740,000
F P G	3,600	1,526.00	5,493,600
マーキュリアインベストメント	300	1,146.00	343,800
S B Iホールディングス	12,800	3,040.00	38,912,000
ジャフコ	1,600	4,780.00	7,648,000
大和証券グループ本社	96,900	648.90	62,878,410
野村ホールディングス	194,800	566.20	110,295,760
岡三証券グループ	10,000	564.00	5,640,000
丸三証券	3,600	1,018.00	3,664,800
東洋証券	4,000	262.00	1,048,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12,600	743.00	9,361,800
光世証券	300	1,371.00	411,300
水戸証券	3,300	403.00	1,329,900
いちよし証券	2,400	1,267.00	3,040,800
松井証券	5,500	1,056.00	5,808,000
だいこう証券ビジネス	600	593.00	355,800
マネックスグループ	11,600	595.00	6,902,000
カブドットコム証券	7,200	385.00	2,772,000
極東証券	1,500	1,492.00	2,238,000
岩井コスモホールディングス	1,200	1,473.00	1,767,600
藍澤證券	2,100	801.00	1,682,100
マネーパートナーズグループ	1,500	434.00	651,000
かんぽ生命保険	4,300	2,459.00	10,573,700
S O M P Oホールディングス	22,200	4,613.00	102,408,600
アニコム ホールディングス	800	4,405.00	3,524,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	29,600	3,559.00	105,346,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	9,300	2,130.00	19,809,000
第一生命ホールディングス	64,100	2,070.00	132,687,000
東京海上ホールディングス	42,700	5,574.00	238,009,800
アドバンテッジリスクマネジメント	400	1,201.00	480,400
T & Dホールディングス	35,100	1,757.50	61,688,250
アドバンスクリエイト	300	2,165.00	649,500
全国保証	3,200	5,190.00	16,608,000
ジェイリース	200	696.00	139,200

イントラスト	200	836.00	167,200
アルヒ	1,300	2,245.00	2,918,500
クレディセゾン	8,600	1,774.00	15,256,400
芙蓉総合リース	1,300	7,920.00	10,296,000
興銀リース	2,100	3,005.00	6,310,500
東京センチュリー	2,300	6,570.00	15,111,000
日本証券金融	4,600	632.00	2,907,200
アイフル	19,300	353.00	6,812,900
リコーリース	900	3,725.00	3,352,500
イオンフィナンシャルサービス	8,000	2,513.00	20,104,000
アコム	22,900	438.00	10,030,200
ジャックス	1,400	2,437.00	3,411,800
オリエントコーポレーション	25,300	154.00	3,896,200
日立キャピタル	3,100	2,920.00	9,052,000
アプラスフィナンシャル	6,200	110.00	682,000
オリックス	75,500	1,863.00	140,656,500
三菱UFJリース	28,700	709.00	20,348,300
九州リースサービス	500	777.00	388,500
日本取引所グループ	32,500	2,179.00	70,817,500
イー・ギャランティ	600	2,275.00	1,365,000
アサックス	200	1,994.00	398,800
NECキャピタルソリューション	500	2,020.00	1,010,000
いちご	16,300	539.00	8,785,700
日本駐車場開発	13,900	183.00	2,543,700
ヒューリック	23,700	1,194.00	28,297,800
三栄建築設計	500	1,924.00	962,000
スター・マイカ	600	2,376.00	1,425,600
野村不動産ホールディングス	7,600	2,548.00	19,364,800
三重交通グループホールディングス	2,400	509.00	1,221,600
サムティ	1,000	2,275.00	2,275,000
ディア・ライフ	1,300	521.00	677,300
コーセーアールイー	300	858.00	257,400
エー・ディー・ワークス	16,100	40.00	644,000
日本商業開発	700	1,950.00	1,365,000
プレサンスコーポレーション	1,600	1,801.00	2,881,600
ユニゾホールディングス	1,600	2,178.00	3,484,800
THEグローバル社	600	872.00	523,200
日本管理センター	800	1,377.00	1,101,600
サンセイランディック	400	1,225.00	490,000
エストラスト	200	940.00	188,000
フージャースホールディングス	2,800	821.00	2,298,800
オープンハウス	1,800	6,830.00	12,294,000

東急不動産ホールディングス	27,500	801.00	22,027,500
飯田グループホールディングス	9,400	2,185.00	20,539,000
イーランド	200	1,200.00	240,000
ムゲンエステート	700	1,174.00	821,800
ファーストブラザーズ	300	1,465.00	439,500
ハウスドゥ	200	5,230.00	1,046,000
シーアールイー	200	2,069.00	413,800
ケイアイスター不動産	400	2,660.00	1,064,000
パーク24	6,600	2,994.00	19,760,400
パラカ	300	2,525.00	757,500
三井不動産	56,600	2,742.50	155,225,500
三菱地所	84,400	2,043.00	172,429,200
平和不動産	2,000	2,242.00	4,484,000
東京建物	12,400	1,544.00	19,145,600
ダイビル	2,900	1,163.00	3,372,700
京阪神ビルディング	1,900	1,000.00	1,900,000
住友不動産	27,000	4,280.00	115,560,000
大京	1,800	2,503.00	4,505,400
テーオーシー	3,900	852.00	3,322,800
東京楽天地	200	5,850.00	1,170,000
レオパレス21	13,500	668.00	9,018,000
スターツコーポレーション	1,500	2,748.00	4,122,000
フジ住宅	1,500	987.00	1,480,500
空港施設	1,100	635.00	698,500
明和地所	700	696.00	487,200
ゴールドクレスト	900	1,909.00	1,718,100
日本エスリード	500	2,006.00	1,003,000
日神不動産	1,500	724.00	1,086,000
日本エスコン	2,100	676.00	1,419,600
タカラレーベン	5,400	420.00	2,268,000
サンヨーハウジング名古屋	700	1,226.00	858,200
イオンモール	7,300	2,076.00	15,154,800
ファースト住建	400	1,506.00	602,400
カチタス	1,500	4,525.00	6,787,500
トーセイ	1,400	1,373.00	1,922,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,100	1,221.00	8,669,100
サンフロンティア不動産	1,400	1,345.00	1,883,000
エフ・ジェー・ネクスト	900	1,081.00	972,900
インテリックス	400	1,016.00	406,400
ランドビジネス	700	342.00	239,400
グランディハウス	1,100	513.00	564,300
日本空港ビルデング	3,300	5,620.00	18,546,000

日本工営	700	3,090.00	2,163,000
L I F U L L	3,800	739.00	2,808,200
ジェイエイシーリクルートメント	900	2,193.00	1,973,700
日本M&Aセンター	7,600	3,530.00	26,828,000
メンバーズ	400	1,265.00	506,000
中広	100	800.00	80,000
タケエイ	1,200	1,214.00	1,456,800
トラスト・テック	500	3,935.00	1,967,500
コシダカホールディングス	2,900	1,681.00	4,874,900
パソナグループ	1,000	1,757.00	1,757,000
C D S	300	1,445.00	433,500
リンクアンドモチベーション	2,000	1,426.00	2,852,000
G C A	1,300	923.00	1,199,900
エス・エム・エス	2,200	4,260.00	9,372,000
パーソルホールディングス	10,100	2,468.00	24,926,800
リニカル	700	2,238.00	1,566,600
クックパッド	3,500	572.00	2,002,000
エスクリ	400	852.00	340,800
アイ・ケイ・ケイ	600	828.00	496,800
学情	500	1,649.00	824,500
スタジオアリス	600	2,634.00	1,580,400
シミックホールディングス	600	2,343.00	1,405,800
N J S	300	1,823.00	546,900
総合警備保障	4,400	5,290.00	23,276,000
カカクコム	8,300	2,540.00	21,082,000
アイロムグループ	400	2,062.00	824,800
セントケア・ホールディング	500	725.00	362,500
サイネックス	200	843.00	168,600
ルネサンス	600	2,453.00	1,471,800
ディップ	1,500	2,832.00	4,248,000
オプトホールディング	800	2,233.00	1,786,400
新日本科学	1,400	514.00	719,600
ツクイ	2,600	936.00	2,433,600
キャリアデザインセンター	300	2,136.00	640,800
エムスリー	11,600	4,645.00	53,882,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	650.00	585,000
プラス	100	836.00	83,600
アウトソーシング	3,300	2,139.00	7,058,700
ウェルネット	1,100	1,206.00	1,326,600
ワールドホールディングス	400	3,455.00	1,382,000
ディー・エヌ・エー	5,900	2,134.00	12,590,600
博報堂D Yホールディングス	15,200	1,820.00	27,664,000

ぐるなび	1,700	954.00	1,621,800
エスアールジータカミヤ	1,300	705.00	916,500
ジャパンベストレスキューシステム	900	936.00	842,400
ファンコミュニケーションズ	3,100	752.00	2,331,200
ライク	400	2,056.00	822,400
ビジネス・ブレイクスルー	500	450.00	225,000
WDBホールディングス	500	3,240.00	1,620,000
ティア	500	1,086.00	543,000
CDG	100	1,696.00	169,600
バリューコマース	1,000	1,473.00	1,473,000
インフォマート	5,600	1,553.00	8,696,800
J Pホールディングス	3,500	396.00	1,386,000
エコナックホールディングス	2,300	130.00	299,000
E P Sホールディングス	1,700	2,465.00	4,190,500
レグス	300	1,063.00	318,900
プレステージ・インターナショナル	2,300	1,626.00	3,739,800
アミューズ	700	3,055.00	2,138,500
ドリームインキュベータ	400	2,394.00	957,600
クイック	700	1,853.00	1,297,100
T A C	800	343.00	274,400
ケネディクス	14,600	685.00	10,001,000
電通	13,400	5,260.00	70,484,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,742.00	871,000
ぴあ	400	6,420.00	2,568,000
イオンファンタジー	300	6,890.00	2,067,000
シーティーエス	1,100	1,140.00	1,254,000
みらかホールディングス	3,300	3,265.00	10,774,500
アルプス技研	1,000	2,462.00	2,462,000
ダイオーズ	200	1,329.00	265,800
日本空調サービス	1,100	809.00	889,900
オリエンタルランド	13,000	11,960.00	155,480,000
ダスキン	2,900	2,786.00	8,079,400
明光ネットワークジャパン	1,400	1,270.00	1,778,000
ファルコホールディングス	600	1,899.00	1,139,400
秀英予備校	200	490.00	98,000
田谷	200	693.00	138,600
ラウンドワン	3,400	1,845.00	6,273,000
リゾートトラスト	4,600	2,064.00	9,494,400
ビー・エム・エル	1,400	2,919.00	4,086,600
ワタベウェディング	200	549.00	109,800
りらいあコミュニケーションズ	1,700	1,637.00	2,782,900
リソー教育	1,900	826.00	1,569,400

早稲田アカデミー	200	2,473.00	494,600
ユー・エス・エス	13,400	2,149.00	28,796,600
東京個別指導学院	400	1,001.00	400,400
サイバーエージェント	6,800	6,630.00	45,084,000
楽天	56,300	727.60	40,963,880
クリーク・アンド・リバー社	600	1,183.00	709,800
テー・オー・ダブリュー	1,100	884.00	972,400
セントラルスポーツ	400	4,065.00	1,626,000
フルキャストホールディングス	1,000	2,825.00	2,825,000
リソルホールディングス	100	4,435.00	443,500
テクノプロ・ホールディングス	2,100	7,280.00	15,288,000
アトラ	200	739.00	147,800
インターワークス	300	998.00	299,400
Keeper 技研	400	1,365.00	546,000
ファーストロジック	200	775.00	155,000
三機サービス	200	1,813.00	362,600
Gunosy	700	1,520.00	1,064,000
デザインワン・ジャパン	200	1,300.00	260,000
イー・ガーディアン	500	3,355.00	1,677,500
リブセンス	800	543.00	434,400
ジャパンマテリアル	3,000	1,800.00	5,400,000
ベクトル	1,300	2,315.00	3,009,500
ウチヤマホールディングス	600	574.00	344,400
ライクキッズネクスト	200	1,400.00	280,000
キャリアリンク	400	558.00	223,200
I B J	900	694.00	624,600
アサンテ	400	2,174.00	869,600
N・フィールド	600	1,700.00	1,020,000
バリューHR	300	2,044.00	613,200
M&Aキャピタルパートナーズ	300	10,640.00	3,192,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,470.00	735,000
E R Iホールディングス	400	1,066.00	426,400
アビスト	100	4,750.00	475,000
シグマクシス	600	1,328.00	796,800
ウィルグループ	500	1,121.00	560,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,500	485.00	727,500
日本ビューホテル	300	1,458.00	437,400
リクルートホールディングス	84,700	3,182.00	269,515,400
エラン	300	2,796.00	838,800
土木管理総合試験所	400	578.00	231,200
日本郵政	62,200	1,243.00	77,314,600
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,932.00	3,477,600



