

## 【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】	2020年9月15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 安倍 秀雄
【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3.3%（税抜3%）が上限となっております。

### （６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

### （７）【申込期間】

2020年9月16日から2021年3月15日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 12 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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(<https://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、2020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

	REIT(不動産投資)	債券	株式
景気が良くなると	空室率や賃料水準が改善傾向 価格が上がる傾向	金利が上がる傾向 債券価格は下がる傾向	企業業績が改善する傾向 株価は上がる傾向
景気が悪くなると	空室率や賃料水準が悪化の傾向 価格は下がる傾向	金利が下がる傾向 債券価格は上がる傾向	企業業績が悪化する傾向 株価は下がる傾向

※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)~2020年6月、月末値)



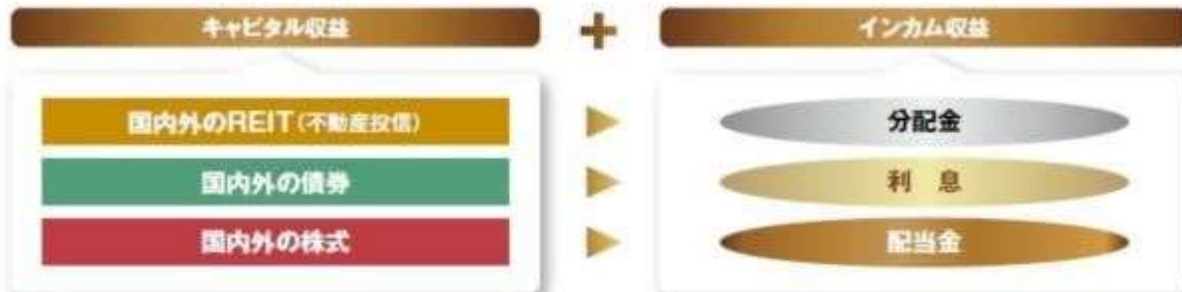
※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したもものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。  
 ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。  
 ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。





**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

(2020年6月末現在)



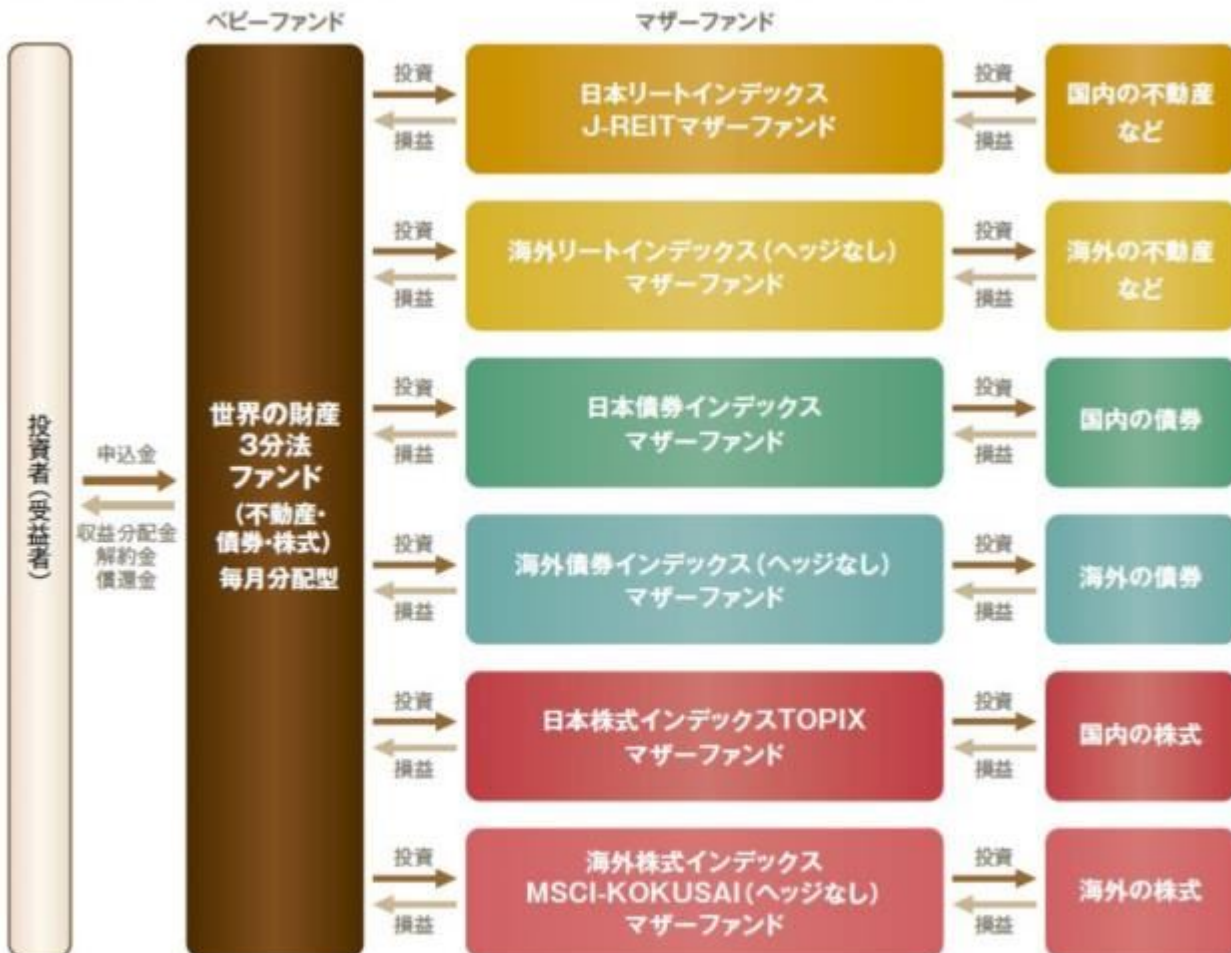
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。  
 ※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

### 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ないます。



### (主な投資制限)

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

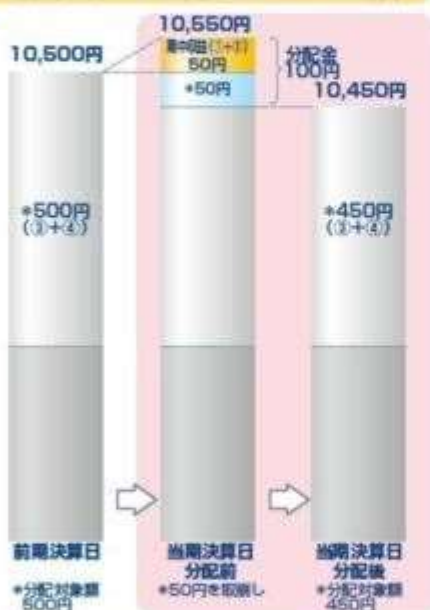
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 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

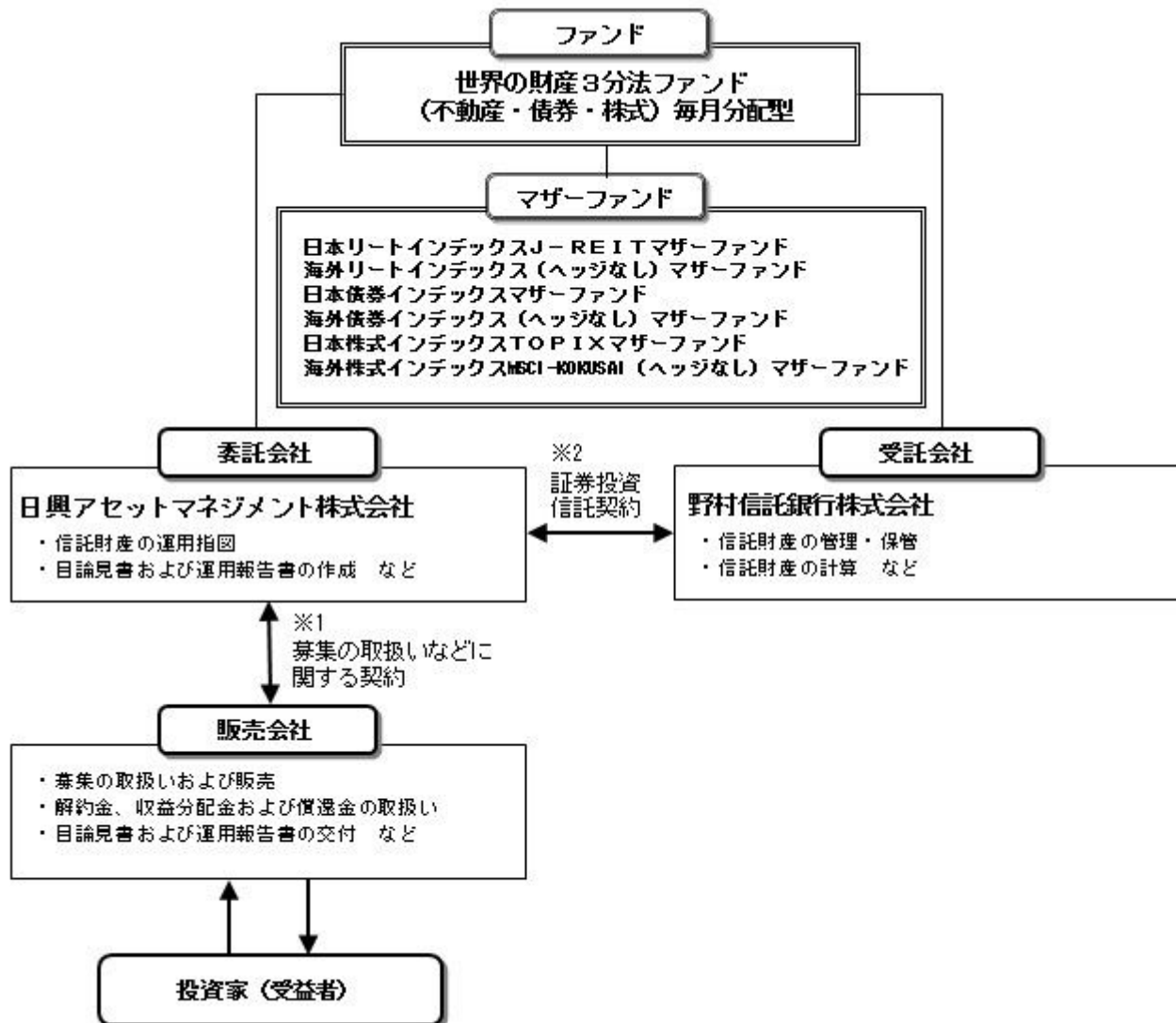
## ・ファンド名称変更

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

委託会社の概況（2020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
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	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。)



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) 金利先渡し取引
- 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せん。）
- 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。）に限りません。）
- 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せん。）
- 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せん。）
- 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券
- 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券（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せん。）
- 12) 預託証券（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せん。）
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引

- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限りません。）
- 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せん。）
- 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せん。）
- 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 >

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）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

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） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンツ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。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	

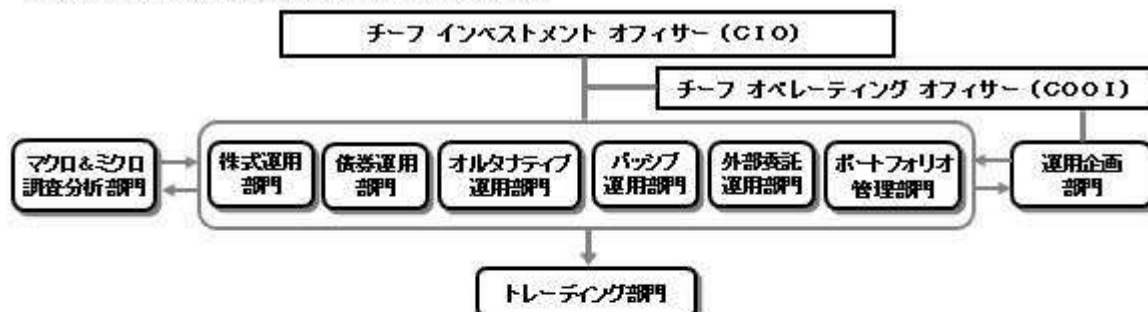
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

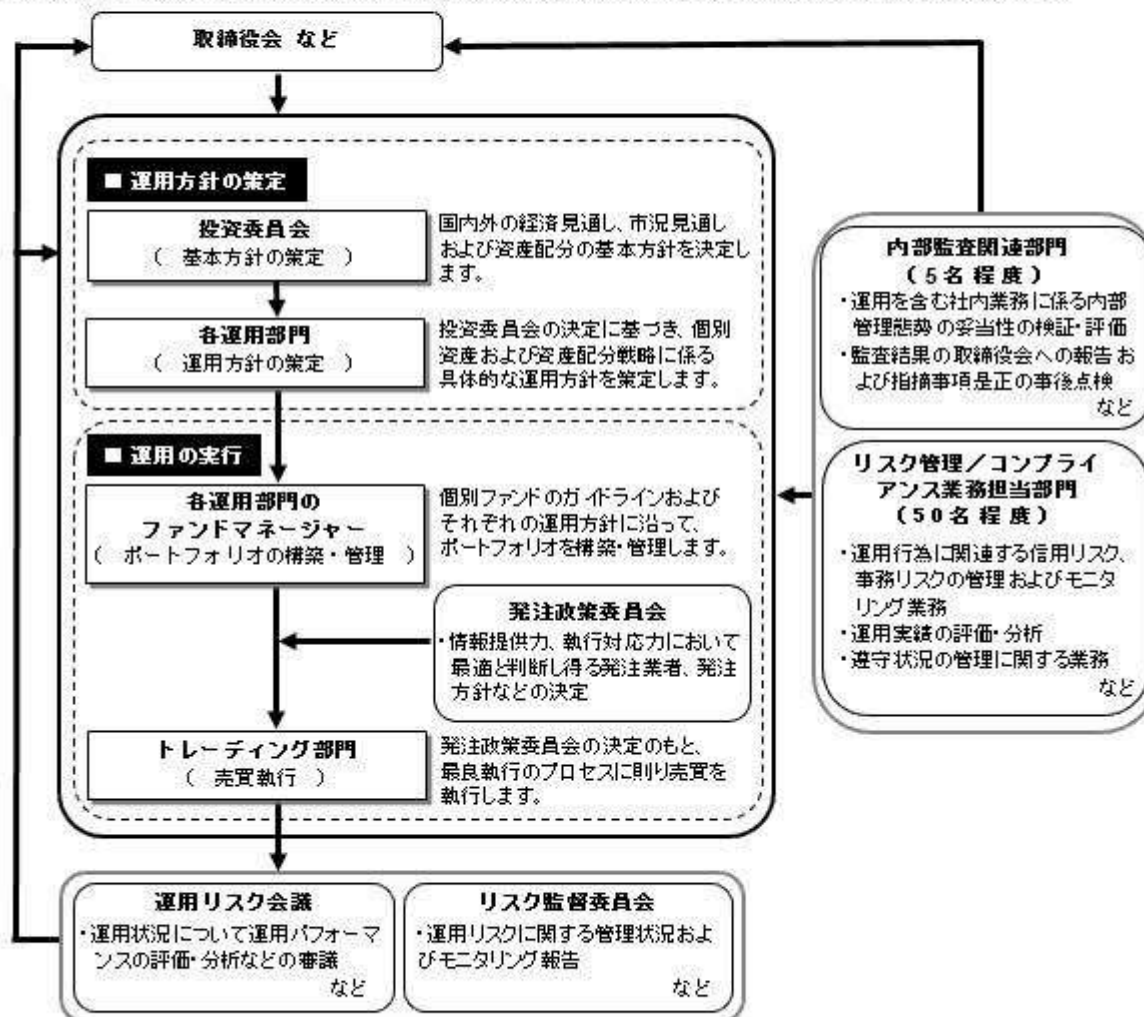
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### （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。