鎌倉新書	200	3,310.00	662,000
一蔵	100	829.00	82,900
LITALICO	200	1,984.00	396,800
グローバルグループ	100	1,789.00	178,900
エボラブルアジア	300	2,458.00	737,400
ストライク	300	4,140.00	1,242,000
ソラスト	700	3,575.00	2,502,500
セラク	200	913.00	182,600
インソース	400	2,481.00	992,400
キャリアインデックス	100	3,315.00	331,500
MS - Japan	100	7,420.00	742,000
船場	200	1,200.00	240,000
フルテック	100	1,185.00	118,500
グリーンズ	200	1,616.00	323,200
日総工産	200	6,140.00	1,228,000
キュービーネットホールディングス	500	1,845.00	922,500
リログループ	6,000	2,946.00	17,676,000
東祥	700	4,240.00	2,968,000
エイチ・アイ・エス	1,700	3,630.00	6,171,000
ラックランド	200	2,680.00	536,000
共立メンテナンス	2,000	6,220.00	12,440,000
イチネンホールディングス	1,200	1,444.00	1,732,800
建設技術研究所	800	1,429.00	1,143,200
スペース	700	1,484.00	1,038,800
長大	400	952.00	380,800
燦ホールディングス	300	2,620.00	786,000
スバル興業	100	6,540.00	654,000
東京テアトル	500	1,447.00	723,500
タナベ経営	200	2,007.00	401,400
ナガワ	200	4,800.00	960,000
よみうりランド	200	4,765.00	953,000
東京都競馬	800	4,735.00	3,788,000
常磐興産	500	1,862.00	931,000
カナモト	1,700	3,565.00	6,060,500
東京ドーム	4,400	996.00	4,382,400
西尾レントオール	1,100	3,640.00	4,004,000
トランス・コスモス	1,200	2,687.00	3,224,400
乃村工藝社	2,600	2,494.00	6,484,400
藤田観光	400	3,475.00	1,390,000
KNT - CTホールディングス	700	1,638.00	1,146,600
日本管財	1,200	2,299.00	2,758,800
トーカイ	1,100	2,409.00	2,649,900

白洋舎	100	3,510.00	351,000
セコム	11,600	8,270.00	95,932,000
セントラル警備保障	500	4,720.00	2,360,000
丹青社	2,200	1,520.00	3,344,000
メイテック	1,300	5,060.00	6,578,000
応用地質	1,200	1,495.00	1,794,000
船井総研ホールディングス	2,300	2,692.00	6,191,600
進学会ホールディングス	500	638.00	319,000
オオバ	900	638.00	574,200
いであ	200	1,132.00	226,400
学究社	400	1,852.00	740,800
ベネッセホールディングス	4,000	4,160.00	16,640,000
イオンディライト	1,300	3,975.00	5,167,500
ナック	800	948.00	758,400
ニチイ学館	2,100	1,301.00	2,732,100
ダイセキ	1,800	3,370.00	6,066,000
ステップ	400	1,741.00	696,400
合計	13,921,550		29,378,927,370

## (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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	141,765,615	159,657,617
金銭信託	-	183,442,522
コール・ローン	532,009,290	603,732,341
出資金	4,825,541	9,470,936
株式	80,802,641,422	83,290,218,642
投資証券	2,136,383,305	2,004,307,821
派生商品評価勘定	3,446,775	17,244,932
未収入金	1,753,950	308,033,458
未収配当金	104,483,754	147,595,040

	平成29年12月15日現在	平成30年 6月15日現在
差入委託証拠金	164,617,401	250,780,495
流動資産合計	83,891,927,053	86,974,483,804
資産合計	83,891,927,053	86,974,483,804
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,629,710	3,738,600
未払金	710,050	39,297,459
未払解約金	159,604,702	113,589,413
未払利息	564	1,121
流動負債合計	163,945,026	156,626,593
負債合計	163,945,026	156,626,593
純資産の部		
元本等		
元本	34,737,542,175	35,040,030,859
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	48,990,439,852	51,777,826,352
元本等合計	83,727,982,027	86,817,857,211
純資産合計	83,727,982,027	86,817,857,211
負債純資産合計	83,891,927,053	86,974,483,804

## 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12月15日現在	平成30年 6月15日現在
1.	期首	平成29年 6月16日	平成29年12月16日
	期首元本額	35,916,198,740円	34,737,542,175円
	期首からの追加設定元本額	1,340,722,546円	1,812,623,363円
	期首からの一部解約元本額	2,519,379,111円	1,510,134,679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）	15,341,110,697円	16,261,917,916円
	DCインデックスバランス（株式20）	59,271,749円	68,196,784円
	DCインデックスバランス（株式40）	182,927,791円	206,253,545円
	DCインデックスバランス（株式60）	364,928,622円	404,363,396円
	DCインデックスバランス（株式80）	398,671,235円	438,542,994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	2,331,055,446円	2,184,327,321円
	日興五大陸株式ファンド	5,733,044,024円	5,613,415,788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	26,036,112円	24,989,051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）	178,147,361円	117,634,832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	155,261,740円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,765,242円	5,478,360円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,372,091円	4,409,027円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,666,068円	6,844,796円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	6,998,761円	6,831,913円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,416,928,354円	4,931,323,073円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	26,962,321円	27,035,485円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	79,458,114円	79,004,392円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	117,483,060円	117,766,701円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	117,911,528円	117,319,787円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,225,788,913円	4,269,113,958円
	計	34,737,542,175円	35,040,030,859円
2.	受益権の総数	34,737,542,175口	35,040,030,859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29年 6月16日 至 平成29年12月15日	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15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12月15日現在	平成30年 6月15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12月15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	437,443
株式	1,994,758,479
投資証券	72,797,332
合計	2,067,993,254

(平成30年 6月15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	2,274,329
株式	5,120,526,663
投資証券	24,222,662
合計	5,098,578,330

(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12月15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	766,565,560	-	764,950,320	1,615,240
合計		766,565,560	-	764,950,320	1,615,240

(平成30年 6月15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	1,448,066,345	-	1,455,460,320	7,393,975

合計	1,448,066,345	-	1,455,460,320	7,393,975
----	---------------	---	---------------	-----------

## (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12月15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	505,037,195	-	506,469,500	1,432,305
	米ドル	419,033,370	-	420,287,500	1,254,130
	ユーロ	86,003,825	-	86,182,000	178,175
合計		505,037,195	-	506,469,500	1,432,305

(平成30年 6月15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	785,953,243	-	792,065,600	6,112,357
	米ドル	543,744,340	-	552,224,500	8,480,160
	ユーロ	207,013,215	-	204,647,500	2,365,715
	英ポンド	35,195,688	-	35,193,600	2,088
合計		785,953,243	-	792,065,600	6,112,357

## (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12月15日現在		平成30年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.4103円	1口当たり純資産額	2.4777円
(1万口当たり純資産額)	(24,103円)	(1万口当たり純資産額)	(24,777円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	11,203	71.04	795,861.12	
	ANDEAVOR	3,000	139.02	417,060.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,560	19.76	90,105.60	
	APACHE CORP	7,904	42.89	339,002.56	
	BAKER HUGHES A GE CO	8,105	33.68	272,976.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	23.61	229,725.30	
	CHENIERE ENERGY INC	4,070	64.93	264,265.10	
	CHEVRON CORP	39,541	126.51	5,002,331.91	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	86.55	173,532.75	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	127.25	388,748.75	
	CONOCOPHILLIPS	24,740	68.13	1,685,536.20	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	64.26	125,949.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	11,251	41.71	469,279.21	



DIAMONDBACK ENERGY INC	2,210	115.95	256,249.50
EOG RESOURCES INC	12,022	117.53	1,412,945.66
EQT CORP	5,765	56.16	323,762.40
EXXON MOBIL CORP	87,591	81.89	7,172,826.99
HALLIBURTON CO	18,077	47.73	862,815.21
HELMERICH & PAYNE	2,120	64.97	137,736.40
HESS CORP	6,000	60.97	365,820.00
HOLLYFRONTIER CORP	3,740	72.96	272,870.40
KINDER MORGAN INC	40,700	16.95	689,865.00
MARATHON OIL CORP	17,867	21.12	377,351.04
MARATHON PETROLEUM CORP	10,032	75.19	754,306.08
NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,521	42.16	317,085.36
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	29.20	117,968.00
NOBLE ENERGY INC	10,672	34.57	368,931.04
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,731	84.35	1,326,909.85
ONEOK INC	8,790	69.34	609,498.60
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,490	27.72	124,462.80
PHILLIPS 66	9,045	115.55	1,045,149.75
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,420	191.45	654,759.00
SCHLUMBERGER LTD	28,731	68.33	1,963,189.23
TARGA RESOURCES CORP	4,560	48.52	221,251.20
TECHNIPFMC PLC	9,351	32.16	300,728.16
VALERO ENERGY CORP	8,992	116.82	1,050,445.44
WILLIAMS COS INC	16,874	27.21	459,141.54
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,535	165.72	751,540.20
ALBEMARLE CORP	2,320	93.66	217,291.20
AVERY DENNISON CORP	1,820	106.27	193,411.40
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	31.20	130,104.00
BALL CORP	6,840	36.88	252,259.20
CELANESE CORP-SERIES A	2,700	115.10	310,770.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	44.92	217,862.00
CHEMOURS CO/THE	3,600	49.78	179,208.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	44.97	126,590.55
DOWDUPONT INC	48,257	68.38	3,299,813.66
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	107.93	325,408.95
ECOLAB INC	5,220	145.40	758,988.00
FMC CORP	2,790	90.30	251,937.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	27,868	17.58	489,919.44
INTERNATIONAL PAPER CO	8,020	56.84	455,856.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	124.51	207,184.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,750	114.15	770,512.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	230.20	286,599.00

MOSAIC CO/THE	6,820	29.48	201,053.60
NEWMONT MINING CORP	11,050	39.16	432,718.00
NUCOR CORP	6,569	68.53	450,173.57
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	120.78	235,521.00
PPG INDUSTRIES INC	5,124	103.96	532,691.04
PRAXAIR INC	5,920	161.55	956,376.00
SEALED AIR CORP	3,966	44.07	174,781.62
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,707	401.20	684,848.40
STEEL DYNAMICS INC	4,510	49.01	221,035.10
VULCAN MATERIALS CO	2,713	131.86	357,736.18
WESTLAKE CHEMICAL CORP	790	112.29	88,709.10
WESTROCK CO	5,239	60.50	316,959.50
3M CO	12,316	203.63	2,507,907.08
ACUITY BRANDS INC	890	120.77	107,485.30
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	54.55	145,103.00
AGCO CORP	1,250	61.69	77,112.50
ALLEGION PLC	2,080	81.79	170,123.20
AMETEK INC	4,763	74.84	356,462.92
ARCONIC INC	8,783	18.00	158,094.00
BOEING CO/THE	11,542	362.42	4,183,051.64
CATERPILLAR INC	12,356	153.14	1,892,197.84
CUMMINS INC	3,195	141.89	453,338.55
DEERE & CO	6,240	150.18	937,123.20
DOVER CORP	3,150	76.06	239,589.00
EATON CORP PLC	9,026	79.28	715,581.28
EMERSON ELECTRIC CO	12,970	72.90	945,513.00
FASTENAL CO	5,753	52.79	303,700.87
FLOWSERVE CORP	2,575	41.54	106,965.50
FLUOR CORP	2,903	48.89	141,927.67
FORTIVE CORP	6,364	80.13	509,947.32
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	56.80	179,488.00
GENERAL DYNAMICS CORP	5,182	195.82	1,014,739.24
GENERAL ELECTRIC CO	179,493	13.64	2,448,284.52
HARRIS CORP	2,410	149.95	361,379.50
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	43.29	161,904.60
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,596	151.20	2,358,115.20
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	219.95	211,152.00
IDEX CORP	1,570	143.67	225,561.90
ILLINOIS TOOL WORKS	6,320	148.89	940,984.80
INGERSOLL-RAND PLC	5,096	91.91	468,373.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,420	65.35	158,147.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,370	62.74	274,173.80

JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	37.00	166,500.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18,864	34.89	658,164.96
L3 TECHNOLOGIES INC	1,651	197.76	326,501.76
LENNOX INTERNATIONAL INC	770	211.52	162,870.40
LOCKHEED MARTIN CORP	5,341	310.59	1,658,861.19
MASCO CORP	6,439	38.42	247,386.38
MIDDLEBY CORP	1,180	106.17	125,280.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,384	322.56	1,091,543.04
OWENS CORNING	2,170	65.20	141,484.00
PACCAR INC	7,014	63.76	447,212.64
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	171.91	474,471.60
PENTAIR PLC	3,498	43.78	153,142.44
RAYTHEON COMPANY	6,002	202.68	1,216,485.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	178.94	480,096.02
ROCKWELL COLLINS INC.	3,373	137.88	465,069.24
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,260	283.21	640,054.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,460	53.82	186,217.20
SMITH (A.O.) CORP	3,020	63.97	193,189.40
SNAP-ON INC	1,160	159.48	184,996.80
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,310	88.28	203,926.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	142.29	443,375.64
TEXTRON INC	5,416	67.49	365,525.84
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	344.17	378,587.00
UNITED RENTALS INC	1,720	164.46	282,871.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,715	126.94	1,994,862.10
WABCO HOLDINGS INC	1,110	122.97	136,496.70
WABTEC CORP	1,880	102.01	191,778.80
WW GRAINGER INC	1,107	317.39	351,350.73
XYLEM INC	3,548	71.73	254,498.04
CINTAS CORP	1,857	191.56	355,726.92
COPART INC	4,260	58.08	247,420.80
COSTAR GROUP INC	755	409.70	309,323.50
EQUIFAX INC	2,404	125.34	301,317.36
IHS MARKIT LTD	7,933	50.76	402,679.08
MANPOWERGROUP INC	1,447	93.07	134,672.29
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	31.53	233,479.65
REPUBLIC SERVICES INC	4,590	69.23	317,765.70
ROBERT HALF INTL INC	2,375	69.93	166,083.75
ROLLINS INC	2,000	52.27	104,540.00
STERICYCLE INC	1,705	64.21	109,478.05
TRANSUNION	4,100	71.28	292,248.00
VERISK ANALYTICS INC	3,170	109.97	348,604.90

WASTE CONNECTIONS INC	5,246	76.35	400,532.10
WASTE MANAGEMENT INC	8,864	83.57	740,764.48
AMERCO	155	352.09	54,573.95
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,270	43.08	97,791.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	90.43	262,247.00
CSX CORP	17,833	65.89	1,175,016.37
DELTA AIR LINES INC	3,615	54.90	198,463.50
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	76.77	279,980.19
FEDEX CORP	5,288	263.48	1,393,282.24
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,820	129.65	235,963.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	108.66	234,705.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	41.81	114,977.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,860	153.47	899,334.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,190	160.28	190,733.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,890	51.94	150,106.60
UNION PACIFIC CORP	16,306	144.94	2,363,391.64
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	73.02	125,229.30
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,247	117.19	1,669,605.93
XPO LOGISTICS INC	2,450	111.66	273,567.00
APTIV PLC	5,900	102.61	605,399.00
AUTOLIV INC	1,770	159.12	281,642.40
BORGWARNER INC	4,330	48.82	211,390.60
FORD MOTOR COMPANY	78,845	11.89	937,467.05
GENERAL MOTORS CORP	26,215	43.57	1,142,187.55
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	25.10	136,293.00
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	44.20	163,937.80
LEAR CORP	1,370	202.69	277,685.30
TESLA INC	2,720	357.72	972,998.40
DR HORTON INC	7,256	43.08	312,588.48
GARMIN LTD	2,395	61.94	148,346.30
HANESBRANDS INC	7,940	20.17	160,149.80
HASBRO INC	2,288	91.61	209,603.68
LEGGETT & PLATT INC	2,778	44.25	122,926.50
LENNAR CORP-CL A	5,820	53.07	308,867.40
LULULEMON ATHLETICA INC	2,010	125.88	253,018.80
MATTEL INC	7,349	17.92	131,694.08
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,970	65.85	195,574.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	214.11	282,196.98
NEWELL BRANDS INC	10,026	26.39	264,586.14
NIKE INC -CL B	26,698	74.70	1,994,340.60
NVR INC	70	3,114.64	218,024.80
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	129.30	160,332.00

PULTE GROUP INC	5,660	30.80	174,328.00
PVH CORP	1,600	160.24	256,384.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	139.09	162,039.85
TAPESTRY INC	5,696	45.53	259,338.88
TOLL BROTHERS INC	3,321	39.05	129,685.05
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	23.47	83,553.20
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	21.73	89,353.76
VF CORP	6,840	84.03	574,765.20
WHIRLPOOL CORP	1,414	155.47	219,834.58
ARAMARK	4,960	39.76	197,209.60
CARNIVAL CORP	8,647	64.20	555,137.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	485	460.44	223,313.40
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	92.19	235,361.07
DOMINO'S PIZZA INC	940	273.65	257,231.00
H&R BLOCK INC	4,510	23.77	107,202.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,670	82.93	470,213.10
LAS VEGAS SANDS CORP	8,100	80.60	652,860.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,373	138.75	884,253.75
MCDONALD'S CORP	16,461	167.05	2,749,810.05
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	5,100	29.80	151,980.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	11,570	31.43	363,645.10
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,910	54.45	267,349.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	113.50	401,563.00
STARBUCKS CORP	29,264	57.02	1,668,633.28
VAIL RESORTS INC	840	281.08	236,107.20
WYNN RESORTS LTD	2,030	176.25	357,787.50
YUM! BRANDS INC	7,324	83.38	610,675.12
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,068	55.12	389,588.16
CHARTER COMMUNICATION-A	3,451	295.61	1,020,150.11
COMCAST CORP-CLASS A	95,984	33.82	3,246,178.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	25.50	84,660.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,490	24.15	156,733.50
DISH NETWORK CORP-A	4,769	34.08	162,527.52
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,836	23.58	184,772.88
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	76.50	163,710.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,085	29.45	90,853.25
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	28.76	354,351.96
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,890	33.38	129,848.20
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,580	46.58	166,756.40
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	46.37	91,580.75
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,760	46.55	128,478.00
NEWS CORP - CLASS A	7,570	16.02	121,271.40

OMNICOM GROUP	4,577	75.37	344,968.49
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	7.38	252,765.00
THE WALT DISNEY CO.	31,203	108.75	3,393,326.25
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,599	44.42	426,387.58
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	21,392	44.58	953,655.36
VIACOM INC-CLASS B	7,248	28.91	209,539.68
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,508	133.50	201,318.00
AMAZON.COM INC	8,505	1,723.86	14,661,429.30
AUTOZONE INC	552	682.99	377,010.48
BEST BUY CO INC	5,564	73.32	407,952.48
BOOKING HOLDINGS INC	998	2,123.06	2,118,813.88
CARMAX INC	3,679	73.22	269,376.38
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,570	96.33	536,558.10
DOLLAR TREE INC	4,896	88.34	432,512.64
EXPEDIA INC	2,552	123.58	315,376.16
GAP INC/THE	5,106	31.33	159,970.98
GENUINE PARTS CO	2,961	94.07	278,541.27
HOME DEPOT INC	24,180	199.67	4,828,020.60
KOHL'S CORP	3,292	73.28	241,237.76
L BRANDS INC	4,858	35.99	174,839.42
LKQ CORP	6,330	33.15	209,839.50
LOWE'S COS INC	17,242	99.16	1,709,716.72
MACY'S INC	6,469	37.56	242,975.64
NETFLIX INC	8,970	392.87	3,524,043.90
NORDSTROM INC	2,540	49.87	126,669.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,775	281.89	500,354.75
QURATE RETAIL INC	8,930	21.45	191,548.50
ROSS STORES INC	7,862	84.50	664,339.00
TARGET CORP	10,600	77.22	818,532.00
TIFFANY & CO	2,610	135.67	354,098.70
TJX COMPANIES INC	12,853	94.56	1,215,379.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	74.32	204,380.00
TRIPADVISOR INC	2,330	57.73	134,510.90
ULTA BEAUTY INC	1,240	246.60	305,784.00
COSTCO WHOLESALE CORP	9,059	205.12	1,858,182.08
KROGER CO	17,720	26.16	463,555.20
SYSCO CORP	10,066	66.48	669,187.68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,322	64.87	1,188,548.14
WALMART INC	30,532	83.79	2,558,276.28
ALTRIA GROUP INC	39,388	56.70	2,233,299.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,343	45.24	513,157.32
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,280	52.94	279,523.20

BUNGE LTD	2,857	70.55	201,561.35
CAMPBELL SOUP CO	3,485	36.51	127,237.35
COCA-COLA CO/THE	83,812	43.58	3,652,526.96
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,220	39.50	166,690.00
CONAGRA BRANDS INC	8,610	38.20	328,902.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,530	232.18	819,595.40
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,769	120.63	454,654.47
GENERAL MILLS INC	11,439	44.51	509,149.89
HERSHEY CO/THE	3,015	92.14	277,802.10
HORMEL FOODS CORP	5,960	36.11	215,215.60
INGREDION INC	1,470	113.13	166,301.10
JM SMUCKER CO/THE	2,250	103.75	233,437.50
KELLOGG CO	5,408	66.60	360,172.80
KRAFT HEINZ CO/THE	12,411	60.67	752,975.37
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,465	105.86	260,944.90
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,870	66.72	258,206.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	30,725	40.40	1,241,290.00
MONSTER BEVERAGE CORP	9,160	56.05	513,418.00
PEPSICO INC	29,271	105.13	3,077,260.23
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,108	80.85	2,595,931.80
TYSON FOODS INC-CL A	6,166	70.99	437,724.34
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,200	49.80	258,960.00
CLOROX COMPANY	2,616	127.89	334,560.24
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,060	63.31	1,080,068.60
COTY INC-CL A	10,000	14.26	142,600.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,600	156.37	719,302.00
KIMBERLY-CLARK CORP	7,293	102.04	744,177.72
PROCTER & GAMBLE CO	52,049	75.99	3,955,203.51
ABBOTT LABORATORIES	36,046	62.96	2,269,456.16
ABIOMED INC	860	440.65	378,959.00
AETNA INC	6,779	188.09	1,275,062.11
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,560	366.27	571,381.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,254	93.35	303,760.90
ANTHEM INC	5,306	241.74	1,282,672.44
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,029	75.41	831,696.89
BECTON DICKINSON AND CO	5,537	232.82	1,289,124.34
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,218	32.51	917,367.18
CARDINAL HEALTH INC	6,565	54.62	358,580.30
CENTENE CORP	4,130	123.50	510,055.00
CERNER CORP	6,230	61.08	380,528.40
CIGNA CORP	5,010	175.33	878,403.30
COOPER COS INC/THE	1,040	235.15	244,556.00

CVS HEALTH CORP	21,087	69.12	1,457,533.44
DANAHER CORP	13,049	102.64	1,339,349.36
DAVITA INC	2,978	71.04	211,557.12
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	44.89	217,806.28
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	151.56	668,379.60
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11,634	82.24	956,780.16
HCA HEALTHCARE INC	5,815	106.01	616,448.15
HENRY SCHEIN INC	3,340	72.88	243,419.20
HOLOGIC INC	5,708	40.23	229,632.84
HUMANA INC	2,945	304.43	896,546.35
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	226.08	413,726.40
INTUITIVE SURGICAL INC	2,310	495.52	1,144,651.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	187.88	404,881.40
MCKESSON CORP	4,324	150.00	648,600.00
MEDTRONIC PLC	28,008	86.57	2,424,652.56
QUEST DIAGNOSTICS	2,876	110.94	319,063.44
RESMED INC	2,950	106.76	314,942.00
STRYKER CORP	7,013	168.75	1,183,443.75
TELEFLEX INC	900	284.16	255,744.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,020	255.33	5,111,706.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	114.59	207,407.90
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	123.31	237,248.44
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	2,450	83.03	203,423.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	114.88	478,130.56
ABBVIE INC	31,366	98.75	3,097,392.50
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,620	66.31	438,972.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,540	120.16	545,526.40
ALKERMES PLC	3,220	50.14	161,450.80
ALLERGAN PLC	6,745	173.95	1,173,292.75
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,800	107.06	192,708.00
AMGEN INC	13,941	185.79	2,590,098.39
BIOGEN INC	4,403	305.68	1,345,909.04
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	89.98	314,930.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33,851	53.63	1,815,429.13
CELGENE CORP	16,084	78.39	1,260,824.76
ELI LILLY & CO	20,473	86.35	1,767,843.55
GILEAD SCIENCES INC	27,094	71.15	1,927,738.10
ILLUMINA INC	3,025	290.16	877,734.00
INCYTE CORP	3,700	73.64	272,468.00
IQVIA HOLDINGS INC	3,533	103.16	364,464.28
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,180	177.23	209,131.40
JOHNSON & JOHNSON	55,511	122.41	6,795,101.51



MERCK & CO. INC.	55,743	61.56	3,431,539.08
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	540	592.70	320,058.00
MYLAN NV	10,965	39.51	433,227.15
NEKTAR THERAPEUTICS	3,290	56.41	185,588.90
PERRIGO CO PLC	2,559	74.83	191,489.97
PFIZER INC	123,260	36.16	4,457,081.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	315.67	511,385.40
SEATTLE GENETICS INC	2,280	65.49	149,317.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	18,720	23.78	445,161.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,344	216.55	1,806,893.20
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	114.17	107,319.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,200	154.99	805,948.00
WATERS CORP	1,666	200.27	333,649.82
ZOETIS INC	9,960	88.15	877,974.00
BANK OF AMERICA CORP	201,289	29.50	5,938,025.50
BB&T CORP	16,118	52.44	845,227.92
CIT GROUP INC	2,655	51.34	136,307.70
CITIGROUP INC	53,017	66.16	3,507,604.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,080	41.40	417,312.00
COMERICA INC	3,570	95.18	339,792.60
EAST WEST BANCORP INC	3,000	70.18	210,540.00
FIFTH THIRD BANCORP	14,459	30.84	445,915.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,220	100.06	322,193.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	15.42	336,001.80
JPMORGAN CHASE & CO	70,940	108.03	7,663,648.20
KEYCORP	22,078	20.53	453,261.34
M & T BANK CORP	3,153	174.71	550,860.63
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	11.54	111,407.16
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	7,100	18.79	133,409.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,750	141.84	1,382,940.00
REGIONS FINANCIAL CORP	23,184	18.62	431,686.08
SIGNATURE BANK	1,130	126.06	142,447.80
SUNTRUST BANKS INC	9,747	68.89	671,470.83
SVB FINANCIAL GROUP	1,090	316.49	344,974.10
US BANCORP	32,321	50.93	1,646,108.53
WELLS FARGO & CO	96,710	54.74	5,293,905.40
ZIONS BANCORPORATION	4,120	55.45	228,454.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	155.51	171,061.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	26.34	240,220.80
AMERICAN EXPRESS CO	15,224	99.76	1,518,746.24
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,060	147.65	451,809.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,992	56.80	1,192,345.60

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,380	192.50	5,078,150.00
BLACKROCK INC	2,495	523.36	1,305,783.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,795	96.28	943,062.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,120	103.81	220,077.20
CME GROUP INC	6,970	168.86	1,176,954.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,280	75.20	547,456.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,300	64.84	343,652.00
EATON VANCE CORP	2,260	54.89	124,051.40
FRANKLIN RESOURCES INC	6,635	33.15	219,950.25
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,428	233.65	1,735,552.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,990	74.52	893,494.80
INVESCO LTD	8,467	27.21	230,387.07
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	22.51	145,977.35
MOODY'S CORP	3,527	175.93	620,505.11
MORGAN STANLEY	28,005	51.31	1,436,936.55
MSCI INC	1,800	172.35	310,230.00
NASDAQ INC	2,185	94.77	207,072.45
NORTHERN TRUST CORP	4,420	106.95	472,719.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,690	98.45	264,830.50
S&P GLOBAL INC	5,152	207.29	1,067,958.08
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,094	56.61	1,420,571.34
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	65.71	178,402.65
STATE STREET CORP	7,617	98.26	748,446.42
SYNCHRONY FINANCIAL	15,730	35.26	554,639.80
T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	123.66	609,025.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,600	59.99	335,944.00
VOYA FINANCIAL INC	3,700	51.70	191,290.00
AFLAC INC	16,044	45.68	732,889.92
ALLEGHANY CORP	330	581.61	191,931.30
ALLSTATE CORP	7,253	92.80	673,078.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,490	109.77	163,557.30
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	19,075	54.80	1,045,310.00
AON PLC	5,197	140.21	728,671.37
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	81.13	225,135.75
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,730	65.98	246,105.40
ASSURANT INC	1,110	95.76	106,293.60
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,700	46.59	172,383.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,485	56.65	84,125.25
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,774	45.26	80,291.24
CHUBB LTD	9,575	130.10	1,245,707.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,190	68.92	219,854.80
EVEREST RE GROUP LTD	874	226.00	197,524.00

FNF GROUP	5,241	38.21	200,258.61
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,282	53.08	386,528.56
LINCOLN NATIONAL CORP	4,513	68.05	307,109.65
LOEWS CORP	5,785	49.61	286,993.85
MARKEL CORP	320	1,099.90	351,968.00
MARSH & MCLENNAN COS	10,383	81.94	850,783.02
METLIFE INC	18,535	46.77	866,881.95
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,000	56.26	337,560.00
PROGRESSIVE CORP	12,140	61.89	751,344.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,552	98.75	844,510.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	143.49	187,971.90
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	123.95	109,943.65
TORCHMARK CORP	2,216	84.20	186,587.20
TRAVELERS COS INC/THE	5,654	128.86	728,574.44
UNUM GROUP	4,788	38.83	185,918.04
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,878	156.04	449,083.12
WR BERKLEY CORP	2,063	75.28	155,302.64
XL GROUP LTD	5,190	56.20	291,678.00
CBRE GROUP INC - A	6,310	48.30	304,773.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	7.40	175,380.00
JONES LANG LASALLE INC	890	170.50	151,745.00
ACCENTURE PLC-CL A	12,798	162.76	2,083,002.48
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,600	77.71	1,134,566.00
ADOBE SYSTEMS INC	10,159	258.10	2,622,037.90
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	80.86	298,373.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,010	226.47	228,734.70
ALPHABET INC-CL A	6,170	1,160.11	7,157,878.70
ALPHABET INC-CL C	6,512	1,152.12	7,502,605.44
ANSYS INC	1,820	176.92	321,994.40
AUTODESK INC	4,630	138.41	640,838.30
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,226	139.82	1,289,979.32
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	114.89	278,033.80
CA INC	6,270	37.06	232,366.20
CADENCE DESIGN SYS INC	5,760	44.94	258,854.40
CDK GLOBAL INC	2,510	65.86	165,308.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,710	99.94	270,837.40
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	106.82	344,814.96
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,078	78.55	948,726.90
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	87.91	379,771.20
DXC TECHNOLOGY CO	5,903	84.45	498,508.35
EBAY INC	20,147	39.00	785,733.00
ELECTRONIC ARTS INC	6,294	144.39	908,790.66

FACEBOOK INC-A	49,560	196.81	9,753,903.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,745	107.72	726,571.40
FIRST DATA CORP- CLASS-A	9,680	21.61	209,184.80
FISERV INC	8,256	76.43	631,006.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,850	205.53	380,230.50
FORTINET INC	3,100	65.74	203,794.00
GARTNER INC	2,050	137.29	281,444.50
GLOBAL PAYMENTS INC	3,620	117.75	426,255.00
GODADDY INC-CLASS A	2,850	73.55	209,617.50
IAC/INTERACTIVECORP	1,650	162.26	267,729.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	18,992	145.20	2,757,638.40
INTUIT INC	4,966	209.08	1,038,291.28
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,530	131.09	200,567.70
LEIDOS HOLDINGS INC	2,900	60.75	176,175.00
MASTERCARD INC	19,340	199.31	3,854,655.40
MERCADOLIBRE INC	870	305.00	265,350.00
MICROSOFT CORP	151,184	101.42	15,333,081.28
ORACLE CORP	64,333	45.90	2,952,884.70
PAYCHEX INC	6,562	69.34	455,009.08
PAYPAL HOLDINGS INC	23,567	85.61	2,017,570.87
RED HAT INC	3,600	175.90	633,240.00
SABRE CORP	4,520	26.41	119,373.20
SALESFORCE.COM INC	14,240	138.41	1,970,958.40
SERVICENOW INC	3,780	185.34	700,585.20
SPLUNK INC	2,830	119.50	338,185.00
SQUARE INC - A	5,470	63.88	349,423.60
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,830	53.02	256,086.60
SYMANTEC CORP	13,055	21.36	278,854.80
SYNOPSYS INC	3,207	90.87	291,420.09
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	2,350	121.84	286,324.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,366	87.14	293,313.24
TWITTER INC	12,970	46.76	606,477.20
VERISIGN INC	1,810	141.22	255,608.20
VISA INC-CLASS A SHARES	37,342	135.00	5,041,170.00
VMWARE INC	1,555	150.25	233,638.75
WESTERN UNION CO	9,241	20.66	190,919.06
WORKDAY INC-CLASS A	2,810	128.20	360,242.00
WORLDPAY INC-CLASS A	5,980	84.31	504,173.80
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	65.09	130,180.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,750	91.20	615,600.00
APPLE INC	104,912	190.80	20,017,209.60
ARISTA NETWORKS INC	970	281.12	272,686.40

ARROW ELECTRONICS INC	1,930	79.10	152,663.00
AVNET INC	2,610	40.18	104,869.80
CDW CORP/DE	3,500	83.84	293,440.00
CISCO SYSTEMS INC	99,420	44.69	4,443,079.80
COGNEX CORP	3,400	45.78	155,652.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,030	30.27	121,988.10
CORNING INC	18,388	28.89	531,229.32
F5 NETWORKS INC	1,335	181.64	242,489.40
FLEX LTD	10,936	14.01	153,213.36
FLIR SYSTEMS INC	2,675	54.30	145,252.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	32,915	15.82	520,715.30
HP INC	34,005	23.80	809,319.00
IPG PHOTONICS CORP	730	241.16	176,046.80
JUNIPER NETWORKS INC	7,933	27.82	220,696.06
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,830	61.22	234,472.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,385	113.90	385,551.50
NETAPP INC	5,236	77.50	405,790.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	215.56	409,564.00
SEAGATE TECHNOLOGY	5,684	59.08	335,810.72
TE CONNECTIVITY LTD	7,185	99.31	713,542.35
TRIMBLE INC	5,170	35.40	183,018.00
WESTERN DIGITAL CORP	6,058	82.55	500,087.90
XEROX CORP	4,938	27.74	136,980.12
AT&T INC	127,007	32.52	4,130,267.64
CENTURYLINK INC	19,626	18.01	353,464.26
SPRINT CORP	17,350	5.46	94,731.00
T-MOBILE US INC	7,192	59.53	428,139.76
VERIZON COMMUNICATIONS INC	85,337	47.82	4,080,815.34
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,700	36.56	135,272.00
AES CORP	13,728	13.18	180,935.04
ALLIANT ENERGY CORP	4,740	39.62	187,798.80
AMEREN CORPORATION	4,942	56.37	278,580.54
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,008	64.62	646,716.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,655	79.78	291,595.90
ATMOS ENERGY CORP	2,190	85.68	187,639.20
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	26.18	213,157.56
CMS ENERGY CORP	5,770	43.62	251,687.40
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	73.25	461,914.50
DOMINION RESOURCES INC/VA	13,867	65.52	908,565.84
DTE ENERGY COMPANY	3,698	97.05	358,890.90
DUKE ENERGY CORP	14,576	73.46	1,070,752.96
EDISON INTERNATIONAL	6,589	60.20	396,657.80