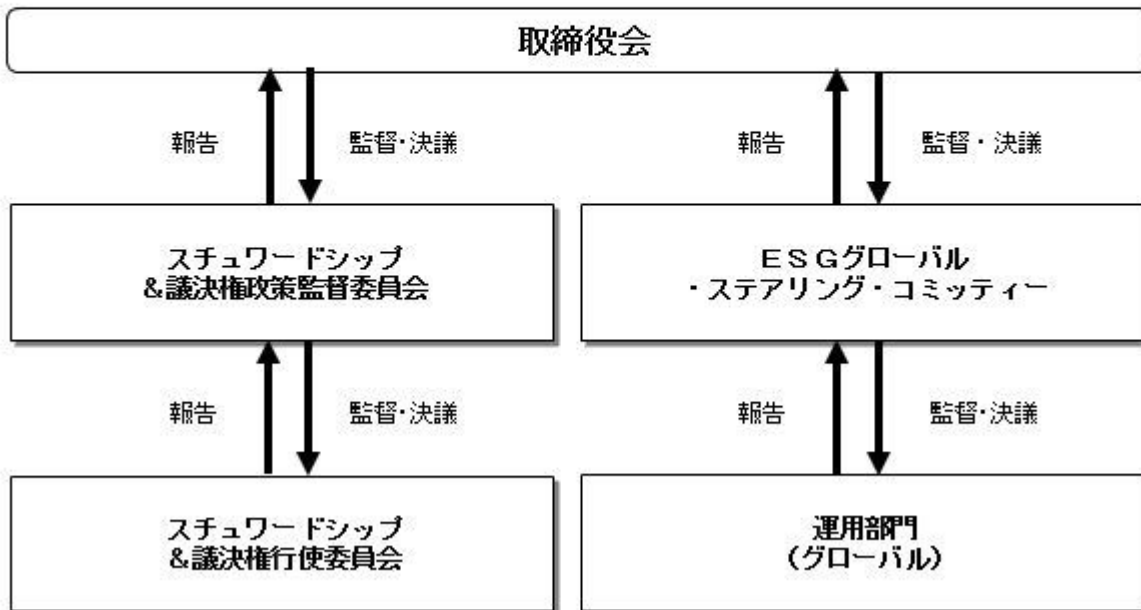
#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



上記体制は2020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ないます。

## 収益分配金の支払い

## &lt;分配金再投資コース&gt;

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

## &lt;分配金受取りコース&gt;

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

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

## &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。

<日本リートインデックスJ - REIT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、
- 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、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、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、
- 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、
- 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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

#### <日本株式インデックストップIXマザーファンド>

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

託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

可能なものについてはこの限りではありません。

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に不動産投信、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は、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出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

##### ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

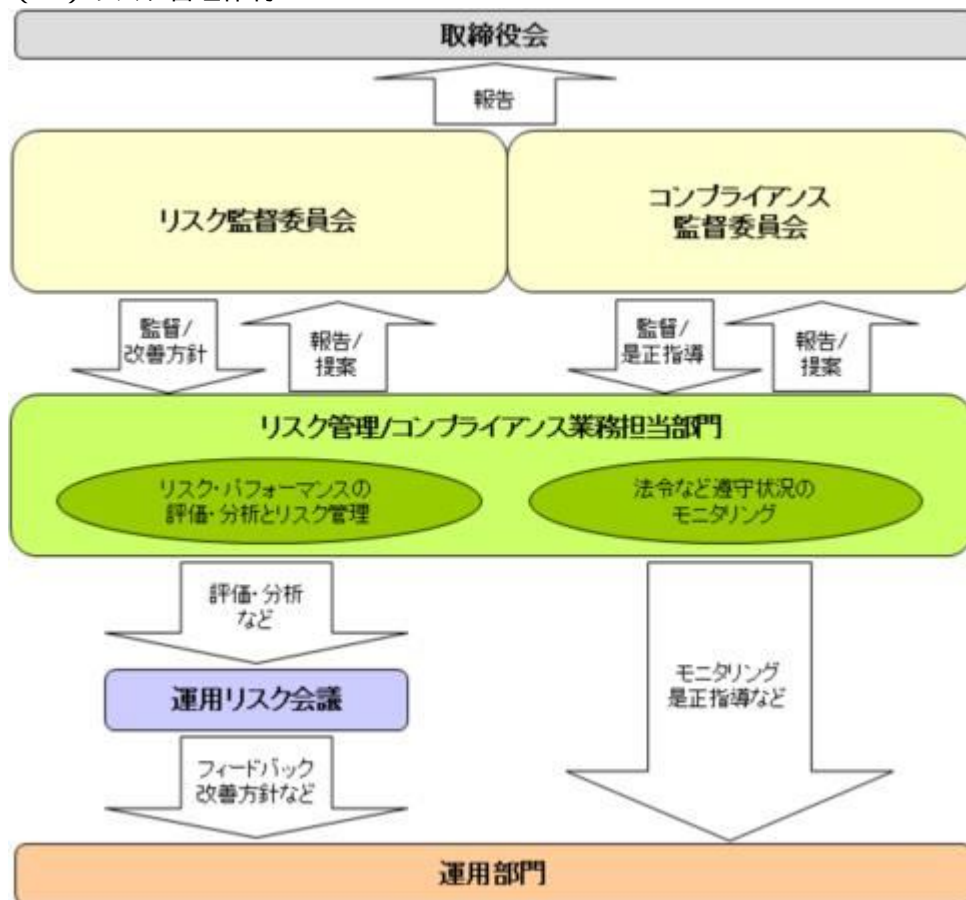
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの



基準価額が大きく変動する可能性があります。

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

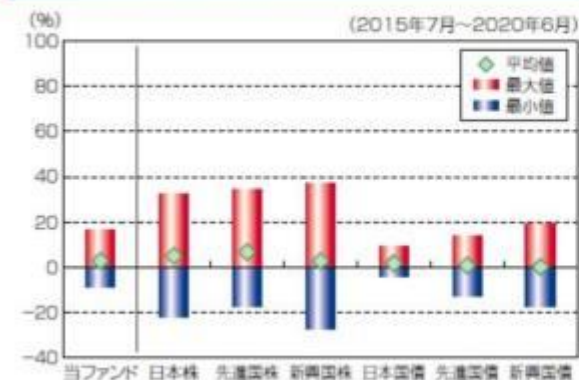
## 法令など遵守状況のモニタリング

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2020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	2.9%	5.0%	6.8%	2.8%	1.8%	0.8%	0.2%
最大値	16.6%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	14.0%	19.3%
最小値	-8.7%	-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2015年7月から2020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、2015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。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

### 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

### MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

### NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対

象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

#### JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（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3.3%（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1.045%（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、日々計上され、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する諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、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応じて異なりますので、表示することができません。

#### （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

<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せん。）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せん。）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せん。）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

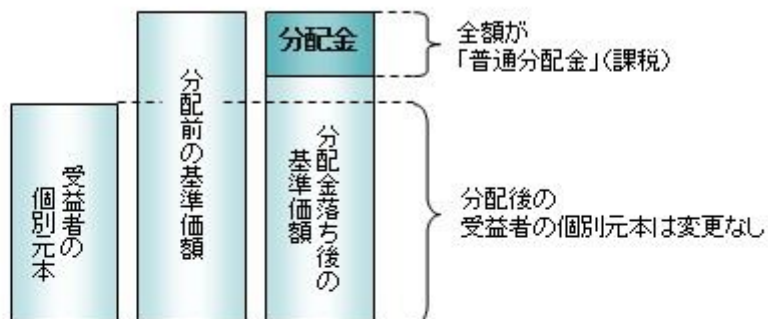
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



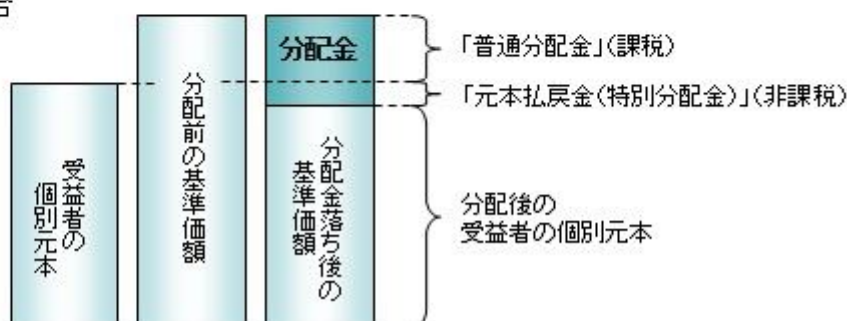
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2020年9月15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2020年6月30日現在です。

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

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	29,161,867,231	97.99
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		598,291,637	2.01
合計(純資産総額)		29,760,158,868	100.00

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	3,576,950,107	1.4173	5,069,611,387	1.4119	5,050,295,856	16.97
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	2,064,546,079	2.4225	5,001,362,877	2.4441	5,045,957,071	16.96
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,302,963,025	1.4400	4,756,266,756	1.4685	4,850,401,202	16.30
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	2,408,881,998	1.9644	4,732,007,797	2.0077	4,836,312,387	16.25
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	1,848,784,153	2.5594	4,731,894,579	2.5940	4,795,746,092	16.11
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	2,555,282,462	1.8451	4,714,856,450	1.7936	4,583,154,623	15.40

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.99
合計	97.99

#### 【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
第27特定期間末	(2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末	(2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末	(2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末	(2020年 6月15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
	2019年 6月末日	31,858		0.8643	
	7月末日	32,235		0.8778	
	8月末日	32,013		0.8711	
	9月末日	32,603		0.8937	
	10月末日	33,148		0.9159	
	11月末日	33,093		0.9205	
	12月末日	32,948		0.9197	
	2020年 1月末日	33,102		0.9246	
	2月末日	31,310		0.8766	
	3月末日	27,701		0.7834	
	4月末日	28,413		0.8051	
	5月末日	29,572		0.8314	
	6月末日	29,760		0.8350	

(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
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	8.10

(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
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750

（参考）

## 日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2020年 6月30日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	124,361,703,530	98.64
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,713,373,067	1.36
合計（純資産総額）		126,075,076,597	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	13,956	648,499.57	9,050,460,000	614,000	8,568,984,000	6.80
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	14,412	555,380.79	8,004,148,000	553,000	7,969,836,000	6.32

日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	21,686	295,247.39	6,402,735,000	328,000	7,113,008,000	5.64
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	46,527	136,385.69	6,345,617,400	129,400	6,020,593,800	4.78
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	37,297	138,625.3	5,170,308,000	156,500	5,836,980,500	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	20,563	256,371.65	5,271,770,300	254,000	5,223,002,000	4.14
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	13,669	296,872.87	4,057,955,300	321,500	4,394,583,500	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	28,716	141,440.57	4,061,607,600	141,400	4,060,442,400	3.22
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	32,360	116,273.92	3,762,624,300	115,800	3,747,288,000	2.97
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	27,239	137,804.99	3,753,670,300	134,500	3,663,645,500	2.91
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	18,561	162,121.96	3,009,145,800	173,600	3,222,189,600	2.56
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	9,471	321,570.16	3,045,591,000	316,000	2,992,836,000	2.37
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	4,789	627,928.37	3,007,149,000	624,000	2,988,336,000	2.37
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	42,139	67,707.21	2,853,114,400	69,200	2,916,018,800	2.31
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	9,417	280,677.5	2,643,140,100	292,800	2,757,297,600	2.19
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	7,222	366,607.31	2,647,638,000	371,500	2,682,973,000	2.13
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	4,458	580,951.09	2,589,880,000	601,000	2,679,258,000	2.13
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	16,581	137,681.05	2,282,889,500	136,200	2,258,332,200	1.79
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	13,400	154,234.02	2,066,736,000	166,200	2,227,080,000	1.77
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	46,427	43,448.86	2,017,200,350	44,500	2,066,001,500	1.64
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	6,275	310,954.18	1,951,237,500	322,000	2,020,550,000	1.60
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	3,326	584,760.07	1,944,912,000	597,000	1,985,622,000	1.57
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	4,101	449,280.54	1,842,499,500	480,500	1,970,530,500	1.56
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	15,553	109,602.21	1,704,643,200	114,400	1,779,263,200	1.41
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	17,643	94,342.83	1,664,490,600	100,400	1,771,357,200	1.41
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	63,217	30,026.2	1,898,166,600	27,790	1,756,800,430	1.39
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	9,402	177,464.45	1,668,520,800	186,100	1,749,712,200	1.39
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	5,119	341,571.98	1,748,507,000	340,500	1,743,019,500	1.38
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	13,331	126,635.96	1,688,184,100	125,200	1,669,041,200	1.32
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	12,257	131,521.49	1,612,059,000	134,000	1,642,438,000	1.30