ENERGY CORP	3,847	76.71	295,103.37	
EVERGY INC	5,580	51.95	289,881.00	
EVERSOURCE ENERGY	6,300	53.99	340,137.00	
EXELON CORP	20,896	41.07	858,198.72	
FIRSTENERGY CORP	8,995	34.27	308,258.65	
NEXTERA ENERGY INC	9,765	158.82	1,550,877.30	
NISOURCE INC	6,540	23.99	156,894.60	
OGE ENERGY CORP	3,830	34.56	132,364.80	
P G & E CORP	10,491	39.89	418,485.99	
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	75.41	165,826.59	
PPL CORP	15,728	27.07	425,756.96	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,188	52.22	532,017.36	
SCANA CORP	2,683	36.90	99,002.70	
SEMPRA ENERGY	5,377	113.32	609,321.64	
SOUTHERN CO	20,475	44.21	905,199.75	
UGI CORP	3,500	49.25	172,375.00	
VISTRA ENERGY CORP	7,920	24.01	190,159.20	
WEC ENERGY GROUP INC	6,320	59.86	378,315.20	
XCEL ENERGY INC	10,414	42.87	446,448.18	
ADVANCED MICRO DEVICES	19,050	16.25	309,562.50	
ANALOG DEVICES INC	7,630	101.70	775,971.00	
APPLIED MATERIALS INC	21,753	49.69	1,080,906.57	
BROADCOM INC	8,460	268.46	2,271,171.60	
INTEL CORP	96,672	55.54	5,369,162.88	
KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	113.13	361,902.87	
LAM RESEARCH CORP	3,357	181.17	608,187.69	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,004	21.76	174,167.04	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	61.43	359,365.50	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,904	102.57	503,003.28	
MICRON TECHNOLOGY INC	23,947	59.18	1,417,183.46	
NVIDIA CORP	11,875	266.91	3,169,556.25	
NXP SEMICONDUCTORS NV	7,297	113.01	824,633.97	
ON SEMICONDUCTOR CORP	8,730	25.89	226,019.70	
QORVO INC	2,670	83.65	223,345.50	
QUALCOMM INC	30,612	59.46	1,820,189.52	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,810	101.97	388,505.70	
TEXAS INSTRUMENTS INC	20,332	114.72	2,332,487.04	
XILINX INC	5,075	70.43	357,432.25	
米ドル小計	6,297,843		501,373,631.10 (55,492,033,490)	
加ドル				
ALTAGAS LTD	3,850	26.15	100,677.50	
ARC RESOURCES LTD	7,925	13.21	104,689.25	

CAMECO CORP	7,892	15.85	125,088.20
CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,574	41.99	1,031,862.26
CENOVUS ENERGY INC	20,853	12.38	258,160.14
CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	9.78	112,225.50
ENBRIDGE INC	34,757	42.69	1,483,776.33
ENCANA CORP	21,068	16.60	349,728.80
HUSKY ENERGY INC	6,873	19.77	135,879.21
IMPERIAL OIL LTD	5,952	43.16	256,888.32
INTER PIPELINE LTD	7,180	24.56	176,340.80
KEYERA CORP	4,270	36.08	154,061.60
PEMBINA PIPELINE CORP	10,212	45.25	462,093.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	26.24	107,584.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	14.81	65,608.30
SUNCOR ENERGY INC	34,059	52.14	1,775,836.26
TOURMALINE OIL CORP	4,575	24.12	110,349.00
TRANSCANADA CORP	17,673	54.53	963,708.69
VERMILION ENERGY INC	2,640	45.85	121,044.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	60.96	286,207.20
BARRICK GOLD CORP	23,944	17.25	413,034.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	66.02	201,361.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	21.95	322,884.50
FRANCO-NEVADA CORP	3,805	91.29	347,358.45
GOLDCORP INC	17,917	18.74	335,764.58
KINROSS GOLD CORP	25,015	4.97	124,324.55
LUNDIN MINING CORP	12,280	8.35	102,538.00
METHANEX CORP	1,650	89.57	147,790.50
NUTRIEN LTD	13,198	70.31	927,951.38
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	37.43	447,475.65
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	3.75	87,821.25
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	86.13	125,749.80
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	29.16	273,958.20
BOMBARDIER INC 'B'	40,026	4.89	195,727.14
CAE INC	5,615	27.49	154,356.35
FINNING INTERNATIONAL INC	3,545	33.94	120,317.30
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,605	59.61	214,894.05
WSP GLOBAL INC	2,100	73.83	155,043.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,318	109.43	1,676,248.74
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,915	254.42	741,634.30
LINAMAR CORP	980	63.73	62,455.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,018	85.74	601,723.32
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	37.85	171,839.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,638	78.79	365,428.02

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,935	27.66	247,142.10
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,290	173.08	223,273.20
DOLLARAMA INC	2,180	151.71	330,727.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,800	54.79	482,152.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	24.56	73,680.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,269	65.78	280,814.82
METRO INC	4,380	43.94	192,457.20
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	103.92	122,833.44
SAPUTO INC	4,730	43.53	205,896.90
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	35.07	236,161.38
BANK OF MONTREAL	13,291	101.84	1,353,555.44
BANK OF NOVA SCOTIA	24,909	75.98	1,892,585.82
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,955	115.20	1,031,616.00
NATIONAL BANK OF CANADA	6,740	63.77	429,809.80
ROYAL BANK OF CANADA	29,849	99.85	2,980,422.65
TORONTO-DOMINION BANK	38,210	76.20	2,911,602.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,133	55.03	942,828.99
CI FINANCIAL CORP	5,700	24.96	142,272.00
IGM FINANCIAL INC	1,945	39.76	77,333.20
ONEX CORPORATION	1,725	92.73	159,959.25
THOMSON REUTERS CORP	5,534	53.73	297,341.82
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	590	760.14	448,482.60
GREAT-WEST LIFECO INC	5,974	33.35	199,232.90
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,225	52.50	116,812.50
INTACT FINANCIAL CORP	2,885	95.10	274,363.50
MANULIFE FINANCIAL CORP	40,561	24.87	1,008,752.07
POWER CORP OF CANADA	7,800	30.63	238,914.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	32.26	184,365.90
SUN LIFE FINANCIAL INC	12,574	54.72	688,049.28
FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	21.08	69,985.60
BLACKBERRY LTD	10,328	16.00	165,248.00
CGI GROUP INC - CL A	4,940	81.40	402,116.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	1,049.99	440,995.80
OPEN TEXT CORP	5,390	47.10	253,869.00
SHOPIFY INC - CLASS-A	1,700	220.21	374,357.00
BCE INC	2,930	54.31	159,128.30
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	61.94	445,038.90
TELUS CORP	4,366	46.23	201,840.18
ATCO LTD -CLASS I	1,920	39.22	75,302.40
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	31.43	81,403.70
EMERA INC	1,270	40.23	51,092.10
FORTIS INC	8,665	40.60	351,799.00



	HYDRO ONE LTD	6,290	19.51	122,717.90
加ドル小計		830,280		37,467,819.28 (3,159,661,199)
ユーロ	ENAGAS SA	4,790	24.52	117,450.80
	ENI SPA	51,366	15.81	812,301.92
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	10,915	16.18	176,604.70
	NESTE OYJ	2,740	67.00	183,580.00
	OMV AG	2,950	50.58	149,211.00
	REPSOL SA	28,019	17.22	482,487.18
	SNAM SPA	46,120	3.61	166,631.56
	TENARIS SA	9,355	15.77	147,528.35
	TOTAL SA	49,557	52.86	2,619,583.02
	VOPAK	1,270	41.70	52,959.00
	AIR LIQUIDE SA	8,919	112.10	999,819.90
	AKZO NOBEL	5,058	76.36	386,228.88
	ARCELORMITTAL	13,632	29.04	395,941.44
	ARKEMA	1,335	103.90	138,706.50
	BASF SE	19,055	88.07	1,678,173.85
	COVESTRO AG	4,320	77.60	335,232.00
	CRH PLC	17,110	32.62	558,128.20
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	30.98	110,908.40
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	46.40	79,808.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,095	77.72	240,543.40
	IMERYS SA	830	71.40	59,262.00
	K+S AG	3,880	22.92	88,929.60
	KONINKLIJKE DSM NV	3,842	90.18	346,471.56
	LANXESS AG	1,935	72.26	139,823.10
	LINDE AG	3,855	184.25	710,283.75
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	4,600	34.72	159,712.00
	SOLVAY SA	1,581	113.40	179,285.40
	STORA ENSO OYJ-R SHS	11,535	17.74	204,688.57
	SYMRISE AG	2,640	75.14	198,369.60
	THYSSENKRUPP AG	8,755	23.69	207,405.95
	UMICORE	4,240	51.00	216,240.00
	UPM-KYMMENE OYJ	11,058	31.85	352,197.30
	VOESTALPINE AG	2,509	44.74	112,252.66
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,086	36.80	223,964.80
	AIRBUS GROUP SE	12,068	104.56	1,261,830.08
	ALSTOM	3,220	40.26	129,637.20
	ANDRITZ AG	1,420	43.94	62,394.80
	BOUYGUES SA	4,210	38.87	163,642.70
	BRENTAG AG	3,095	50.44	156,111.80

CNH INDUSTRIAL NV	21,030	10.12	212,928.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,106	41.50	419,449.53
DASSAULT AVIATION SA	50	1,704.00	85,200.00
EIFFAGE	1,580	96.36	152,248.80
FERROVIAL SA	9,975	18.43	183,839.25
GEA GROUP AG	3,940	32.03	126,198.20
HOCHTIEF AG	440	160.20	70,488.00
KION GROUP AG	1,400	72.52	101,528.00
KONE OYJ-B	6,984	44.57	311,276.88
LEGRAND SA	5,628	64.96	365,594.88
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	8.99	73,153.74
MAN SE	824	93.15	76,755.60
METSO OYJ	2,420	31.00	75,020.00
MTU AERO ENGINES AG	1,110	166.60	184,926.00
OSRAM LICHT AG	2,002	51.90	103,903.80
PRYSMIAN SPA	4,255	25.70	109,353.50
REXEL SA	6,250	13.36	83,500.00
SAFRAN SA	6,810	104.15	709,261.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,448	75.70	866,613.60
SIEMENS AG-REG	15,796	120.70	1,906,577.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	13.15	54,967.00
THALES SA	2,165	110.70	239,665.50
VINCI SA	10,390	85.80	891,462.00
WARTSILA OYJ ABP	8,820	17.55	154,835.10
BUREAU VERITAS SA	5,650	23.38	132,097.00
EDENRED	4,646	27.43	127,439.78
RANDSTAD NV	2,285	53.46	122,156.10
RELX NV	19,429	18.26	354,870.68
SOCIETE BIC SA	565	79.90	45,143.50
TELEPERFORMANCE	1,120	139.80	156,576.00
WOLTERS KLUWER	6,297	48.16	303,263.52
ADP	650	194.60	126,490.00
AENA SA	1,380	160.05	220,869.00
ATLANTIA SPA	10,860	25.16	273,237.60
BOLLORE	20,400	4.16	85,027.20
DEUTCHE LUFTHANSA	4,950	23.84	118,008.00
DEUTSCHE POST AG-REG	20,143	30.36	611,541.48
FRAPORT AG	980	85.00	83,300.00
GETLINK	8,760	12.19	106,784.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	8.19	105,012.18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,645	86.27	573,264.15
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	74.45	88,595.50