## □ 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.64
合計	98.64

## 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2020年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	88,995,316,754	74.08
	カナダ	2,277,224,796	1.90
	ドイツ	335,531,551	0.28
	イタリア	18,210,610	0.02
	フランス	2,739,058,151	2.28
	オランダ	222,769,774	0.19
	スペイン	620,311,764	0.52
	ベルギー	1,487,961,227	1.24
	アイルランド	173,102,555	0.14
	イギリス	6,030,813,876	5.02
	オーストラリア	7,771,073,725	6.47
	ニュージーランド	288,788,515	0.24
	香港	2,195,723,855	1.83
	シンガポール	5,296,527,000	4.41
	韓国	64,545,741	0.05
	イスラエル	68,683,299	0.06
	ガーンジー	262,344,297	0.22
マン島	28,048,047	0.02	
	小計	118,876,035,537	98.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,264,390,918	1.05
合計（純資産総額）		120,140,426,455	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	758,469	10,177.12	7,719,030,333	9,822.65	7,450,179,922	6.20
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	90,962	72,901.19	6,631,238,373	74,224.24	6,751,585,392	5.62
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	275,834	14,658.77	4,043,387,948	15,097.60	4,164,433,109	3.47
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	154,560	21,167.67	3,271,676,281	20,589.11	3,182,253,460	2.65
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	144,381	17,642.42	2,547,230,964	16,484.22	2,380,008,168	1.98
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	428,937	5,941.28	2,548,436,242	5,522.75	2,368,912,846	1.97
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	314,337	8,186.08	2,573,189,464	7,340.32	2,307,336,117	1.92
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	352,049	6,510.72	2,292,095,353	6,440.69	2,267,441,009	1.89
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	129,665	17,175.92	2,227,116,469	17,414.01	2,257,988,411	1.88
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	359,270	6,849.03	2,460,651,655	6,213.36	2,232,275,931	1.86
香港	投資証券	LINK REIT	2,125,700	932.68	1,982,619,132	884.73	1,880,681,189	1.57
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,673,329	1,090.85	1,825,363,613	1,110.41	1,858,091,964	1.55
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	67,192	26,900.52	1,807,499,954	24,395.56	1,639,187,018	1.36
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	560,037	2,981.30	1,669,638,872	2,918.67	1,634,566,887	1.36
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	552,610	2,951.34	1,630,943,097	2,928.37	1,618,248,314	1.35
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	382,090	4,246.03	1,622,366,902	3,954.05	1,510,806,021	1.26
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	100,851	14,936.05	1,506,316,531	14,484.56	1,460,782,925	1.22
イギリス	投資証券	SEGO PLC	1,223,901	1,157.51	1,416,680,551	1,182.78	1,447,610,838	1.20
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	148,877	10,401.21	1,548,502,371	9,661.04	1,438,307,516	1.20
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	117,773	12,829.67	1,510,989,808	12,015.16	1,415,062,004	1.18
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	376,796	3,808.60	1,435,068,637	3,725.64	1,403,809,716	1.17
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	132,839	10,419.53	1,384,120,663	9,893.76	1,314,277,743	1.09
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	176,245	7,445.91	1,312,304,654	7,204.57	1,269,770,109	1.06
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	186,159	6,840.41	1,273,404,369	6,642.17	1,236,499,911	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	303,328	4,211.55	1,277,483,040	3,963.75	1,202,317,755	1.00
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	541,589	2,087.78	1,130,722,842	1,986.72	1,075,988,731	0.90
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	480,541	2,401.75	1,154,142,183	2,154.80	1,035,469,747	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	100,060	10,268.69	1,027,486,062	9,684.74	969,055,945	0.81
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	118,615	7,842.49	930,238,019	8,023.39	951,695,330	0.79
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	142,484	6,942.72	989,227,542	6,056.42	862,943,175	0.72

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.95
合計	98.95

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 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2020年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	32,644,640,074	76.56
地方債証券	日本	2,544,935,774	5.97
特殊債券	日本	4,716,588,556	11.06
社債券	日本	2,538,319,192	5.95
	オーストラリア	100,039,920	0.23
	小計	2,638,359,112	6.19
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		93,136,526	0.22
合計（純資産総額）		42,637,660,042	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357回利付国債（10年）	720,000,000	100.87	726,272,400	100.80	725,781,600	0.100	2029/12/20	1.70
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	103.52	724,689,000	102.25	715,792,000	0.300	2025/12/20	1.68
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	102.61	625,975,900	101.30	617,942,200	0.100	2026/12/20	1.45
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	448,000,000	121.91	546,160,800	118.81	532,295,680	1.700	2032/9/20	1.25
日本	国債証券	第153回利付国債（20年）	450,000,000	116.67	525,034,500	115.15	518,179,500	1.300	2035/6/20	1.22
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	490,000,000	103.74	508,330,900	102.65	502,994,800	0.500	2024/9/20	1.18
日本	国債証券	第144回利付国債（20年）	430,000,000	119.76	514,976,600	116.77	502,128,200	1.500	2033/3/20	1.18
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	490,000,000	102.86	504,043,400	101.39	496,815,900	0.100	2027/12/20	1.17
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	490,000,000	102.75	503,475,000	101.35	496,624,800	0.100	2027/3/20	1.16
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	480,000,000	102.82	493,545,600	101.35	486,518,400	0.100	2028/3/20	1.14
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	435,000,000	102.77	447,062,550	101.32	440,746,350	0.100	2028/6/20	1.03
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	420,000,000	103.95	436,590,000	102.67	431,247,600	0.400	2025/9/20	1.01
日本	国債証券	第145回利付国債（20年）	355,000,000	122.68	435,538,850	119.49	424,193,050	1.700	2033/6/20	0.99

日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	122.21	419,181,300	120.11	411,994,450	2.100	2030/3/20	0.97
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	103.60	404,067,300	102.39	399,336,600	0.400	2025/3/20	0.94
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	350,000,000	115.28	403,501,800	113.64	397,764,500	1.200	2035/3/20	0.93
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	390,000,000	102.71	400,592,400	101.28	394,992,000	0.100	2028/9/20	0.93
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	103.77	383,978,600	102.52	379,331,400	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	101.10	374,089,735	101.10	374,089,735	1.300	2021/3/20	0.88
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.28	354,632,300	119.36	346,161,400	2.100	2029/9/20	0.81
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.18	351,543,000	114.44	343,344,000	2.300	2026/6/20	0.81
日本	国債証券	第46回利付国債(30年)	250,000,000	126.71	316,775,000	123.08	307,705,000	1.500	2045/3/20	0.72
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	105.19	310,316,400	103.83	306,301,450	1.400	2022/12/20	0.72
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	300,000,000	100.93	302,814,000	100.72	302,181,000	0.100	2030/3/20	0.71
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	105.32	300,164,850	102.41	291,888,450	0.500	2038/3/20	0.68
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	117.88	294,712,500	115.02	287,565,000	2.300	2026/9/20	0.67
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	139.87	279,750,000	135.08	270,168,000	2.200	2041/3/20	0.63
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	120.29	276,669,500	117.39	270,008,500	1.600	2032/6/20	0.63
日本	国債証券	第136回利付国債(20年)	220,000,000	119.69	263,337,000	117.16	257,771,800	1.600	2032/3/20	0.60
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	245,000,000	102.43	250,958,400	101.26	248,089,450	0.100	2026/6/20	0.58

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.56
地方債証券	5.97
特殊債券	11.06
社債券	6.19
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2020年6月30日現在です。



・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	69,189,976,125	45.11
	カナダ	2,949,624,494	1.92
	メキシコ	1,180,183,978	0.77
	ドイツ	11,437,166,437	7.46
	イタリア	13,869,895,789	9.04
	フランス	15,363,802,887	10.02
	オランダ	2,972,034,427	1.94
	スペイン	9,078,283,638	5.92
	ベルギー	3,986,953,578	2.60
	オーストリア	2,352,227,966	1.53
	フィンランド	910,482,255	0.59
	アイルランド	1,242,893,061	0.81
	イギリス	9,984,411,565	6.51
	スウェーデン	442,410,906	0.29
	ノルウェー	317,895,518	0.21
	デンマーク	784,983,603	0.51
	ポーランド	921,380,156	0.60
	オーストラリア	3,291,666,853	2.15
	シンガポール	703,922,776	0.46
	マレーシア	764,564,014	0.50
イスラエル	572,474,790	0.37	
	小計	152,317,234,816	99.32
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,046,522,741	0.68
合計（純資産総額）		153,363,757,557	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		474,854,194	0.31
	売建		34,015,540	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,141.79	1,123,115,824	11,937.25	1,104,196,066	8.000	2021/11/15	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	10,993.89	824,542,381	11,111.52	833,364,671	2.750	2021/9/15	0.54
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,575,000	13,943.57	777,354,184	14,096.65	785,888,339	1.250	2034/5/25	0.51
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,315,000	22,198.24	735,871,660	22,290.82	738,940,948	4.500	2041/4/25	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	10,742.76	605,892,102	11,554.06	651,649,118	1.625	2026/5/15	0.42
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,205,000	19,422.73	622,498,531	19,892.99	637,570,521	2.500	2044/7/4	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,845.10	618,171,179	11,156.98	635,947,930	1.875	2022/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	11,885.69	587,153,188	12,730.36	628,880,005	2.875	2028/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	11,537.97	573,437,270	12,643.24	628,369,321	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,570.68	578,534,333	12,280.67	614,033,801	3.000	2025/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,117.42	589,223,327	11,556.58	612,499,154	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	12,380.84	507,614,474	14,889.79	610,481,556	3.000	2048/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	11,120.92	571,615,432	11,875.59	610,405,758	2.250	2025/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,040,000	10,985.48	553,668,281	11,840.45	596,759,025	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,780,000	11,318.80	541,038,812	12,451.54	595,183,860	2.375	2029/5/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,885,000	20,346.33	586,991,851	20,462.93	590,355,579	4.750	2035/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	12,118.62	546,549,868	13,041.37	588,166,223	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	10,964.69	550,427,930	11,702.20	587,450,684	2.000	2025/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,881.74	576,732,220	11,020.20	584,070,709	2.250	2021/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	10,961.28	544,775,729	11,634.44	578,231,972	2.000	2025/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,171.08	536,211,844	12,045.83	578,200,139	2.250	2027/2/15	0.38
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,832,000	19,806.61	560,923,466	20,407.04	577,927,571	2.500	2046/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,900,000	12,303.19	479,824,470	14,599.40	569,376,611	3.000	2045/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,032.19	529,545,444	11,735.24	563,291,629	2.125	2025/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,012.96	550,648,366	11,162.03	558,101,604	2.500	2022/1/15	0.36
ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	4,540,000	12,218.86	554,736,692	12,211.98	554,424,051	0.000	2021/10/8	0.36
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	14,472.01	568,750,165	14,087.96	553,656,856	4.250	2023/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,640,000	21,038.22	555,409,105	20,829.29	549,893,403	5.750	2032/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,672.99	533,649,688	10,887.42	544,371,057	1.125	2021/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,134.25	514,402,610	11,723.87	541,643,207	2.375	2024/8/15	0.35

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.32
合計	99.32

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,150,000.00	230,994,500	231,619,500	0.15
	ユーロ	買建	1,728,000.00	208,144,133	209,226,240	0.14
	英ポンド	買建	193,000.00	25,580,702	25,572,500	0.02
	豪ドル	買建	114,200.00	8,437,995	8,435,954	0.01
	米ドル	売建	315,748.08	34,018,697	34,015,540	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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2020年6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	31,763,851,450	98.29
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		553,003,877	1.71
合計(純資産総額)		32,316,855,327	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	592,230,000	1.83

(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	162,100	7,368.46	1,194,427,456	6,762.00	1,096,120,200	3.39
日本	株式	ソニー	電気機器	91,000	6,392.83	581,748,020	7,384.00	671,944,000	2.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	113,100	4,062.00	459,413,021	5,450.00	616,395,000	1.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	13,200	33,741.61	445,389,267	45,030.00	594,396,000	1.84
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	190,600	2,621.94	499,743,346	2,515.50	479,454,300	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	120,900	3,797.45	459,112,134	3,848.00	465,223,200	1.44
日本	株式	任天堂	その他製品	8,900	37,128.21	330,441,069	48,010.00	427,289,000	1.32

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	980,100	550.53	539,578,130	421.60	413,210,160	1.28
日本	株式	第一三共	医薬品	41,600	6,837.21	284,428,330	8,806.00	366,329,600	1.13
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	99,400	3,521.17	350,004,377	3,682.00	365,990,800	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	104,000	2,961.29	307,974,160	3,234.00	336,336,000	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,500	14,989.17	277,299,645	17,335.00	320,697,500	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,400	2,891.26	330,761,060	2,755.50	315,229,200	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	24,400	11,743.99	286,553,356	12,595.00	307,318,000	0.95
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	99,100	3,732.57	369,897,853	3,032.00	300,471,200	0.93
日本	株式	花王	化学	34,800	8,288.78	288,449,560	8,540.00	297,192,000	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	28,800	9,185.13	264,531,744	10,260.00	295,488,000	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	101,900	2,868.47	292,297,680	2,882.00	293,675,800	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	42,700	5,850.11	249,799,746	6,316.00	269,693,200	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	13,600	20,886.61	284,057,896	19,260.00	261,936,000	0.81
日本	株式	中外製薬	医薬品	45,300	3,102.35	140,536,606	5,765.00	261,154,500	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,946,900	161.65	314,719,770	132.20	257,380,180	0.80
日本	株式	S M C	機械	4,600	45,672.98	210,095,708	55,180.00	253,828,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	35,000	7,702.53	269,588,700	7,196.00	251,860,000	0.78
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,200	22,301.28	205,171,776	26,440.00	243,248,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	50,700	5,525.33	280,134,540	4,698.00	238,188,600	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	69,800	4,075.86	284,495,587	3,403.00	237,529,400	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	98,000	2,282.52	223,687,250	2,321.50	227,507,000	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	125,900	1,753.51	220,767,793	1,799.50	226,557,050	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	93,900	2,697.22	253,268,958	2,270.00	213,153,000	0.66

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.55
		食料品	3.87
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.18
		医薬品	6.78
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.54
		機械	5.19

	電気機器	14.85
	輸送用機器	7.15
	精密機器	2.60
	その他製品	2.45
	電気・ガス業	1.53
	陸運業	3.95
	海運業	0.13
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.79
	卸売業	4.39
	小売業	4.90
	銀行業	4.86
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	1.97
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.98
	サービス業	5.19
合 計		98.29

## 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 2020年09月	買建	38	日本円	599,890,900	592,230,000	1.83

(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2020年6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	153,422,998,152	65.37
	カナダ	7,995,316,721	3.41
	ドイツ	7,251,061,669	3.09
	イタリア	1,527,130,750	0.65

	フランス	8,056,697,839	3.43
	オランダ	4,228,104,362	1.80
	スペイン	1,955,916,225	0.83
	ベルギー	738,570,081	0.31
	オーストリア	144,815,654	0.06
	ルクセンブルク	145,393,919	0.06
	フィンランド	919,075,443	0.39
	アイルランド	4,178,633,576	1.78
	ポルトガル	149,421,619	0.06
	イギリス	10,567,577,777	4.50
	スイス	8,852,944,543	3.77
	スウェーデン	2,318,857,801	0.99
	ノルウェー	426,710,217	0.18
	デンマーク	1,865,922,349	0.80
	ケイマン	455,799,239	0.19
	オーストラリア	4,806,410,576	2.05
	バミューダ	349,975,811	0.15
	ニュージーランド	245,510,735	0.10
	パプアニューギニア	17,314,372	0.01
	香港	2,098,023,369	0.89
	シンガポール	750,149,181	0.32
	イスラエル	505,556,267	0.22
	ジャージー	524,890,000	0.22
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	39,164,672	0.02
	小計	224,537,942,919	95.67
投資証券	アメリカ	4,881,777,748	2.08
	カナダ	39,002,501	0.02
	フランス	135,548,065	0.06
	イギリス	123,754,098	0.05
	オーストラリア	351,317,606	0.15
	香港	114,307,762	0.05
	シンガポール	129,480,213	0.06
	小計	5,775,187,993	2.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,387,637,981	1.87
合計（純資産総額）		234,700,768,893	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	3,776,130,777	1.61
	買建	ドイツ	830,160,804	0.35

(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		2,609,738,000	1.11
	売建		26,938,650	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	245,982	27,611.60	6,791,958,362	38,978.17	9,587,929,984	4.09
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	406,214	15,663.24	6,362,627,861	21,379.92	8,684,825,098	3.70
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	23,785	192,138.12	4,570,005,398	288,784.14	6,868,730,798	2.93
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	135,280	20,521.23	2,776,113,050	23,771.75	3,215,842,827	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	17,272	138,478.22	2,391,795,850	150,294.06	2,595,879,139	1.11
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,850	138,344.62	2,331,106,921	150,531.09	2,536,448,964	1.08
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	148,021	14,171.04	2,097,611,837	14,980.16	2,217,379,684	0.94
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	167,543	11,840.54	1,983,800,867	11,879.04	1,990,250,401	0.85
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	95,832	19,399.66	1,859,108,639	20,619.28	1,975,986,956	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	138,739	13,226.16	1,834,984,545	12,676.68	1,758,751,072	0.75
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	172,650	13,558.00	2,340,788,976	10,019.82	1,729,921,923	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	53,270	27,301.31	1,454,341,104	31,218.74	1,663,022,408	0.71
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	61,260	25,001.06	1,531,565,365	26,516.96	1,624,429,509	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	50,250	29,748.09	1,494,841,593	31,560.27	1,585,903,980	0.68
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	240,522	6,140.10	1,476,829,757	6,278.00	1,509,999,473	0.64
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	39,468	33,878.82	1,337,129,292	37,526.76	1,481,106,519	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	77,580	22,804.24	1,769,153,591	19,090.45	1,481,037,158	0.63



アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	232,207	6,455.78	1,499,077,492	5,892.30	1,368,233,445	0.58
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	34,365	23,676.94	813,658,126	39,648.32	1,362,514,517	0.58
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	402,677	3,990.68	1,606,958,916	3,222.50	1,297,628,002	0.55
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	27,059	30,684.35	830,287,881	45,703.30	1,236,685,811	0.53
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	101,352	14,153.80	1,434,516,323	12,015.16	1,217,760,983	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	24,630	31,499.94	775,843,616	48,185.63	1,186,812,254	0.51
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	238,280	4,984.05	1,187,600,006	4,972.20	1,184,776,054	0.50
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	142,363	8,937.03	1,272,302,829	8,201.16	1,167,542,994	0.50
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	121,053	9,861.46	1,193,759,559	9,439.15	1,142,637,594	0.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	237,531	7,221.81	1,715,404,274	4,775.03	1,134,219,266	0.48
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	62,527	11,577.74	723,921,374	18,138.02	1,134,116,539	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	440,869	3,399.19	1,498,600,583	2,520.03	1,111,006,898	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	77,981	14,726.98	1,148,424,674	14,122.55	1,101,291,289	0.47

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	3.39
		素材	4.20
		資本財	6.06
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.14
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.42
		メディア・娯楽	6.38
		小売	5.86
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.53
		家庭用品・パーソナル用品	2.14
		ヘルスケア機器・サービス	5.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.84
		銀行	5.42
各種金融	4.17		

		保険	3.11
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	12.04
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.61
		電気通信サービス	2.17
		公益事業	3.45
		半導体・半導体製造装置	3.82
	投資証券		2.46
	合計		98.13

### 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 EMINI2009	買建	230	米ドル	35,325,237.5	3,805,941,088	35,048,550	3,776,130,777	1.61
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2009	買建	230	ユーロ	6,893,940	834,718,255	6,856,300	830,160,804	0.35

(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	18,500,000.00	1,978,278,490	1,992,129,000	0.85
	ユーロ	買建	5,100,000.00	603,518,500	617,609,000	0.26
	英ポンド	売建	183,000.00	24,245,194	24,247,500	0.01
	スウェーデンクローナ	売建	233,000.00	2,687,599	2,691,150	0.00

(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

2020年6月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………8,350円

純資産総額……………297.60億円

※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、2010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)

2020年2月	2020年3月	2020年4月	2020年5月	2020年6月	最近1年間累計	設定以来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,000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	16.3%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.8%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	6.3%
			日本プロロジスリート投資法人 投資証券	日本	5.6%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	4.8%
			GLP投資法人 投資証券	日本	4.6%
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	15.4%	PROLOGIS INC	アメリカ	6.2%
			EQUINIX INC	アメリカ	5.6%
			DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.5%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.6%
			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	17.0%	第357回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第341回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第140回利付国債(20年)	日本	1.3%
			第153回利付国債(20年)	日本	1.2%
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	17.0%	US TREASURY N/B(8%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(2.75%)	アメリカ	0.5%
			FRANCE (GOVT OF)(1.25%)	フランス	0.5%
			FRANCE (GOVT OF)(4.5%)	フランス	0.5%
			US TREASURY N/B(1.625%)	アメリカ	0.4%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.3%	トヨタ自動車	日本	3.4%
			ソニー	日本	2.1%
			ソフトバンクグループ	日本	1.9%
			キーエンス	日本	1.8%
			日本電信電話	日本	1.5%
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	4.1%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	3.7%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.9%
			FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.4%
			ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.1%
現金その他		2.0%			

\*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。

※2020年は、2020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  
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (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 [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して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。

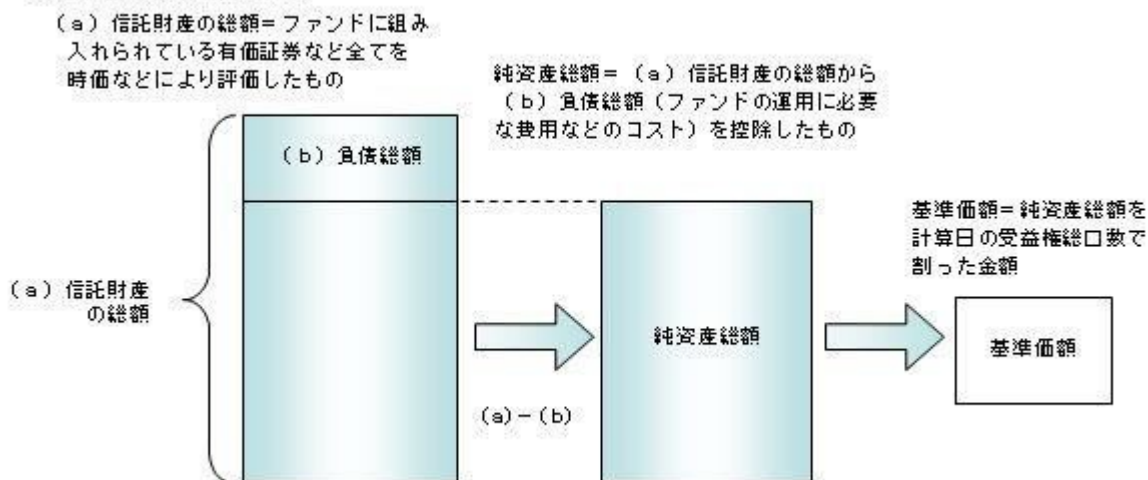
### 3【資産管理等の概要】

#### (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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 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。

## &lt;主な資産の評価方法&gt;

## 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。

## &lt;委託会社の照会先&gt;

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

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

償還金について

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

信託約款の変更

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

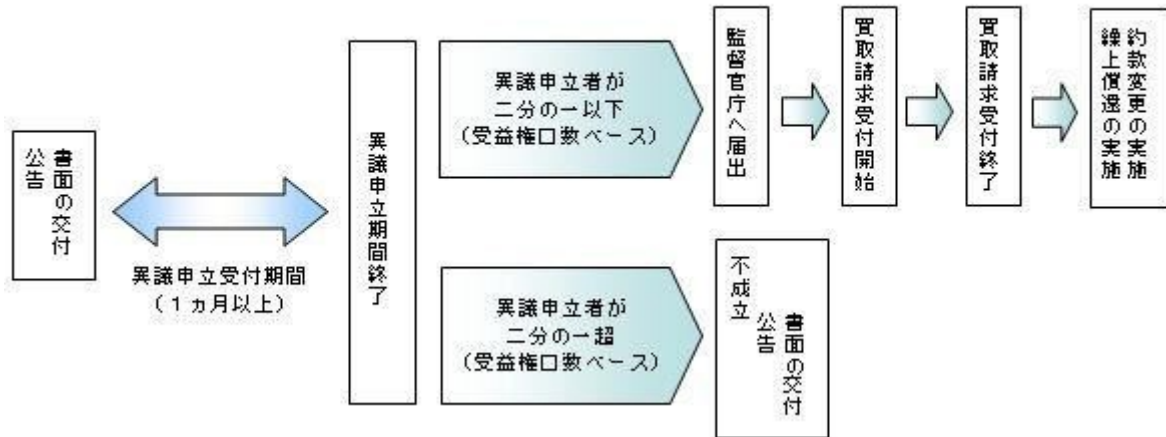
異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告

し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 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 [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

### (2) 解約請求権

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

### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、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、2019年12月17日から2020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 2019年12月16日現在	当期 2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	543,449,367	665,267,678
親投資信託受益証券	32,273,505,515	28,995,277,661
未収入金	20,412,245	2,444,443
流動資産合計	32,837,367,127	29,662,989,782
資産合計	32,837,367,127	29,662,989,782
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	35,945,058	35,584,769
未払解約金	28,676,510	23,826,746
未払受託者報酬	1,534,858	1,369,616
未払委託者報酬	27,627,670	24,653,307
未払利息	630	273
その他未払費用	3,447,919	6,122,046
流動負債合計	97,232,645	91,556,757
負債合計	97,232,645	91,556,757
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	35,945,058,246	35,584,769,481
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,204,923,764	6,013,336,456
（分配準備積立金）	2,485,682,544	3,263,575,925
元本等合計	32,740,134,482	29,571,433,025
純資産合計	32,740,134,482	29,571,433,025
負債純資産合計	32,837,367,127	29,662,989,782

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2019年6月18日	自	2019年12月17日
	至	2019年12月16日	至	2020年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,108,693,214		2,484,225,345
営業収益合計		2,108,693,214		2,484,225,345
営業費用				
支払利息		107,065		85,697
受託者報酬		8,802,727		8,300,682
委託者報酬		158,450,242		149,413,385
その他費用		4,040,440		3,351,485
営業費用合計		171,400,474		161,151,249
営業利益又は営業損失( )		1,937,292,740		2,645,376,594
経常利益又は経常損失( )		1,937,292,740		2,645,376,594
当期純利益又は当期純損失( )		1,937,292,740		2,645,376,594
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( )		15,126,457		20,122,962
期首剰余金又は期首欠損金( )		5,020,349,142		3,204,923,764
剰余金増加額又は欠損金減少額		264,500,103		270,286,028
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		264,500,103		270,286,028
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		152,594,236		239,947,373
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		152,594,236		239,947,373
分配金		218,646,772		213,497,715
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,204,923,764		6,013,336,456

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月16日から翌月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当特定期間は2019年12月17日から2020年 6月15日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

		前期 2019年12月16日現在	当期 2020年 6月15日現在
1.	期首元本額	36,865,082,059円	35,945,058,246円
	期中追加設定元本額	1,375,802,750円	1,727,094,985円
	期中一部解約元本額	2,295,826,563円	2,087,383,750円
2.	受益権の総数	35,945,058,246口	35,584,769,481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	3,204,923,764円	6,013,336,456円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日		当期 自 2019年12月17日 至 2020年 6月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2019年 6月18日 至 2019年 7月16日		自 2019年12月17日 至 2020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	67,450,869円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 69,680,913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 349,535,548円
C	信託約款に定める収益調整金	465,648,100円	C 信託約款に定める収益調整金 536,242,032円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,399,681,846円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 2,453,614,862円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	1,932,780,815円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 3,409,073,355円
F	分配対象収益(1万口当たり)	525円	F 分配対象収益(1万口当たり) 952円
G	分配金額	36,808,705円	G 分配金額 35,807,761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 2019年 7月17日 至 2019年 8月15日		自 2020年 1月16日 至 2020年 2月17日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	21,841,427円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 48,900,190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	482,921,287円
C	信託約款に定める収益調整金	475,084,633円	C	信託約款に定める収益調整金	563,958,711円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,418,052,428円	D	信託約款に定める分配準備積立金	2,808,544,640円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,914,978,488円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,904,324,828円
F	分配対象収益(1万口当たり)	521円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,090円
G	分配金額	36,740,653円	G	分配金額	35,791,550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 2019年 8月16日			自 2020年 2月18日	
	至 2019年 9月17日			至 2020年 3月16日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	67,464,871円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	43,070,644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	374,982,667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	481,714,026円	C	信託約款に定める収益調整金	581,872,717円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,391,971,969円	D	信託約款に定める分配準備積立金	3,258,039,212円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,316,133,533円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,882,982,573円
F	分配対象収益(1万口当たり)	632円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,093円
G	分配金額	36,642,375円	G	分配金額	35,517,220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 2019年 9月18日			自 2020年 3月17日	
	至 2019年10月15日			至 2020年 4月15日	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	92,832,100円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	105,843,252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	353,546,520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	489,474,008円	C	信託約款に定める収益調整金	598,517,704円
D	信託約款に定める分配準備積立金	1,778,651,825円	D	信託約款に定める分配準備積立金	3,228,488,720円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,714,504,453円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,932,849,676円
F	分配対象収益(1万口当たり)	744円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,113円
G	分配金額	36,445,367円	G	分配金額	35,321,052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 2019年10月16日			自 2020年 4月16日	
	至 2019年11月15日			至 2020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	40,590,192円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	18,349,787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	162,467,765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	498,705,707円	C	信託約款に定める収益調整金	628,724,829円
D	信託約款に定める分配準備積立金	2,152,429,639円	D	信託約款に定める分配準備積立金	3,286,170,817円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	2,854,193,303円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,933,245,433円
F	分配対象収益(1万口当たり)	791円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,108円
G	分配金額	36,064,614円	G	分配金額	35,475,363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 2019年11月16日 至 2019年12月16日		自 2020年 5月16日 至 2020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	40,437,944円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 46,045,621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	186,206,229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	514,538,203円	C 信託約款に定める収益調整金 656,978,692円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	2,294,983,429円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 3,253,115,073円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,036,165,805円	E 分配対象収益（A+B+C+D） 3,956,139,386円
F	分配対象収益(1万口当たり)	844円	F 分配対象収益(1万口当たり) 1,111円
G	分配金額	35,945,058円	G 分配金額 35,584,769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 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	当期 自 2019年12月17日 至 2020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 2019年12月16日現在	当期 2020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）