CONTINENTAL AG	2,235	220.50	492,817.50
DAIMLER AG	18,742	63.19	1,184,306.98
FAURECIA	1,630	72.02	117,392.60
FERRARI NV	2,554	127.20	324,868.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	22,237	18.23	405,558.40
MICHELIN (CGDE)-B	3,459	110.50	382,219.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,565	34.78	89,210.70
PEUGEOT SA	11,700	21.32	249,444.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	63.12	198,828.00
RENAULT SA	3,867	84.83	328,037.61
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	13.00	46,167.75
VALEO SA	4,860	53.34	259,232.40
VOLKSWAGEN AG	631	163.00	102,853.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	163.34	629,349.02
ADIDAS AG	3,831	198.75	761,411.25
HERMES INTERNATIONAL	637	551.40	351,241.80
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	80.02	98,424.60
KERING	1,557	514.60	801,232.20
LUXOTTICA GROUP SPA	3,486	55.56	193,682.16
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,784	302.55	1,749,949.20
MONCLER SPA	3,650	42.18	153,957.00
PUMA SE	219	505.00	110,595.00
SEB SA	480	152.70	73,296.00
ACCOR SA	3,926	44.66	175,335.16
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,150	98.00	210,700.00
SODEXO	1,880	85.72	161,153.60
AXEL SPRINGER SE	995	61.60	61,292.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	17.70	67,171.50
JC DECAUX SA	1,580	27.94	44,145.20
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	24.25	116,521.25
PUBLICIS GROUPE	4,275	59.38	253,849.50
RTL GROUP	860	65.55	56,373.00
SES	7,520	15.60	117,349.60
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	41.44	51,385.60
VIVENDI	21,300	21.90	466,470.00
INDITEX	22,045	30.03	662,011.35
ZALANDO SE	2,160	47.62	102,859.20
CARREFOUR SA	12,213	15.53	189,667.89
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	34.30	46,099.20
COLRUYT SA	1,375	45.96	63,195.00
JERONIMO MARTINS	5,075	13.37	67,852.75
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26,448	20.43	540,464.88

METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	11.40	47,196.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15,831	84.03	1,330,278.93
DANONE	12,354	64.99	802,886.46
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	10,800	6.92	74,790.00
HEINEKEN HOLDING NV	2,255	85.00	191,675.00
HEINEKEN NV	5,293	88.02	465,889.86
KERRY GROUP PLC-A	3,330	89.35	297,535.50
PERNOD-RICARD SA	4,406	144.90	638,429.40
REMY COINTREAU	470	126.50	59,455.00
BEIERSDORF AG	2,015	99.36	200,210.40
HENKEL AG & CO KGAA	2,200	98.35	216,370.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,563	110.10	392,286.30
L'OREAL	5,236	211.10	1,105,319.60
UNILEVER NV-CVA	31,775	46.66	1,482,621.50
BIOMERIEUX	750	81.90	61,425.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,215	121.15	510,647.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,523	88.48	400,195.04
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,605	70.94	610,438.70
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,211	36.95	709,942.50
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	730	133.00	97,090.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,400	35.88	122,009.00
BAYER AG - RTS	17,070	1.71	29,223.84
BAYER AG-REG	17,070	100.80	1,720,656.00
EUROFINS SCIENTIFIC	220	419.00	92,180.00
GRIFOLS SA	6,260	27.61	172,838.60
IPSEN	780	137.10	106,938.00
MERCK KGAA	2,630	84.14	221,288.20
ORION OYJ-CLASS B	1,830	24.42	44,688.60
QIAGEN N.V.	4,364	32.21	140,564.44
RECORDATI SPA	2,530	33.30	84,249.00
SANOFI	23,266	67.33	1,566,499.78
UCB SA	2,588	66.40	171,843.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,570	23.02	197,281.40
AIB GROUP PLC	15,300	4.96	75,888.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	138,753	6.09	845,560.78
BANCO DE SABADELL SA	133,052	1.46	195,453.38
BANCO SANTANDER SA	333,969	4.78	1,598,542.61
BANK OF IRELAND GROUP PLC	18,619	7.05	131,263.95
BANKIA SA	23,750	3.38	80,465.00
BANKINTER SA	13,960	8.67	121,144.88
BNP PARIBAS	23,242	54.84	1,274,591.28
CAIXABANK S.A	81,100	3.85	312,802.70

COMMERZBANK AG	21,334	9.29	198,342.19
CREDIT AGRICOLE SA	23,362	12.05	281,512.10
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	36.29	233,635.02
ING GROEP NV-CVA	80,205	12.72	1,020,368.01
INTESA SANPAOLO	275,553	2.59	714,784.48
INTESA SANPAOLO-RSP	20,000	2.69	53,800.00
KBC GROEP NV	5,119	66.94	342,665.86
MEDIOBANCA SPA	12,760	8.16	104,198.16
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	28.00	77,560.00
SOCIETE GENERALE	15,729	37.46	589,208.34
UNICREDIT SPA	41,136	14.52	597,294.72
AMUNDI SA	1,140	63.30	72,162.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42,465	9.65	410,084.50
DEUTSCHE BOERSE AG	4,000	116.40	465,600.00
EURAZEO SE	1,055	67.15	70,843.25
EXOR NV	2,264	61.82	139,960.48
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,632	93.90	153,244.80
NATIXIS	19,150	6.39	122,368.50
WENDEL	600	125.40	75,240.00
AEGON NV	38,139	5.43	207,094.77
AGEAS	4,044	44.17	178,623.48
ALLIANZ SE-REG	9,188	183.06	1,681,955.28
ASSICURAZIONI GENERALI	25,628	14.73	377,628.58
AXA	39,542	21.83	863,399.57
CNP ASSURANCES	3,530	19.77	69,788.10
HANNOVER RUECK SE-REG	1,275	111.90	142,672.50
MAPFRE SA	20,814	2.58	53,762.56
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,216	185.60	596,889.60
NN GROUP NV	6,340	36.89	233,882.60
POSTE ITALIANE SPA	10,260	7.82	80,233.20
SAMPO OYJ-A SHS	9,109	42.26	384,946.34
SCOR SE	3,562	32.32	115,123.84
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	41.27	309,525.00
VONOVIA SE	10,248	41.50	425,292.00
AMADEUS IT GROUP SA	8,910	72.24	643,658.40
ATOS SE	1,920	123.25	236,640.00
CAP GEMINI SA	3,279	118.00	386,922.00
DASSAULT SYSTEMES SA	2,620	123.95	324,749.00
DELIVERY HERO AG	1,880	41.00	77,080.00
SAP SE	20,292	104.30	2,116,455.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,920	99.74	191,500.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,400	58.08	139,392.00

	WIRECARD AG	2,440	156.30	381,372.00
	INGENICO GROUP	1,160	76.48	88,716.80
	NOKIA OYJ	119,986	5.23	628,486.66
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	68,656	13.85	950,885.60
	DRILLISCH AG	980	64.45	63,161.00
	ELISA OYJ	3,045	39.26	119,546.70
	ILIAD SA	520	141.95	73,814.00
	KONINKLIJKE KPN NV	65,606	2.41	158,176.06
	ORANGE S.A.	41,574	14.64	608,643.36
	PROXIMUS	3,040	21.77	66,180.80
	TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.68	159,510.85
	TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.59	75,507.02
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,270	3.67	59,743.44
	TELEFONICA SA	95,499	7.54	720,921.95
	E.ON SE	44,659	9.27	414,078.24
	EDF	11,785	11.55	136,116.75
	ENDESA SA	6,840	19.50	133,414.20
	ENEL SPA	173,657	4.87	846,230.56
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	3.40	186,969.40
	ENGIE	37,224	13.89	517,227.48
	FORTUM OYJ	8,865	20.30	179,959.50
	GAS NATURAL SDG SA	7,722	21.79	168,262.38
	IBERDROLA SA	117,842	6.66	784,827.72
	INNOGY SE	2,850	36.80	104,880.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	17.89	161,233.95
	RWE AG	10,685	20.06	214,341.10
	SUEZ	7,629	11.55	88,114.95
	TERNA SPA	35,697	4.65	166,205.23
	UNIPER SE-NEW	3,820	21.40	81,748.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	12,624	19.51	246,294.24
	ASML HOLDING NV	8,512	185.60	1,579,827.20
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	23,445	25.49	597,613.05
	STMICROELECTRONICS NV	15,063	22.64	341,026.32
ユーロ小計		4,078,802		84,218,505.26 (10,771,546,822)
英ポンド	BP PLC	411,568	5.85	2,409,730.64
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	95,228	26.07	2,483,070.10
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	77,629	27.10	2,104,134.04
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	13,000	6.42	83,460.00
	ANGLO AMERICAN PLC	21,904	17.93	392,826.33
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	10.65	92,974.50
	BHP BILLITON PLC	42,721	17.48	747,104.84

CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	49.61	136,477.11
FRESNILLO PLC	4,710	12.06	56,802.60
GLENCORE PLC	238,063	3.98	948,681.05
JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	38.23	160,527.77
MONDI PLC	7,400	20.87	154,438.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	59.44	109,369.60
RIO TINTO PLC	24,875	44.02	1,094,997.50
ASHTREAD GROUP PLC	9,930	23.84	236,731.20
BAE SYSTEMS PLC ORD	65,595	6.50	426,892.26
BUNZL PLC	7,276	23.50	170,986.00
DCC PLC	1,810	72.50	131,225.00
FERGUSON PLC	4,882	61.28	299,168.96
MEGGITT PLC	16,205	5.01	81,284.28
MELROSE INDUSTRIES PLC	100,000	2.40	240,500.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,045	8.82	291,721.26
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT-C	2,346,195	0.00	2,346.19
SMITHS GROUP PLC	8,233	18.01	148,276.33
TRAVIS PERKINS PLC	5,250	14.31	75,153.75
WEIR GROUP PLC/THE	4,490	20.70	92,943.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	8.56	53,739.10
EXPERIAN PLC	18,678	18.82	351,519.96
G4S PLC	34,639	2.79	96,816.00
INTERTEK GROUP PLC	3,365	58.30	196,179.50
RELX PLC	21,976	16.09	353,703.72
EASYJET PLC	3,840	17.96	68,966.40
ROYAL MAIL PLC	19,950	5.05	100,787.40
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,690	5.62	116,277.80
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	41.99	109,174.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	21.63	192,593.52
PERSIMMON PLC	6,170	27.27	168,255.90
TAYLOR WIMPEY PLC	66,880	1.88	125,801.28
CARNIVAL PLC	3,850	47.74	183,799.00
COMPASS GROUP PLC	32,678	16.15	527,749.70
GVC HOLDINGS PLC	11,000	10.35	113,850.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,859	49.44	190,788.96
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.82	59,525.40
TUI AG-DI	9,213	17.64	162,563.38
WHITBREAD PLC	3,820	41.71	159,332.20
INFORMA PLC	25,000	8.34	208,650.00
ITV PLC	77,235	1.74	134,890.92
PEARSON PLC	17,749	8.83	156,759.16
SKY PLC	21,334	13.50	288,009.00

WPP PLC	25,954	12.30	319,234.20
KINGFISHER PLC	45,257	3.14	142,333.26
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	3.07	107,357.90
NEXT PLC	2,987	61.94	185,014.78
SAINSBURY (J) PLC	32,441	3.14	102,091.82
TESCO PLC	196,154	2.49	489,992.69
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.46	121,265.81
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	27.51	201,785.85
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	47,407	37.34	1,770,414.41
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,550	26.30	93,365.00
DIAGEO PLC	51,072	27.73	1,416,481.92
IMPERIAL BRANDS PLC	19,242	26.08	501,831.36
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,595	61.50	836,092.50
UNILEVER PLC	25,637	40.33	1,034,068.39
CONVATEC GROUP PLC	27,730	2.27	63,196.67
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	5.64	39,494.00
NMC HEALTH PLC	2,120	36.84	78,100.80
SMITH & NEPHEW PLC	18,346	13.62	249,964.25
ASTRAZENECA PLC	25,953	54.48	1,413,919.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	101,941	15.80	1,610,871.68
SHIRE PLC	18,565	40.69	755,502.67
BARCLAYS PLC	349,341	2.00	700,778.04
HSBC HOLDINGS PLC	413,591	7.34	3,038,239.48
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,475,366	0.63	931,398.55
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	95,080	2.63	250,630.88
STANDARD CHARTERED PLC	58,190	7.30	425,310.71
3I GROUP PLC	20,499	9.79	200,808.20
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	20.88	119,433.60
INVESTEC PLC	13,185	5.71	75,286.35
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	44.90	295,307.30
SCHRODERS PLC	2,621	32.76	85,863.96
ST JAMES'S PLACE PLC	11,000	12.40	136,455.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	53,130	3.53	187,655.16
ADMIRAL GROUP PLC	4,245	19.08	80,994.60
AVIVA PLC	82,385	5.17	425,930.45
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.56	104,660.14
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	122,761	2.73	335,383.05
OLD MUTUAL PLC	104,159	2.26	236,336.77
PRUDENTIAL PLC	53,062	18.64	989,340.99
RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	6.58	141,456.84
AUTO TRADER GROUP PLC	20,690	4.22	87,332.49
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	13.67	118,972.50



	SAGE GROUP PLC/THE	22,180	6.80	150,912.72
	BT GROUP PLC	173,382	2.14	371,210.86
	VODAFONE GROUP PLC	547,308	1.88	1,029,267.42
	CENTRICA PLC	111,175	1.53	170,375.68
	NATIONAL GRID PLC	68,318	8.34	569,977.07
	SEVERN TRENT PLC	4,423	18.80	83,152.40
	SSE PLC	20,977	13.60	285,287.20
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	7.86	104,761.15
英債券小計		8,661,516		40,556,453.57 (5,948,009,480)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,430	24.79	109,819.70
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	657.00	111,690.00
	GIVAUDAN-REG	183	2,260.00	413,580.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	9,359	52.22	488,726.98
	SIKA AG-REG	2,640	146.30	386,232.00
	ABB LTD-REG	37,695	23.37	880,932.15
	GEBERIT AG-REG	760	441.80	335,768.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	217.80	78,408.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	840	222.00	186,480.00
	ADECCO GROUP AG-REG	3,327	60.84	202,414.68
	SGS SA-REG	113	2,665.00	301,145.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	153.65	176,697.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	10,649	92.54	985,458.46
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	498.10	338,708.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	90.50	84,165.00
	DUFREY AG-REG	690	139.65	96,358.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,814.00	81,630.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	6,340.00	145,820.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	75,600.00	151,200.00
	NESTLE SA-REG	64,403	74.62	4,805,751.86
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	174.00	201,840.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	230	768.50	176,755.00
	LONZA GROUP AG-REG	1,478	275.00	406,450.00
	NOVARTIS AG-REG	45,993	75.50	3,472,471.50
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,508	211.30	3,065,540.40
	VIFOR PHARMA AG	1,070	162.85	174,249.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	53,758	15.64	841,043.91
	JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	61.28	281,888.00
	PARGESA HOLDING SA-BR	775	90.30	69,982.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	743.00	274,910.00
	UBS GROUP AG-REG	79,442	15.76	1,252,005.92
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	149.70	161,676.00

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	352.50	225,600.00	
	SWISS RE AG	6,569	89.04	584,903.76	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,091	300.40	928,536.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,460	92.45	134,977.00	
	TEMENOS AG	1,230	154.30	189,789.00	
	SWISSCOM AG-REG	504	446.00	224,784.00	
スイスフラン小計		356,407		23,028,388.72	(2,554,308,876)
スウェーデンクローナ	EPIROC AB-A(N)	13,705	83.85	1,149,164.25	
	EPIROC AB-B(N)	9,100	80.55	733,005.00	
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	283.80	1,226,016.00	
	BOLIDEN AB	5,920	305.55	1,808,856.00	
	ALFA LAVAL AB	6,030	224.50	1,353,735.00	
	ASSA ABLOY AB-B	20,660	191.05	3,947,093.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	278.95	3,823,009.75	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	253.60	2,307,760.00	
	SANDVIK AB	23,320	156.60	3,651,912.00	
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	160.25	1,148,992.50	
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	172.30	1,348,936.70	
	VOLVO AB-B SHS-B	31,980	149.85	4,792,203.00	
	SECURITAS AB-B SHS	5,849	145.40	850,444.60	
	ELECTROLUX AB - B	4,825	218.50	1,054,262.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	87.98	746,070.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	140.06	2,631,447.28	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	274.00	397,300.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	424.30	1,714,172.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,875	215.40	2,773,275.00	
	NORDEA BANK AB	60,808	85.62	5,206,380.96	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	30,130	83.06	2,502,597.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,220	98.88	3,087,033.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,460	189.80	3,503,708.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,370	184.80	622,776.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,135	373.70	3,413,749.50	
	KINNEVIK AB - B	4,885	317.10	1,549,033.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,400	285.60	399,840.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	68.18	4,379,542.30	
HEXAGON AB-B SHS	5,260	514.80	2,707,848.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	550.00	753,500.00		
TELE2 AB-B SHS	7,555	116.05	876,757.75		
TELIA CO AB	57,340	42.94	2,462,179.60		
スウェーデンクローナ小計		504,314		68,922,601.99	(871,181,689)

ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	2,200	304.60	670,120.00	
	EQUINOR ASA	23,294	218.80	5,096,727.20	
	NORSK HYDRO A S	26,460	53.10	1,405,026.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	346.30	1,309,014.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,070	245.50	508,185.00	
	MARINE HARVEST	8,740	171.30	1,497,162.00	
	ORKLA ASA	17,310	73.16	1,266,399.60	
	DNB ASA	19,945	158.60	3,163,277.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	129.40	543,480.00	
	TELENOR ASA	14,895	170.70	2,542,576.50	
ノルウェークローネ小計		122,894		18,001,967.30	(244,826,755)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	652.20	1,232,658.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,845	328.10	1,589,644.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	414.20	1,839,048.00	
	ISS A/S	3,100	222.40	689,440.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	9,275.00	742,000.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	9,932.00	1,370,616.00	
	DSV A/S	3,870	542.20	2,098,314.00	
	PANDORA A/S	2,190	488.60	1,070,034.00	
	CARLSBERG AS-B	2,180	739.60	1,612,328.00	
	COLOPLAST-B	2,545	638.60	1,625,237.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,610	258.40	674,424.00	
	GENMAB A/S	1,180	987.80	1,165,604.00	
	H LUNDBECK A/S	1,460	459.40	670,724.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	36,375	285.90	10,399,612.50	
	DANSKE BANK A/S	16,415	219.10	3,596,526.50	
TRYG A/S	2,575	150.60	387,795.00		
ORSTED A/S	3,870	374.90	1,450,863.00		
デンマーククローネ小計		89,763		32,214,868.50	(553,129,292)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	30.32	161,757.20	
	OIL SEARCH LTD	28,830	8.38	241,595.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	9.70	348,715.00	
	SANTOS LTD	39,755	5.82	231,374.10	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,013	33.72	607,398.36	
	ALUMINA LTD	46,512	2.74	127,442.88	
	AMCOR LIMITED	23,840	13.79	328,753.60	
	BHP BILLITON LTD	66,686	33.38	2,225,978.68	
	BLUESCOPE STEEL LTD	11,500	18.35	211,025.00	
	BORAL LTD	25,275	6.34	160,243.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.65	137,942.25	

INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.45	108,847.50
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	21.65	184,133.25
NEWCREST MINING LTD	15,439	20.50	316,499.50
ORICA LIMITED	7,605	17.39	132,250.95
RIO TINTO LTD	8,718	84.62	737,717.16
SOUTH32 LTD	106,097	3.81	404,229.57
CIMIC GROUP LTD	1,867	40.46	75,538.82
BRAMBLES LTD	32,868	9.03	296,798.04
SEEK LTD	6,920	21.17	146,496.40
AURIZON HOLDINGS LTD	41,770	4.32	180,446.40
SYDNEY AIRPORT	24,156	7.27	175,614.12
TRANSURBAN GROUP	45,855	11.92	546,591.60
ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,980	29.60	384,208.00
CROWN RESORTS LTD	6,745	13.25	89,371.25
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	51.43	60,687.40
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	62.56	60,683.20
TABCORP HOLDINGS LTD	39,384	4.59	180,772.56
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	10,760	3.50	37,660.00
WESFARMERS LTD	22,995	47.00	1,080,765.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	26,772	28.98	775,852.56
COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	8.87	94,465.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	17.55	279,852.30
COCHLEAR LTD	1,277	189.80	242,374.60
HEALTHSCOPE LTD	33,080	2.29	75,753.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	57.78	169,584.30
SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	23.90	193,829.00
CSL LTD	9,312	186.79	1,739,388.48
AUST AND NZ BANKING GROUP	60,029	26.20	1,572,759.80
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	9.91	80,469.20
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.17	106,561.26
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	36,367	67.45	2,452,954.15
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	55,573	25.95	1,442,119.35
WESTPAC BANKING CORP	70,591	27.30	1,927,134.30
AMP LTD	59,627	3.63	216,446.01
ASX LTD	4,035	61.95	249,968.25
CHALLENGER LTD	12,110	12.37	149,800.70
MACQUARIE GROUP LTD	6,494	113.45	736,744.30
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	7.94	399,366.12
MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.90	179,800.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	29,260	9.30	272,118.00
SUNCORP GROUP LTD	27,180	13.87	376,986.60
COMPUTERSHARE LTD	9,430	17.87	168,514.10

	REA GROUP LTD	1,150	90.11	103,626.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	88,954	2.90	257,966.60	
	TPG TELECOM LTD	7,840	5.47	42,884.80	
	AGL ENERGY LTD	12,851	21.44	275,525.44	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.55	63,366.25	
豪ドル小計		1,518,944		24,627,748.36	(2,032,528,072)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	18,583	6.75	125,435.25	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	6.93	148,683.15	
	A2 MILK CO LTD	15,000	11.50	172,500.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,700	15.01	160,607.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	12.00	102,000.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.80	133,596.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	3.15	88,200.00	
ニュージーランドドル小計		137,395		931,022.00	(71,623,522)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	55,708	88.30	4,919,016.40	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	14.58	415,530.00	
	MTR CORP	34,000	43.60	1,482,400.00	
	MINTH GROUP LTD	14,000	37.15	520,100.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	3.01	415,380.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	47.25	1,370,250.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	23.25	337,125.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	49,000	64.85	3,177,650.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	21.15	355,320.00	
	SANDS CHINA LTD	49,800	45.25	2,253,450.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	16.68	467,040.00	
	SJM HOLDINGS LTD	48,000	10.34	496,320.00	
	WYNN MACAU LTD	35,800	28.30	1,013,140.00	
	WH GROUP LTD	182,000	6.96	1,266,720.00	
	BANK OF EAST ASIA	26,040	32.00	833,280.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	39.80	3,064,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	15,900	197.90	3,146,610.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,300	255.60	6,211,080.00	
	AIA GROUP LTD	247,790	70.15	17,382,468.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	53,708	65.65	3,525,930.20	
	HANG LUNG GROUP LTD	17,000	23.65	402,050.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	17.30	795,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	25,126	44.05	1,106,800.30	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT(N)	2,512	44.05	110,653.60	
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	44.75	671,250.00		
KERRY PROPERTIES LTD	11,450	42.85	490,632.50		