前期（2019年12月16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	257,656,130
合計	257,656,130

当期（2020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	1,608,171,770
合計	1,608,171,770

（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 2019年12月16日現在		当期 2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	0.9108円	1口当たり純資産額	0.8310円
(1万口当たり純資産額)	(9,108円)	(1万口当たり純資産額)	(8,310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	1,845,422,371	4,723,174,016	
	日本債券インデックスマザーファンド	3,583,741,909	5,079,237,407	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザー ファンド	2,067,198,194	5,007,787,624	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,301,301,090	4,753,873,569	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファン ド	2,406,719,105	4,727,759,009	
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザー ファンド	2,549,155,079	4,703,446,036	
合計		15,753,537,748	28,995,277,661	

(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」-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トップIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド」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」-REITマザーファンド

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,137,932,109	1,517,113,776
投資証券	105,603,484,220	118,932,676,070
未収配当金	386,485,017	713,403,167
流動資産合計	108,127,901,346	121,163,193,013
<b>資産合計</b>		
108,127,901,346		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	1,648,478,800	505,317,940
未払解約金	253,083	1,494,265
未払利息	2,478	623
流動負債合計	1,648,734,361	506,812,828
<b>負債合計</b>		
1,648,734,361		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	43,055,259,887	61,422,081,732
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	63,423,907,098	59,234,298,453
元本等合計	106,479,166,985	120,656,380,185
<b>純資産合計</b>		
106,479,166,985		
<b>負債純資産合計</b>		
108,127,901,346		

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

	<p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
--	--

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
1.	期首	2019年 6月18日	2019年12月17日
	期首元本額	12,341,578,634円	43,055,259,887円
	期首からの追加設定元本額	31,051,272,811円	19,696,083,957円
	期首からの一部解約元本額	337,591,558円	1,329,262,112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	2,117,390,908円	2,406,719,105円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	1,425,714,824円	1,968,221,934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)	148,691,553円	181,324,988円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	39,363,462,602円	56,865,815,705円
	計	43,055,259,887円	61,422,081,732円
2.	受益権の総数	43,055,259,887口	61,422,081,732口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020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

	2019年12月16日現在	2020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）

（2019年12月16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	1,784,881,002
合計	1,784,881,002

（2020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	29,929,756,184
合計	29,929,756,184

(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）

2019年12月16日現在		2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.4731円	1口当たり純資産額	1.9644円
(1万口当たり純資産額)	(24,731円)	(1万口当たり純資産額)	(19,644円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,711	176,404,100	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	2,039	194,520,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	3,134	386,735,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	4,675	2,931,225,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	18,050	1,422,340,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	16,186	2,225,575,000	
	産業ファンド投資法人 投資証券	18,118	2,933,304,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	13,344	3,952,492,800	
	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	9,178	1,626,341,600	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	7,050	2,580,300,000	
	G L P 投資法人 投資証券	35,040	4,835,520,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	6,125	1,901,812,500	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	21,170	6,243,033,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	2,141	937,758,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	2,193	553,732,500	
	イオンリート投資法人 投資証券	15,183	1,661,020,200	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	11,965	1,572,201,000	
	日本リート投資法人 投資証券	4,570	1,553,800,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	90,384	1,317,798,720	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	41,135	2,780,726,000	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	3,062	308,343,400		

ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	5,434	1,067,781,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	3,001	360,720,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,816	286,387,200	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	45,418	6,195,015,200	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	2,331	159,673,500	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	13,080	2,014,320,000	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,669	425,812,800	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	1,387	151,183,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	4,004	1,795,794,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	2,390	157,979,000	
さくら総合リート投資法人 投資証券	3,044	238,954,000	
投資法人みらい 投資証券	15,999	617,561,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	3,301	318,876,600	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,769	1,071,603,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,645	385,641,000	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	2,042	193,990,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	3,993	353,779,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,928	377,419,200	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	13,624	8,828,352,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	14,069	7,808,295,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	26,589	3,661,305,300	
オリックス不動産投資法人 投資証券	28,032	3,958,118,400	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	9,246	2,967,966,000	
プレミア投資法人 投資証券	12,707	1,410,477,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	9,432	1,364,810,400	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	9,769	929,031,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	31,589	3,667,482,900	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	10,055	1,300,111,500	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	61,711	1,851,330,000	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	4,997	1,703,977,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	8,761	900,630,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	9,192	2,576,517,600	
福岡リート投資法人 投資証券	7,276	894,220,400	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	4,352	2,524,160,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	10,894	803,977,200	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	3,247	1,896,248,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	6,355	810,898,000	
スターツプロシード投資法人 投資証券	2,191	433,379,800	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	20,073	5,140,695,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	45,321	1,964,665,350	
大和証券リビング投資法人 投資証券	17,223	1,622,406,600	

ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	13,013	1,646,144,500	
合計	827,422	118,932,676,070	

(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)

	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,090,679,776	898,076,396
コール・ローン	15,065,737	22,392,474
投資証券	103,640,526,687	122,097,710,179
派生商品評価勘定	80,960	-
未収入金	848,757	4,220,058
未収配当金	142,080,344	233,141,884
流動資産合計	105,889,282,261	123,255,540,991
資産合計	105,889,282,261	123,255,540,991
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	87,290	-
未払金	1,766,459,274	-
未払解約金	1,295,531	3,617,826
未払利息	17	9
流動負債合計	1,767,842,112	3,617,835
負債合計	1,767,842,112	3,617,835
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	46,765,012,186	66,801,185,885
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	57,356,427,963	56,450,737,271
元本等合計	104,121,440,149	123,251,923,156
純資産合計	104,121,440,149	123,251,923,156
負債純資産合計	105,889,282,261	123,255,540,991

### 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	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>(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）

		2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
1.	期首	2019年 6月18日	2019年12月17日
	期首元本額	11,583,284,463円	46,765,012,186円
	期首からの追加設定元本額	35,281,967,091円	27,028,887,770円
	期首からの一部解約元本額	100,239,368円	6,992,714,071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	2,375,450,506円	2,549,155,079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）	37,595,546円	38,770,776円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	43,962,661,649円	63,859,067,842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）	389,304,485円	354,192,188円
	計	46,765,012,186円	66,801,185,885円
2.	受益権の総数	46,765,012,186口	66,801,185,885口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020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、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

	2019年12月16日現在	2020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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019年12月16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	1,636,797,497
合計	1,636,797,497

(2020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	21,930,092,534
合計	21,930,092,534

(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)

(2019年12月16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	2,702,734,230	-	2,702,727,900	6,330
	米ドル	2,013,247,040	-	2,013,328,000	80,960
	加ドル	49,820,400	-	49,818,000	2,400
	ユーロ	164,347,650	-	164,335,500	12,150
	英ポンド	149,056,680	-	149,042,400	14,280
	豪ドル	180,654,000	-	180,624,000	30,000
	香港ドル	30,868,200	-	30,844,000	24,200
	シンガポールドル	114,740,260	-	114,736,000	4,260
合計	2,702,734,230	-	2,702,727,900	6,330	

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2020年 6月15日現在)

該当事項はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報 )

2019年12月16日現在		2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2,2265円	1口当たり純資産額	1,8451円
(1万口当たり純資産額)	(22,265円)	(1万口当たり純資産額)	(18,451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	89,866	1,274,299.88	
		AGREE REALTY CORPORATION	49,459	3,289,518.09	
		ALEXANDER'S INC	2,380	614,682.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	126,710	20,181,101.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	48,256	1,445,267.20	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	141,554	5,131,332.50
AMERICAN FINANCE TRUST INC	106,526	905,471.00
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	263,685	7,159,047.75
AMERICOLD REALTY TRUST	198,580	6,912,569.80
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	154,369	6,086,769.67
APPLE HOSPITALITY REIT INC	214,208	2,407,697.92
ARA US HOSPITALITY TRUST	508,600	211,069.00
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	69,601	62,640.90
AVALONBAY COMMUNITIES INC	144,381	23,642,388.75
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	17,952	150,796.80
BOSTON PROPERTIES INC	148,877	14,372,585.58
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	29,628	119,104.56
BRANDYWINE REALTY TRUST	180,214	1,937,300.50
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	308,799	4,153,346.55
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	65,149	767,455.22
BRT APARTMENTS CORP	8,589	98,258.16
CAMDEN PROPERTY TRUST	100,060	9,536,718.60
CARETRUST REIT INC	97,314	1,826,583.78
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	173,000	57,591.70
CEDAR REALTY TRUST INC	78,090	96,050.70
CHATHAM LODGING TRUST	47,094	362,152.86
CITY OFFICE REIT INC	59,231	592,902.31
CLIPPER REALTY INC	14,467	107,923.82
COLONY CAPITAL INC-A	490,200	1,348,050.00
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	118,477	1,642,091.22
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	21,156	839,046.96
CORECIVIC INC	119,536	1,479,855.68
COREPOINT LODGING INC	39,191	160,291.19
CORESITE REALTY CORP	41,856	4,995,513.60
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	114,243	2,944,042.11
COUSINS PROPERTIES INC	151,629	4,861,225.74
CUBESMART	200,709	5,573,688.93
CYRUSONE INC	117,078	8,516,253.72
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	202,297	1,300,769.71
DIGITAL REALTY TRUST INC	271,772	36,960,992.00
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	247,030	1,112,870.15
DOUGLAS EMMETT INC	171,295	5,322,135.65
DUKE REALTY CORPORATION	379,978	13,432,222.30
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	76,062	1,818,642.42
EASTGROUP PROPERTIES INC	39,878	4,781,770.98
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	167,877	1,205,356.86

EPR PROPERTIES	80,367	2,954,290.92
EQUINIX INC	91,129	61,661,526.56
EQUITY COMMONWEALTH	127,196	4,211,459.56
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	187,943	11,932,501.07
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	361,089	22,954,427.73
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	90,375	1,549,931.25
ESSEX PROPERTY TRUST INC	68,306	17,054,642.08
EXTRA SPACE STORAGE INC	134,161	12,974,710.31
FARMLAND PARTNERS INC	29,438	200,767.16
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	72,938	6,598,700.86
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	131,325	5,130,867.75
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	69,952	1,617,290.24
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	104,190	558,458.40
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	49,738	402,877.80
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	210,417	8,054,762.76
GEO GROUP INC/THE	125,985	1,600,009.50
GETTY REALTY CORPORATION	34,583	1,016,740.20
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	31,902	581,254.44
GLADSTONE LAND CORP	15,696	240,933.60
GLOBAL MEDICAL REIT INC	43,860	519,741.00
GLOBAL NET LEASE INC	93,351	1,446,940.50
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	138,925	4,299,728.75
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	214,886	5,838,452.62
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	511,166	14,046,841.68
HERSHA HOSPITALITY TRUST	34,886	255,016.66
HIGHWOODS PROPERTIES INC	107,231	4,225,973.71
HOST HOTELS & RESORTS INC	742,360	9,383,430.40
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	160,150	4,192,727.00
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	91,018	1,027,593.22
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	69,829	1,393,088.55
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,126	1,542,881.34
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	12,487	894,693.55
INVITATION HOMES INC	555,976	15,383,855.92
IRON MOUNTAIN INC	298,022	8,290,972.04
JBG SMITH PROPERTIES	122,273	3,763,562.94
KILROY REALTY CORPORATION	101,131	6,391,479.20
KIMCO REALTY CORPORATION	437,007	6,013,216.32
KITE REALTY GROUP TRUST	89,841	1,079,888.82
LEXINGTON REALTY TRUST	253,889	2,599,823.36
LIFE STORAGE INC	48,344	4,662,778.80
LTC PROPERTIES INC	39,953	1,503,031.86
MACERICH CO/THE	118,260	1,154,217.60
MACK-CALI REALTY CORPORATION	93,843	1,543,717.35

MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,531,347	1,156,166.98	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	533,196	10,333,338.48	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	117,773	14,024,408.84	
MONMOUTH RE INVST CORP	103,862	1,399,021.14	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	177,669	6,332,123.16	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	61,421	1,850,000.52	
NATL HEALTH INVESTORS INC	44,309	2,622,649.71	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	77,470	273,469.10	
NEXPOINT RESIDENTIAL	23,528	816,186.32	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	50,703	1,420,444.54	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	225,499	6,830,364.71	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	14,450	258,510.50	
PARAMOUNT GROUP INC	213,208	1,714,192.32	
PARK HOTELS & RESORTS INC	244,338	2,831,877.42	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	138,927	2,072,790.84	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	51,295	77,455.45	
PHYSICIANS REALTY TRUST	203,447	3,596,942.96	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	128,190	2,229,224.10	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,352	192,669.36	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	53,602	426,671.92	
PRIME US REIT	443,700	348,304.50	
PROLOGIS INC	762,430	72,019,137.80	
PS BUSINESS PARKS INC	20,593	2,720,335.30	
PUBLIC STORAGE	155,423	30,535,956.81	
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	60,059	3,744,078.06	
REALTY INCOME CORP	353,890	21,385,572.70	
REGENCY CENTERS CORP	173,545	8,311,070.05	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	119,766	1,377,309.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	220,315	1,489,329.40	
RETAIL VALUE INC	15,006	202,430.94	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	120,948	4,957,658.52	
RLJ LODGING TRUST	172,667	1,918,330.37	
RPT REALTY	87,745	645,803.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	55,399	2,077,462.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	210,098	3,084,238.64	
SAFEHOLD INC	14,491	887,573.75	
SAUL CENTERS INC	14,017	483,306.16	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	32,666	454,384.06	
SERVICE PROPERTIES TRUST	170,694	1,671,094.26	
SIMON PROPERTY GROUP INC	317,260	24,105,414.80	
SITE CENTERS CORP	150,220	1,207,768.80	
SL GREEN REALTY CORP	84,643	4,418,364.60	

		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	102,353	3,553,696.16
		STAG INDUSTRIAL INC	154,288	4,269,148.96
		STORE CAPITAL CORP	221,228	5,209,919.40
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	111,725	812,240.75
		SUN COMMUNITIES INC	95,724	13,251,073.32
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	240,520	2,347,475.20
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	101,172	781,047.84
		TAUBMAN CENTERS INC	62,740	2,326,399.20
		TERRENO REALTY CORP	68,959	3,607,934.88
		UDR INC	303,328	11,857,091.52
		UMH PROPERTIES INC	36,290	465,600.70
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	13,142	1,198,813.24
		URBAN EDGE PROPERTIES	120,810	1,344,615.30
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	28,476	370,188.00
		VENTAS INC	384,977	15,171,943.57
		VEREIT INC	1,102,994	7,180,490.94
		VICI PROPERTIES INC	475,181	10,591,784.49
		VORNADO REALTY TRUST	164,007	6,588,161.19
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	170,835	181,085.10
		WASHINGTON REIT	82,490	1,903,869.20
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	123,872	2,508,408.00
		WELLTOWER INC	419,277	23,160,861.48
		WHITESTONE REIT	40,197	293,036.13
		WP CAREY INC	177,849	12,291,144.39
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	120,298	1,384,629.98
米ドル小計			26,016,040	855,769,939.93 (91,772,768,358)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	60,875	2,553,097.50
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	74,735	594,890.60
		BOARDWALK EQUITIES INC	24,287	723,752.60
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	86,153	4,229,250.77
		CHOICE PROPERTIES REIT	161,158	2,075,715.04
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	100,816	829,715.68
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	47,991	625,322.73
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	56,253	767,853.45
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	74,053	798,291.34
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	28,642	609,215.34
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	115,372	1,694,814.68
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	29,975	2,001,131.00
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	142,643	1,516,295.09
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	66,761	971,372.55
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	51,989	926,963.87



		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	18,885	399,417.75
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	19,569	301,362.60
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	33,673	1,165,085.80
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	85,916	940,780.20
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	161,945	2,698,003.70
		SLATE OFFICE REIT	26,167	99,957.94
		SLATE RETAIL REIT	22,843	232,313.31
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	70,090	1,518,850.30
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	65,461	749,528.45
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	46,848	266,565.12
加ドル小計			1,673,100	29,289,547.41 (2,303,915,799)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	27,704	2,684,517.60
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	167,774	2,271,659.96
		ALTAREA	3,531	497,164.80
		BEFIMMO S.C.A.	25,196	1,014,139.00
		COFINIMMO	25,565	3,185,399.00
		COVIVIO	45,405	2,969,487.00
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	45,493	585,949.84
		GECINA SA	56,447	6,581,720.20
		HAMBORNER REIT AG	75,189	644,520.10
		HIBERNIA REIT PLC	710,978	766,434.28
		ICADE	29,970	1,963,035.00
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	43,281	148,237.42
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	247,780	2,025,601.50
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	23,141	527,614.80
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	453,415	620,271.72
		KLEPIERRE	215,996	3,975,406.38
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	75,281	368,500.49
		MERCIALYS	27,706	221,648.00
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	381,759	3,073,159.95
		MONTEA	11,663	1,038,007.00
		NSI NV	17,699	647,783.40
		RETAIL ESTATES	12,038	706,630.60
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	142,484	8,170,032.56
		VASTNED RETAIL	19,408	388,160.00
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	133,286	3,274,170.59
		WERELDHAVE NV	39,757	329,386.74
ユーロ小計			3,057,946	48,678,637.93 (5,874,538,025)
英ポンド	投資証券	AEW UK REIT PLC	185,068	123,995.56
		ASSURA PLC	2,461,762	1,979,256.64

		BIG YELLOW GROUP PLC	158,176	1,583,341.76	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	875,991	661,373.20	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	975,566	4,028,112.01	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	881,708	1,483,914.56	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	46,776	48,179.28	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	637,751	687,495.57	
		DERWENT LONDON PLC	108,779	3,269,896.74	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	660,347	390,265.07	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	268,732	1,760,732.06	
		HAMMERSON PLC	825,866	914,233.66	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	56,336.89	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	778,442	4,823,226.63	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	861,956	1,782,525.00	
		LXI REIT PLC	536,666	597,845.92	
		NEWRIVER REIT PLC	309,118	207,418.17	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	576,224	394,713.44	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	1,242,132	1,897,977.69	
		RDI REIT PLC	251,985	194,028.45	
		REGIONAL REIT LTD	441,862	349,954.70	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	215,184	1,500,908.40	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	567,740	193,315.47	
		SEGRO PLC	1,132,401	9,870,007.11	
		SHAFTESBURY PLC	227,465	1,327,258.27	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	389,992	370,492.40	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,771,606	2,462,532.34	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	872,860	565,613.28	
		UNITE GROUP PLC	374,912	3,434,193.92	
		WORKSPACE GROUP PLC	133,065	924,136.42	
英債券小計			19,528,878	47,883,280.61	(6,423,063,261)
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	420,369	1,105,570.47	
		APN INDUSTRIA REIT	131,024	331,490.72	
		ARENA REIT	316,817	731,847.27	
		BWP TRUST	534,748	2,037,389.88	
		CENTURIA OFFICE REIT	402,389	778,622.71	
		CHARTER HALL GROUP	477,864	4,601,830.32	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	479,800	2,125,514.00	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	513,056	1,734,129.28	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	260,414	624,993.60	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	2,149,496	1,827,071.60	
		DEXUS	1,129,607	10,889,411.48	
		GDI PROPERTY GROUP	556,405	634,301.70	

		GOODMAN GROUP	1,655,420	24,433,999.20	
		GPT GROUP	1,999,488	8,537,813.76	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	324,354	1,018,471.56	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	184,378	499,664.38	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	252,992	1,080,275.84	
		MIRVAC GROUP	4,099,925	9,675,823.00	
		NATIONAL STORAGE REIT	1,077,345	1,998,474.97	
		RURAL FUNDS GROUP	347,421	691,367.79	
		SCENTRE GROUP	5,509,135	12,615,919.15	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	1,160,256	2,680,191.36	
		STOCKLAND	2,517,615	9,088,590.15	
		VICINITY CENTRES	4,162,304	6,576,440.32	
		WAYPOINT REIT LTD	764,298	2,040,675.66	
豪ドル小計			31,426,920	108,359,880.17 (7,916,772,845)	
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	1,356,002	2,834,044.18	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	562,283	1,428,198.82	
ニュージーランドドル小計			1,918,285	4,262,243.00 (292,986,583)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	2,279,000	9,321,110.00	
		FORTUNE REIT	1,531,000	10,563,900.00	
		LINK REIT	2,176,600	146,049,860.00	
		PROSPERITY REIT	1,365,000	3,112,200.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,075,000	4,224,750.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,516,000	5,412,120.00	
香港ドル小計			10,143,600	179,558,290.00 (2,485,086,733)	
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	513,125	636,275.00	
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	945,758	501,251.74	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	3,113,803	9,652,789.30	
		ASCOTT TRUST	1,992,392	2,052,163.76	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,988,950	5,260,552.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	2,970,100	6,088,705.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	793,757	1,055,696.81	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	965,900	1,072,149.00	
		ESR REIT	2,196,259	878,503.60	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	908,800	481,664.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	499,700	349,790.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	794,689	1,899,306.71	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	738,400	361,816.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	2,452,160	2,819,984.00	

		KEPPEL DC REIT	1,237,177	3,031,083.65	
		KEPPEL REIT	2,105,600	2,421,440.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	2,272,200	324,924.60	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,216,131	4,520,907.24	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,548,460	4,149,872.80	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	3,098,544	5,856,248.16	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	2,344,400	2,227,180.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	2,630,835	1,052,334.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	404,300	1,370,577.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	794,200	285,912.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	513,200	392,598.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	787,121	303,041.58	
		SPH REIT	916,800	797,616.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	1,438,200	769,437.00	
		SUNTEC REIT	2,403,500	3,533,145.00	
シンガポールドル小計			46,584,461	64,146,963.95 (4,930,335,649)	
韓国ウォン	投資証券	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	31,767	214,427,250.00	
韓国ウォン小計			31,767	214,427,250.00 (19,041,139)	
イスラエルシェケル	投資証券	REIT 1 LTD	179,032	2,567,318.88	
イスラエルシェケル小計			179,032	2,567,318.88 (79,201,787)	
合計				122,097,710,179 (122,097,710,179)	

(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 157銘柄	100.0%	75.2%
加ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.8%
英ポンド	投資証券 30銘柄	100.0%	5.3%
豪ドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	4.0%

韓国ウォン	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 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)

	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	160,054,431	374,560,095
国債証券	32,347,227,948	32,320,230,613
地方債証券	2,961,506,000	2,341,367,904
特殊債券	3,840,682,000	4,720,434,000
社債券	2,853,513,000	2,640,052,797
未収利息	128,977,592	133,063,744
前払費用	9,829,961	4,596,943
流動資産合計	42,301,790,932	42,534,306,096
資産合計	42,301,790,932	42,534,306,096
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,007,873	13,830,755
未払利息	185	153
流動負債合計	6,008,058	13,830,908
負債合計	6,008,058	13,830,908
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	29,684,235,525	30,001,805,725
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	12,611,547,349	12,518,669,463
元本等合計	42,295,782,874	42,520,475,188
純資産合計	42,295,782,874	42,520,475,188
負債純資産合計	42,301,790,932	42,534,306,096

### 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	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券
-----------------	--

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
1.	期首	2019年 6月18日	2019年12月17日
	期首元本額	28,211,704,088円	29,684,235,525円
	期首からの追加設定元本額	2,296,486,999円	3,954,534,697円
	期首からの一部解約元本額	823,955,562円	3,636,964,497円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	2,711,935,582円	2,946,155,317円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,460,688,105円	2,697,323,344円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,778,194,324円	1,859,754,334円
	DCインデックスバランス（株式80）	276,183,838円	287,488,273円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,002,645,688円	2,073,710,149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	3,618,654,809円	3,583,741,909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）	1,528,015,066円	1,537,869,260円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,566,941円	4,704,855円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	25,357,624円	24,864,342円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	103,185,100円	98,908,276円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	277,082,222円	258,806,689円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,405,738,768円	4,172,942,545円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,345,192,939円	1,335,275,108円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,299,476,380円	1,287,134,515円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	695,140,125円	689,262,911円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	101,804,423円	92,260,655円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,744,323,330円	6,741,107,325円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	306,050,261円	310,495,918円
	計	29,684,235,525円	30,001,805,725円
2.	受益権の総数	29,684,235,525口	30,001,805,725口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020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

	2019年12月16日現在	2020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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左



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

（有価証券に関する注記）

（2019年12月16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	242,376,418
地方債証券	1,540,000
特殊債券	2,481,000
社債券	2,536,000
合計	248,933,418

（2020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	593,415,622
地方債証券	10,040,096
特殊債券	17,905,000
社債券	13,646,203
合計	635,006,921

(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）

2019年12月16日現在		2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.4249円	1口当たり純資産額	1.4173円
(1万口当たり純資産額)	(14,249円)	(1万口当たり純資産額)	(14,173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回利付国債(40年)	70,000,000	104,586,300	
	第2回利付国債(40年)	95,000,000	138,212,650	
	第3回利付国債(40年)	70,000,000	102,687,900	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	140,678,850	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	50,214,150	
	第6回利付国債(40年)	70,000,000	99,119,300	
	第7回利付国債(40年)	50,000,000	68,216,500	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	121,396,700	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	124,731,100	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	140,525,000	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	153,097,000	
	第12回利付国債(40年)	155,000,000	153,504,250	
	第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,067,402	
	第312回利付国債(10年)	155,000,000	156,042,941	
	第313回利付国債(10年)	370,000,000	374,322,760	
	第315回利付国債(10年)	65,000,000	65,901,550	
	第316回利付国債(10年)	35,000,000	35,450,100	
	第317回利付国債(10年)	105,000,000	106,681,050	
	第318回利付国債(10年)	185,000,000	187,726,900	
	第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,096,250	
	第320回利付国債(10年)	190,000,000	193,368,700	
	第321回利付国債(10年)	175,000,000	178,596,250	
	第322回利付国債(10年)	75,000,000	76,408,500	
	第323回利付国債(10年)	45,000,000	45,966,600	
	第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,486,750	
	第325回利付国債(10年)	210,000,000	214,578,000	
	第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,650,700	
	第327回利付国債(10年)	65,000,000	66,573,650	

第328回利付国債(10年)	115,000,000	117,421,900	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	236,642,400	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	216,577,200	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,980,800	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	215,911,500	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	123,580,800	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	503,445,600	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,305,600	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,585,300	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	399,800,700	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	379,697,700	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	431,680,200	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	716,506,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,696,500	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	248,336,900	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,710,000	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	618,802,300	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	497,345,100	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	162,488,000	
第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,416,600	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	497,791,000	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	487,502,400	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	441,668,550	
第352回利付国債(10年)	390,000,000	395,838,300	
第353回利付国債(10年)	200,000,000	202,824,000	
第355回利付国債(10年)	150,000,000	151,830,000	
第356回利付国債(10年)	100,000,000	101,113,000	
第357回利付国債(10年)	660,000,000	666,910,200	
第358回利付国債(10年)	100,000,000	100,975,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	63,026,500	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	140,568,480	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	193,872,420	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	46,291,350	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	143,115,500	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,240,000	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	53,849,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	74,279,700	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	92,053,640	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,522,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	228,789,400	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,699,550	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	129,412,620	