	NEW WORLD DEVELOPMENT	125,666	11.86	1,490,398.76	
	SINO LAND CO	63,050	13.36	842,348.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,480	123.20	4,247,936.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	83.00	872,911.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	30.85	715,720.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	24,800	25.50	632,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	24,800	59.45	1,474,360.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	17,600	57.65	1,014,640.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	70,000	10.02	701,400.00	
	PCCW LTD	80,000	4.49	359,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	13,000	59.10	768,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	34,500	81.25	2,803,125.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.45	417,200.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	171,517	14.86	2,548,742.62	
	HONG KONG & CHINA GAS(N)	17,151	14.86	254,863.86	
	POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	55.30	1,576,050.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,200	105.90	656,580.00	
香港ドル小計		2,085,915		77,606,771.74 (1,094,255,481)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	29,060	7.24	210,394.40	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.80	58,800.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.45	113,850.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	50,900	0.96	49,118.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.32	106,720.00	
	SATS LTD	13,000	5.02	65,260.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	11.19	143,232.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	125,000	1.22	152,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.63	85,606.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	33.15	66,300.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.32	41,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.28	162,884.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	27.61	1,013,701.15	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	63,840	12.13	774,379.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	27,100	26.95	730,345.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	15,800	7.21	113,918.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	3.39	175,602.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	11.21	112,100.00	
	UOL GROUP LTD	9,350	7.67	71,714.50	
	VENTURE CORP LTD	5,600	20.11	112,616.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.19	549,254.20	
シンガポールドル小計		937,355		4,909,896.25 (403,593,471)	

イスラエルシュケル	FRUTAROM	810	352.20	285,282.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	13,070	17.80	232,646.00
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	444.40	222,200.00
	BANK HAPOALIM BM	21,225	24.94	529,351.50
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	30,255	22.21	671,963.55
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	67.05	194,445.00
	AZRIELI GROUP LTD	940	184.40	173,336.00
	NICE LTD	1,385	397.00	549,845.00
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	4.00	195,160.00
イスラエルシュケル小計		119,875		3,054,229.05 (93,520,493)
合 計		25,741,303		83,290,218,642 (83,290,218,642)

(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	85,570.44	
	出資金小計		3,327.00	85,570.44 (9,470,936)	
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,890	149,910.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	2,050	261,703.00	
		AMERICAN TOWER CORP	9,169	1,268,531.15	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	22,720	239,014.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,825	475,108.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,147	377,262.36	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	174,910.40	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,410	850,839.70	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,135	440,915.05	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	196,281.25	
		EQUINIX INC	1,618	641,925.32	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	480,037.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	328,762.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,450	238,948.50	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	171,342.35	
		GGP INC	15,475	320,796.75	
		HCP INC	9,285	221,632.95	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	323,554.77	
		INVITATION HOMES INC	6,200	139,004.00	
		IRON MOUNTAIN INC	5,515	187,454.85	
	KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	145,381.35		

		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	137,843.64
		MACERICH CO/THE	2,460	138,055.20
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	219,894.90
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	126,088.30
		PROLOGIS INC	10,932	704,239.44
		PUBLIC STORAGE	3,259	698,925.14
		REALTY INCOME CORP	5,400	286,146.00
		REGENCY CENTERS CORP	3,175	190,531.75
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,390	375,230.00
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,754	1,107,993.70
		SL GREEN REALTY CORP	2,040	199,593.60
		UDR INC	5,820	215,922.00
		VENTAS INC	7,285	396,376.85
		VEREIT INC	19,554	141,570.96
		VORNADO REALTY TRUST	3,491	251,142.54
		WELLTOWER INC	7,380	425,383.20
		WEYERHAEUSER CO	15,508	577,828.08
	投資証券小計		247,834	13,826,081.45 (1,530,270,694)
米ドル小計			251,161	13,911,651.89 (1,539,741,630)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	47,080.80
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	80,714.40
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	51,088.70
加ドル小計			7,410	178,883.90 (15,085,279)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	595	53,312.00
		GECINA SA	970	139,292.00
		ICADE	685	56,307.00
		KLEPIERRE	4,732	157,954.16
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,770	530,455.00
ユーロ小計			9,752	937,320.16 (119,883,248)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	20,201	139,790.92
		HAMMERSON PLC	15,295	81,889.43
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	145,095.91
		SEGRO PLC	21,263	142,462.10
英ポンド小計			71,973	509,238.36 (74,684,897)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	22,538	216,590.18
		DEXUS	21,247	203,971.20
		GOODMAN GROUP	37,672	357,507.28



		GPT GROUP	37,975	190,254.75	
		LENDLEASE GROUP	12,197	230,523.30	
		MIRVAC GROUP	78,535	175,133.05	
		SCENTRE GROUP	107,261	451,568.81	
		STOCKLAND	50,500	209,575.00	
		VICINITY CENTRES	72,862	192,355.68	
豪ドル小計			440,787	2,227,479.25 (183,833,862)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	46,000	3,284,400.00	
香港ドル小計			46,000	3,284,400.00 (46,310,040)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	135,978.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	54,940	90,101.60	
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	97,643.00	
		SUNTEC REIT	54,600	92,820.00	
シンガポールドル小計			209,540	416,542.60 (34,239,801)	
合計				2,013,778,757 (2,013,778,757)	

(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 597銘柄	97.3%			65.1%
	投資証券 38銘柄			2.7%	1.8%
加ドル	株式 87銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 240銘柄	98.9%			12.6%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 99銘柄	98.8%			7.0%
	投資証券 4銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
豪ドル	株式 58銘柄	91.7%			2.4%
	投資証券 9銘柄			8.3%	0.2%

ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	43銘柄	95.9%			1.3%
	投資証券	1銘柄			4.1%	0.1%
シンガポールドル	株式	21銘柄	92.2%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.8%	0.0%
イスラエルシケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 6月29日現在です。

## 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	32,706,434,574円
負債総額	32,672,438円
純資産総額( - )	32,673,762,136円
発行済口数	38,280,955,149口
1口当たり純資産額( / )	0.8535円

(参考)

## 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	7,432,785,124円
負債総額	4,350,888円
純資産総額( - )	7,428,434,236円
発行済口数	3,782,146,657口
1口当たり純資産額( / )	1.9641円

## 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	6,602,551,090円
負債総額	4,411,753円
純資産総額( - )	6,598,139,337円
発行済口数	3,278,495,468口
1口当たり純資産額( / )	2.0126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	38,187,500,039円
負債総額	270,927,396円
純資産総額（ - ）	37,916,572,643円
発行済口数	27,145,308,593口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3968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	149,607,540,641円
負債総額	91,980,615円
純資産総額（ - ）	149,515,560,026円
発行済口数	67,187,881,351口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2253円

#### 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	29,201,449,064円
負債総額	191,592,215円
純資産総額（ - ）	29,009,856,849円
発行済口数	18,701,901,455口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5512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	84,492,478,714円
負債総額	33,448,395円
純資産総額（ - ）	84,459,030,319円
発行済口数	35,056,767,912口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4092円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （1）名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわな

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとしてします。
- ・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てします。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てします。
- ・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てします。

(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てします。

(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6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6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6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6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	810	176,770

株式投資信託	768	149,190
単位型	228	8,378
追加型	540	140,812
公社債投資信託	42	27,579
単位型	28	457
追加型	14	27,121

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

#### (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
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	34,015	39,959
利益剰余金合計	34,015	39,959
自己株式	672	786
株主資本合計	55,926	61,756
<b>評価・換算差額等</b>		
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	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	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						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	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。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>5年～20年</td> </tr> </table> <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>	建物	3年～15年	器具備品	5年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	5年～20年				
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。</p> <p>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。</p> <p>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)

<p>第58期 (平成29年3月31日)</p>	<p>第59期 (平成30年3月31日)</p>
<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)

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

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ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ースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

( 2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

## (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっ

ております。

#### (8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものうち8百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

## (デリバティブ取引関係)

第58期(平成29年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第59期(平成30年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

## (退職給付関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	190
退職給付の支払額	72
退職給付債務の期末残高	1,190

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

貸借対照表に計上された負債の額	1,259
退職給付引当金	1,259
貸借対照表に計上された負債の額	1,259

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	23
確定給付制度に係る退職給付費用	177

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、213百万円でありました。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)	
退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

## (2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	0
確定給付制度に係る退職給付費用	132



## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使 可能初日」といいます。)、当該権 利行使可能初日から1年経過した日 の翌日、及び当該権利行使可能初日 から2年経過した日の翌日まで原則 として従業員等の地位にあることを 要し、それぞれ保有する新株予約権 の2分の1、4分の1、4分の1ず つ権利確定する。ただし、本新株予 約権の行使時において、当社が株式 公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	平成25年10月7日(以下「権利行使 可能初日」といいます。)、当該権 利行使可能初日から1年経過した日 の翌日、及び当該権利行使可能初日 から2年経過した日の翌日まで原則 として従業員等の地位にあることを 要し、それぞれ保有する新株予約権 の2分の1、4分の1、4分の1ず つ権利確定する。ただし、本新株予 約権の行使時において、当社が株式 公開していることを要する。	平成30年7月15日(以下「権利行使可 能初日」といいます。)、当該権利行 使可能初日から1年経過した日の翌 日、及び当該権利行使可能初日から2 年経過した日の翌日まで原則として従 業員等の地位にあることを要し、それ ぞれ保有する新株予約権の3分の1、 3分の1、3分の1ずつ権利確定す る。ただし、本新株予約権の行使時 において、当社が株式公開しているこ とを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2 年を経過した日まで
権利行使期間	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年 7 月15日
権利行使価格(円)	737 (注) 3	558

付与日における公正な評価単価 (円) (注)1	0	0
----------------------------	---	---

- (注)1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストック オプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	平成25年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成30年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31日まで

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

付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員	31名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式	4,409,000株
付与日	平成29年4月27日	
権利確定条件	平成31年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39年4月30日まで	

（注） 株式数に換算して記載しております。

## （2）ストックオプション（新株予約権）の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳  (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳  (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金 641		賞与引当金 700
	その他 224		その他 314
	小計 865		小計 1,014
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損 96		投資有価証券評価損 96
	関係会社株式評価損 1,430		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 385		退職給付引当金 402
	固定資産減価償却費 119		固定資産減価償却費 111
	その他 63		その他 211
	小計 2,095		小計 2,253
	繰延税金資産小計 2,961		繰延税金資産小計 3,268
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,530		繰延税金資産合計 1,838
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 0		その他有価証券評価差額金 -
	小計 0		小計 -
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 123		その他有価証券評価差額金 180
	繰延ヘッジ利益 117		繰延ヘッジ利益 152
	小計 241		小計 333
	繰延税金負債合計 242		繰延税金負債合計 333
	繰延税金資産の純額 1,288		繰延税金資産の純額 1,504
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率 30.9% (調整)		法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%		
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.3%		
	過年度法人税等 1.5%		
	海外子会社の留保利益の影響額等 0.2%		
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.9%		

## ( 関連当事者情報 )

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成28年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

### (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

#### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記



## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成29年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

## 関連情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	5,562	6,979
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-

普通株式に係る当期純利益（百万円）	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,009	195,794
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株	平成21年度ストックオプション(1) 1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,686,200株、平成28年度ストックオプション(1) 3,618,000株、平成28年度ストックオプション(2) 3,877,000株

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	56,475	62,511
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	56,475	62,511
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	195,893	195,711

#### （重要な後発事象）

#### 新株予約権（ストックオプション）の付与

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

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

#### 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って、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
エース証券株式会社	8,831百万円	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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村証券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	8,557百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
オーストラリア・アンド・ニュージーランド・バンキング・グループ・リミテッド(銀行) 1	27,933百万豪ドル	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	

株式会社四国銀行	25,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社第三銀行	37,461百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行 1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社南日本銀行	16,601百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	54,127百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	
農林中央金庫	3,480,488百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余剰資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

## 2 【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3 【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3 【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
- 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
- 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
- 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
- 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
- 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
- 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
- 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
- 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
- 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (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7月18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」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成29年12月16日から平成30年6月15日までの特定期間の財務諸表、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、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の平成30年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。