第29回利付国債(30年)	176,000,000	240,618,400	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	199,211,460	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	161,372,400	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	68,461,500	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	177,988,050	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	272,660,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	223,298,880	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	180,219,600	
第37回利付国債(30年)	131,000,000	172,757,560	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	123,646,300	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	99,438,750	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	117,440,100	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	51,396,000	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	173,642,400	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	199,798,100	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	193,554,000	
第45回利付国債(30年)	160,000,000	199,288,000	
第46回利付国債(30年)	250,000,000	311,600,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	146,209,850	
第48回利付国債(30年)	15,000,000	18,378,300	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	110,323,800	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	27,019,750	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	67,085,900	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	90,630,900	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	108,217,200	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	118,910,000	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	118,841,800	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	54,052,500	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	108,039,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	107,970,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	179,234,400	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	132,873,600	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	73,769,500	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	120,000,000	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	87,498,000	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	97,075,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	106,758,300	
第66回利付国債(30年)	130,000,000	126,141,600	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	21,141,000	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	100,344,720	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	58,021,302	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	240,883,908	

第5 1 回利付国債(20年)	39,000,000	39,861,120	
第5 4 回利付国債(20年)	15,000,000	15,537,750	
第5 5 回利付国債(20年)	66,000,000	68,524,500	
第5 7 回利付国債(20年)	52,000,000	54,166,320	
第5 8 回利付国債(20年)	135,000,000	141,315,300	
第5 9 回利付国債(20年)	33,000,000	34,548,030	
第6 0 回利付国債(20年)	295,000,000	306,608,250	
第6 1 回利付国債(20年)	27,000,000	27,867,780	
第6 3 回利付国債(20年)	31,000,000	32,833,340	
第6 4 回利付国債(20年)	54,000,000	57,629,880	
第6 5 回利付国債(20年)	100,000,000	107,219,000	
第6 6 回利付国債(20年)	34,000,000	36,334,440	
第6 7 回利付国債(20年)	34,000,000	36,620,720	
第6 8 回利付国債(20年)	78,000,000	84,896,760	
第7 0 回利付国債(20年)	104,000,000	114,631,920	
第7 2 回利付国債(20年)	112,000,000	122,731,840	
第7 3 回利付国債(20年)	113,000,000	123,896,590	
第7 4 回利付国債(20年)	118,000,000	129,913,280	
第7 5 回利付国債(20年)	10,000,000	11,062,500	
第7 6 回利付国債(20年)	21,000,000	23,030,280	
第7 7 回利付国債(20年)	40,000,000	44,058,400	
第7 9 回利付国債(20年)	160,000,000	177,054,400	
第8 2 回利付国債(20年)	60,000,000	67,054,800	
第8 7 回利付国債(20年)	130,000,000	147,531,800	
第8 8 回利付国債(20年)	300,000,000	343,956,000	
第9 0 回利付国債(20年)	16,000,000	18,342,400	
第9 1 回利付国債(20年)	250,000,000	288,177,500	
第9 2 回利付国債(20年)	60,000,000	68,719,800	
第9 3 回利付国債(20年)	60,000,000	68,644,200	
第9 4 回利付国債(20年)	50,000,000	57,544,000	
第9 5 回利付国債(20年)	82,000,000	95,996,580	
第9 6 回利付国債(20年)	98,000,000	113,341,900	
第9 7 回利付国債(20年)	45,000,000	52,610,400	
第9 8 回利付国債(20年)	94,000,000	109,209,200	
第9 9 回利付国債(20年)	117,000,000	136,534,320	
第1 0 0 回利付国債(20年)	30,000,000	35,381,400	
第1 0 1 回利付国債(20年)	66,000,000	78,871,320	
第1 0 2 回利付国債(20年)	81,000,000	97,234,830	
第1 0 3 回利付国債(20年)	11,000,000	13,116,070	
第1 0 4 回利付国債(20年)	33,000,000	38,815,590	
第1 0 5 回利付国債(20年)	77,000,000	90,924,680	
第1 0 6 回利付国債(20年)	2,000,000	2,378,300	

第107回利付国債(20年)	130,000,000	154,025,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	156,470,460	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,617,810	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	116,484,760	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,050,750	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	95,439,200	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	347,054,600	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	62,446,800	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	151,302,500	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	66,807,950	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	413,290,990	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,990,100	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,370,300	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	197,031,700	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,222,460	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,088,900	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	237,174,600	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	229,103,900	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	61,536,500	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	126,978,600	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	78,082,550	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	101,178,050	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	178,998,000	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,185,800	
第132回利付国債(20年)	75,000,000	88,859,250	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,886,000	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,948,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,619,900	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	258,654,000	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	237,978,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	139,938,000	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	270,944,600	
第140回利付国債(20年)	448,000,000	534,186,240	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	232,980,150	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	150,886,250	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	111,342,060	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	503,934,200	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	425,762,150	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	162,210,600	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,427,000	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	106,092,900	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	135,744,850	

	第150回利付国債(20年)	90,000,000	105,121,800	
	第151回利付国債(20年)	70,000,000	79,871,400	
	第152回利付国債(20年)	350,000,000	399,602,000	
	第153回利付国債(20年)	380,000,000	439,952,600	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	137,264,400	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	156,028,600	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	112,415,600	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	49,500,500	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	176,091,100	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	157,699,500	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	149,412,200	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	126,030,000	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	73,446,100	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	173,091,600	
	第164回利付国債(20年)	285,000,000	293,866,350	
	第165回利付国債(20年)	60,000,000	61,839,000	
	第166回利付国債(20年)	100,000,000	106,556,000	
	第167回利付国債(20年)	160,000,000	164,601,600	
	第168回利付国債(20年)	100,000,000	101,058,000	
	第169回利付国債(20年)	160,000,000	158,715,200	
	第170回利付国債(20年)	140,000,000	138,735,800	
	第171回利付国債(20年)	170,000,000	168,293,200	
	第172回利付国債(20年)	160,000,000	161,179,200	
国債証券 合計		29,030,000,000	32,320,230,613	
地方債証券	第694回東京都公募公債	200,000,000	202,045,904	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	101,761,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	101,540,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	203,420,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	102,438,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	102,329,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	203,602,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,927,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	102,189,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	101,758,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,255,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	102,616,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	101,841,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,372,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	102,338,000	
	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	205,100,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,011,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,045,000	

	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	101,780,000	
地方債証券 合計		2,300,000,000	2,341,367,904	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,845,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,674,000	
	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,782,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,811,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	204,062,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,668,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,936,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,432,000	
	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	101,734,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,750,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,808,000	
	第17回道路債券	100,000,000	103,833,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,177,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,733,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,740,000	
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,631,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,932,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,516,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,979,000	
	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	101,541,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,598,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,946,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,881,000	
	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,963,000	
	第13回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,467,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,198,000	
	F63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,564,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,602,000	
	F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,997,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,095,000	
	第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	101,736,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,766,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,678,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	102,560,000	
	第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,214,000	



	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,553,000	
	第320回信中金債(5年)	100,000,000	99,994,000	
	第322回信中金債(5年)	200,000,000	200,038,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	100,000,000	
特殊債券 合計		4,600,000,000	4,720,434,000	
社債券	第15回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,590,000	
	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	100,042,365	
	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	102,454,000	
	第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	201,090,000	
	第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,216,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,536,000	
	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	101,491,000	
	第13回株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,703,000	
	第9回三菱UFJ信託銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,153,432	
	第11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)	100,000,000	101,635,000	
	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	103,721,000	
	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	106,305,000	
	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	203,644,000	
	第98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	102,411,000	
	第11回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,639,000	
	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	202,634,000	
	第20回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,290,000	
	第26回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,856,000	
	第20回株式会社NTTドコモ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,675,000	
	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,405,000	
	第34回東京瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	202,562,000	
社債券 合計		2,600,000,000	2,640,052,797	
合計		38,530,000,000	42,022,085,314	

## 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）	
	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	197,300,886	546,418,911
コール・ローン	34,538,790	537,220,656
国債証券	155,328,040,689	150,482,884,267
派生商品評価勘定	276,200	1,855,662
未収利息	1,101,428,172	890,319,840
前払費用	36,576,862	61,160,217
流動資産合計	156,698,161,599	152,519,859,553
資産合計		
	156,698,161,599	152,519,859,553
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,095	10,626
未払金	46,782,088	1,393,901,515
未払解約金	51,359,412	50,692,821
未払利息	40	220
流動負債合計	98,143,635	1,444,605,182
負債合計		
	98,143,635	1,444,605,182
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,299,765,692	62,363,102,520
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	90,300,252,272	88,712,151,851
元本等合計	156,600,017,964	151,075,254,371
純資産合計		
	156,600,017,964	151,075,254,371
負債純資産合計		
	156,698,161,599	152,519,859,553

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

		2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
1.	期首	2019年 6月18日	2019年12月17日
	期首元本額	66,086,660,783円	66,299,765,692円
	期首からの追加設定元本額	1,590,378,198円	5,032,365,581円
	期首からの一部解約元本額	1,377,273,289円	8,969,028,753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）	12,790,110,812円	13,143,792,684円
	DCインデックスバランス（株式20）	253,944,231円	268,009,459円
	DCインデックスバランス（株式40）	333,119,217円	347,145,716円
	DCインデックスバランス（株式60）	432,345,384円	437,833,523円
	DCインデックスバランス（株式80）	335,803,010円	336,249,079円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	25,104,567,167円	22,394,960,745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	2,265,989,077円	2,067,198,194円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	17,268,611,083円	16,381,232,485円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	934,562,861円	999,963,098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）	157,572,835円	152,128,700円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,793,179円	2,709,024円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,091,667円	2,915,674円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,973,217円	6,328,923円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	12,984,044円	11,786,648円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	849,733,630円	511,211,418円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	895,564,737円	804,397,457円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	62,920,476円	59,952,051円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	88,219,709円	82,731,491円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	85,179,386円	80,590,835円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	62,412,673円	54,781,504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	4,085,085,523円	3,947,102,380円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	268,181,774円	270,081,432円
計	66,299,765,692円	62,363,102,520円
2. 受益権の総数	66,299,765,692口	62,363,102,520口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020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

	2019年12月16日現在	2020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。 (2)デリバティブ取引	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引

	「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	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)

(2019年12月16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	1,008,495,714
合計	1,008,495,714

(2020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	4,049,085,267
合計	4,049,085,267

(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)

(2019年12月16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	42,563,495	-	42,561,400	2,095
	米ドル	32,823,000	-	32,823,000	-
	ユーロ	9,740,495	-	9,738,400	2,095
	売建	43,623,405	-	43,347,205	276,200
	米ドル	9,740,495	-	9,739,605	890
	英ポンド	33,882,910	-	33,607,600	275,310
合計		86,186,900	-	85,908,605	274,105

(2020年 6月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	977,331,171	-	979,176,207	1,845,036
	米ドル	422,505,500	-	423,558,500	1,053,000
	加ドル	19,682,480	-	19,741,150	58,670
	メキシコペソ	4,634,710	-	4,726,250	91,540
	ユーロ	401,199,560	-	401,743,720	544,160
	英ポンド	71,583,260	-	71,625,420	42,160
	スウェーデンクローナ	10,815,719	-	10,817,604	1,885
	ポーランドズロチ	6,866,926	-	6,856,300	10,626
	豪ドル	23,245,950	-	23,302,950	57,000
	シンガポールドル	9,143,960	-	9,145,150	1,190
	マレーシアリングット	7,653,106	-	7,659,163	6,057
合計		977,331,171	-	979,176,207	1,845,036

## (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)

2019年12月16日現在		2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.3620円	1口当たり純資産額	2.4225円
(1万口当たり純資産額)	(23,620円)	(1万口当たり純資産額)	(24,225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-2.0%-21/05/31	1,400,000.00	1,424,308.48	
		US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	2,083,456.60	
		US TREASURY N/B-2.625%-21/06/15	1,900,000.00	1,946,646.33	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	1,050,000.00	1,071,143.53	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	1,900,000.00	1,918,517.40	
		US TREASURY N/B-2.625%-21/07/15	3,000,000.00	3,078,750.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,423,183.13	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	5,053,710.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	2,360,000.00	2,413,007.72	
		US TREASURY N/B-2.75%-21/08/15	2,100,000.00	2,162,589.66	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,449,500.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-21/08/31	2,000,000.00	2,031,796.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-21/09/15	7,500,000.00	7,740,380.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,460,702.96	
		US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	2,030,000.00	2,054,344.97	
		US TREASURY N/B-1.5%-21/09/30	2,000,000.00	2,033,867.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-21/10/15	2,000,000.00	2,071,523.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,925,525.56	

US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	2,029,218.60	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,277,255.05	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	4,102,421.60	
US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	613,710.90	
US TREASURY N/B-1.5%-21/11/30	3,370,000.00	3,434,635.25	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	3,120,000.00	3,212,868.67	
US TREASURY N/B-2.5%-22/01/15	5,000,000.00	5,182,031.00	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	4,840,000.00	4,942,660.75	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,575,390.50	
US TREASURY N/B-2.5%-22/02/15	4,000,000.00	4,153,202.80	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,566,259.75	
US TREASURY N/B-1.875%-22/02/28	2,000,000.00	2,057,500.00	
US TREASURY N/B-2.375%-22/03/15	2,000,000.00	2,076,054.60	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,849,746.06	
US TREASURY N/B-2.25%-22/04/15	2,000,000.00	2,075,234.20	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	3,088,125.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,919,640.34	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	2,059,453.00	
US TREASURY N/B-2.125%-22/05/15	1,200,000.00	1,244,226.48	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,532,619.23	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,093,339.60	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,598,486.25	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/30	2,500,000.00	2,579,150.25	
US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,128,750.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	4,080,829.07	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	5,700,000.00	5,903,062.50	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	4,500,000.00	4,639,042.80	
US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,600,000.00	2,673,175.70	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,970,359.28	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	2,750,000.00	2,836,420.67	
US TREASURY N/B-1.5%-22/09/15	1,950,000.00	2,007,319.27	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,676,468.75	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,410,000.00	2,502,493.14	
US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	3,081,855.30	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,118,945.20	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,502,328.08	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,068,515.60	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,560,386.11	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	4,089,896.46	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,081,015.60	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,669,954.93	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,410,013.60	



US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,546,728.45
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,208,136.68
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	937,509.31
US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,016,054.60
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,072,187.40
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,265,995.38
US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	1,500,000.00	1,501,816.35
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,207,011.66
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,861,843.48
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,768,835.80
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,562,402.25
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,397,245.98
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,552,705.05
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,072,949.20
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,096,093.60
US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,236,425.50
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,681,351.43
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,917,641.36
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,593,848.75
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	380,000.00	412,893.75
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,779,720.65
US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	979,769.52
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,342,265.60
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,910,000.00	3,099,320.23
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,974,207.90
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,677,099.50
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,251,601.30
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,144,570.20
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,724,454.65
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,600,931.62
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	3,500,000.00	3,741,855.25
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,757,757.60
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	4,240,000.00	4,538,538.82
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,133,867.00
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,229,687.50
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,280,000.00	3,565,013.96
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,133,643.75
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,459,786.98
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,818,093.11
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,720,000.00	2,926,496.68
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,000,000.00	4,241,406.00
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	5,021,181.85
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,514,601.82

US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,392,853.30
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,588,202.96
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,313,566.20
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,182,713.76
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,957,214.01
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,550,000.00	3,853,899.17
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,200,000.00	1,297,101.48
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	4,000,000.00	4,213,046.80
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	2,066,583.83
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	3,300,000.00	3,514,693.05
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,650,908.10
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,770,000.00	3,953,861.01
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,357,601.35
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,294,204.28
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,881,765.24
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,471,261.54
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,000,000.00	2,004,843.60
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,218,874.88
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,293,592.68
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,000,000.00	1,119,921.80
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,624,078.08
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,440,130.82
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	5,000,000.00	5,688,476.50
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,594,960.92
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,652,192.77
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,496,962.50
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,243,593.60
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	2,077,925.73
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,364,187.50
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	2,000,000.00	2,135,078.00
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	2,000,464.79
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,285,975.31
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	2,000,000.00	2,225,234.20
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	5,640,000.00	6,030,723.97
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	4,000,000.00	4,395,468.40
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,169,531.20
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	4,200,000.00	4,559,296.56
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,250,314.00
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,735,298.31
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,625,328.12
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,521,950.00
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	3,076,617.32

US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,161,328.00
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,129,648.40
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	5,349,280.80
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,218,460.44
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	998,125.00
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,030,000.00	3,410,939.47
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,640,000.00	2,958,088.84
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	4,027,907.59
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,391,778.30
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,654,452.80
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,815,981.54
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	696,328.10
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,962,398.28
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,870,000.00	2,585,786.25
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,439,658.92
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,392,851.50
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,970,000.00	5,809,658.14
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,780,000.00	5,501,481.25
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	4,450,000.00	4,836,245.76
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	4,480,000.00	4,925,637.24
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,160,000.00	4,477,768.67
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,630,081.25
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	978,359.71
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,223,027.32
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	1,034,600.33
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	220,000.00	344,824.21
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	1,124,750.00
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	2,226,712.80
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	2,246,151.45
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,172,138.62
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	1,095,862.50
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,496,051.48
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	2,132,578.08
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,567,669.88
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,471,865.15
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,374,192.14
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,404,093.69
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	673,349.60
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	1,017,812.48
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,542,500.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,692,500.00
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,660,595.57
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	2,020,000.00	2,930,262.50

		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	3,090,832.23
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	4,364,765.40
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	3,373,031.04
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,913,585.83
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	3,060,617.13
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	4,043,402.22
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	4,269,124.80
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,500,000.00	4,582,265.45
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	5,222,800.44
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,445,093.68
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	3,079,687.50
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,531,708.85
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,642,890.60
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,788,531.04
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,628,573.40
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,596,054.60
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,690,391.14
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,740,537.07
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	3,342,234.24
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	5,600,743.91
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	4,307,403.26
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	4,524,415.83
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	4,031,718.60
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,750,000.00	3,282,221.52
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,799,437.50
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	4,206,292.83
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,250,000.00	1,190,576.17
米ドル小計			568,070,000.00	637,125,781.67 (68,325,368,826)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	978,490.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-21/08/01	640,000.00	649,638.40
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,070,000.00	1,077,457.90
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-21/11/01	960,000.00	974,006.40
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/02/01	690,000.00	704,400.30
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,470,000.00	1,476,982.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-22/05/01	1,020,000.00	1,044,143.40
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,028,078.80
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/08/01	250,000.00	249,892.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,691,000.00	1,718,986.05
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,299,217.70
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,057,383.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,170,000.00	1,234,736.10

		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	847,101.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,216,880.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	1,305,000.00	1,369,806.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	860,000.00	896,851.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	1,038,910.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,150,000.00	1,159,073.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,120,000.00	1,194,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	561,734.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	860,000.00	894,443.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	917,000.00	1,027,920.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	870,000.00	1,270,843.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	778,375.64	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,360,000.00	1,454,968.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	865,000.00	1,405,114.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	750,000.00	1,235,872.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	935,000.00	1,467,360.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,145,000.00	1,771,933.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	995,000.00	1,409,706.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	993,000.00	1,242,719.64	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	536,505.85	
	加ドル小計		32,485,000.00	37,274,294.55	(2,931,996,009)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	17,200,000.00	17,448,256.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	16,100,000.00	16,653,429.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	20,700,000.00	21,335,065.65	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	7,600,000.00	7,955,628.69	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,900,000.00	18,488,190.17	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	14,300,000.00	15,861,731.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	19,200,000.00	22,873,550.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	13,650,000.00	13,859,947.23	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	21,800,000.00	24,016,967.34	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	19,370,000.00	22,720,322.36	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	13,352,508.05	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,800,000.00	7,636,838.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	6,100,000.00	8,109,131.07	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,150,000.00	14,125,887.67	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	13,700,000.00	14,656,030.52	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	10,770,000.00	11,829,372.20	
メキシコペソ小計			228,240,000.00	250,922,857.20 (1,194,392,800)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,105,000.00	1,173,417.18	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	930,000.00	1,006,539.93	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,050,000.00	1,167,136.74	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,172,758.17	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	502,457.71	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,050,000.00	1,182,838.12	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	630,000.00	657,353.02	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,010,000.00	1,073,296.70	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	770,000.00	989,361.98	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,116,318.94	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	860,000.00	924,741.66	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,375,000.00	1,992,550.03	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,042,993.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,070,000.00	1,169,102.96	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	1,010,000.00	1,025,415.12	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,300,000.00	1,440,211.50	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	964,699.89	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	2,115,000.00	2,421,869.79	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	1,273,000.00	1,767,006.23	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,995,000.00	3,373,513.08	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	500,768.01	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	945,000.00	1,189,781.63	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	323,212.97	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,150,000.00	1,989,283.80	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	550,000.00	951,283.30	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	950,052.18	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	572,603.85	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	345,000.00	514,482.97	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	591,214.58	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%-21/07/30	1,725,000.00	1,747,293.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%-21/10/31	700,000.00	703,827.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%-22/01/31	1,790,000.00	1,971,482.73	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%-22/04/30	1,430,000.00	1,450,353.19	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%-22/10/31	1,420,000.00	1,445,903.64	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,637,055.67	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 23/04/30	1,000,000.00	1,005,864.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	1,290,000.00	1,311,988.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,540,000.00	1,779,147.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,330,000.00	1,569,943.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,936,912.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	1,090,000.00	1,106,202.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,720,000.00	1,933,529.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 25/01/31	300,000.00	300,515.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,450,000.00	1,564,744.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,630,000.00	2,018,505.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,990,000.00	2,216,244.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,535,000.00	1,703,312.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,380,000.00	1,866,059.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	2,140,000.00	2,295,244.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,720,000.00	1,872,022.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	2,000,000.00	2,076,209.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,725,000.00	1,871,036.77	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,740,000.00	1,885,133.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,450,000.00	1,572,436.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,155,000.00	1,608,961.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,900,000.00	2,799,754.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	2,210,000.00	2,404,645.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,470,000.00	1,487,526.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,900,000.00	1,896,502.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,660,000.00	1,889,592.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,500,000.00	1,599,568.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,707,088.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,450,000.00	1,734,448.53
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,070,000.00	1,211,781.42
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,500,000.00	2,246,833.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,410,000.00	2,358,230.35
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,800,000.00	2,983,978.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	940,000.00	1,695,949.59
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,320,000.00	1,774,796.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	945,000.00	1,235,365.42
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 50/10/31	700,000.00	627,769.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	605,000.00	954,573.23
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	746,248.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	1,730,000.00	1,800,758.73
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,635,880.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,084,816.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,594,197.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,678,531.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,013,737.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,832,102.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,010,298.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	986,868.79
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,341,707.37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,119,638.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,960,389.51
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,869,098.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,763,100.90
	2,760,000.00	2,944,188.04



BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,800,000.00	2,912,235.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,674,295.67
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,705,519.17
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,420,000.00	2,613,929.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,697,079.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,645,000.00	1,783,512.29
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,170,000.00	1,678,670.83
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,780,657.54
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,160,000.00	1,238,511.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,120,538.88
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,817,357.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,265,000.00	2,184,280.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,530,000.00	2,616,519.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	860,000.00	1,594,247.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,000,000.00	1,998,480.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	910,000.00	1,592,101.86
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	3,705,000.00	6,009,411.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	3,832,000.00	6,369,366.46
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	2,750,572.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	8,180,000.00	8,096,612.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	1,055,000.00	1,059,532.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,630,000.00	1,698,336.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	1,770,000.00	1,870,819.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.3%- 21/10/15	880,000.00	906,168.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	1,370,000.00	1,375,501.92

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,092,987.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	1,950,000.00	2,111,608.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,415,186.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	990,418.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	1,100,000.00	1,118,038.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,288,572.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,800,000.00	2,009,287.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,345,350.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,246,175.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 23/01/15	500,000.00	496,924.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	925,392.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,220,368.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,526,343.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 23/06/15	1,000,000.00	1,006,375.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,928,605.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,310,000.00	1,395,291.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,080,000.00	1,087,714.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	1,105,614.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,886,289.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	995,000.00	1,042,569.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,360,000.00	1,419,758.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,750,000.00	1,970,643.67
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,350,000.00	1,393,668.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,480,000.00	1,593,813.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,560,000.00	1,532,653.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,840,195.28

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	1,175,000.00	1,210,982.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,446,740.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	1,048,300.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,409,383.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,480,000.00	1,567,192.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,930,000.00	2,309,188.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,275,075.81
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,298,065.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,280,000.00	1,769,437.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,640,000.00	1,661,746.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,000,000.00	985,565.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,242,941.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,195,000.00	1,267,938.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,060,000.00	2,823,559.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	2,445,000.00	2,585,812.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,689,727.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	2,235,000.00	2,505,564.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	2,275,000.00	2,597,610.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,050,000.00	2,744,607.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	2,066,274.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,700,000.00	1,691,396.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,000,000.00	955,154.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,230,000.00	3,214,779.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,485,000.00	1,496,162.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,534,127.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	1,235,221.92

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	2,196,455.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	1,150,000.00	1,367,776.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	700,000.00	661,184.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	942,812.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,260,000.00	2,891,728.53
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,360,626.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,689,929.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	310,000.00	357,847.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,720,000.00	2,505,945.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,010,000.00	1,464,649.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	1,318,455.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,367,632.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,525,000.00	1,859,273.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	785,000.00	1,023,611.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	1,180,000.00	1,196,044.46
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	726,696.96
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	314,970.60
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	582,534.70
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	254,578.50
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	571,783.68
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	523,215.37
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	342,918.08
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	432,567.63
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	345,000.00	365,945.81
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	473,912.44
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	287,267.58
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	490,043.75
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	372,387.38
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	300,000.00	344,357.10
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	1,080,000.00	1,080,749.52
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	655,000.00	998,400.78
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	333,461.77
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,123,847.84

FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,022,703.10
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,936,012.75
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-23/03/25	180,000.00	182,869.02
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	960,000.00	1,210,949.76
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,378,046.32
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,576,681.50
FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,490,392.60
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	3,678,000.00	4,053,652.53
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,739,367.26
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,022,207.32
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	3,245,000.00	3,501,369.92
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,781,355.84
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	2,000,000.00	2,107,856.00
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	2,960,000.00	3,074,970.54
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	3,050,000.00	3,329,038.40
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,230,000.00	3,964,119.56
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,097,791.90
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	2,420,000.00	2,615,947.40
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,745,000.00	4,141,290.91
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	1,870,000.00	1,981,577.29
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,400,000.00	2,425,137.60
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,020,000.00	3,803,686.98
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,225,000.00	3,765,093.97
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,640,000.00	4,502,494.91
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	7,575,000.00	8,706,967.85
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,885,000.00	4,819,709.85
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	4,625,000.00	5,331,880.37
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,320,000.00	3,837,001.60
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,635,000.00	3,303,710.30
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	3,315,000.00	6,011,122.65
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,530,000.00	2,493,034.02
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,660,000.00	2,250,911.36
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,690,000.00	2,084,121.52
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,800,000.00	1,834,614.00
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,120,000.00	2,270,525.60
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	930,000.00	1,984,797.63
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	1,151,655.45
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	490,967.80
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,394.62
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	470,000.00	526,731.16
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	590,000.00	674,874.45
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	840,000.00	1,070,178.73

IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	975,000.00	1,046,471.20
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	501,486.72
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	662,341.47
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	1,570,000.00	1,723,910.86
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	1,135,000.00	1,395,020.55
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	860,000.00	971,644.34
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	655,000.00	742,968.79
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	605,000.00	608,444.08
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	470,588.43
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	562,000.00	744,336.40
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	283,000.00	340,947.92
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,460,000.00	1,521,028.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	706,716.92
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,040,000.00	1,103,029.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	395,681.93
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	760,000.00	921,655.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,020,147.05
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	183,981.42
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,250,000.00	1,384,371.25
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,327,797.75
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,268,004.94
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,225,000.00	1,329,184.41
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	925,000.00	1,345,543.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	906,000.00	990,058.68
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	495,000.00	520,672.92
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	730,000.00	978,363.73
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,930,812.05
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	1,163,000.00	1,274,537.97
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,225,000.00	2,211,933.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	2,363,000.00	4,030,710.40
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	155,000.00	223,896.88
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	386,000.00	725,940.16
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,090,000.00	1,145,442.85
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	749,620.74
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,032,279.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	457,924.95
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	970,000.00	1,046,722.15
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	938,273.58
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	670,000.00	731,025.94
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	916,246.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	760,000.00	816,512.84
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	726,115.75
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	999,945.44

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	620,000.00	670,569.06
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	545,000.00	579,845.66
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	620,000.00	629,619.30
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	756,785.58
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,375,000.00	2,290,490.12
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	1,379,000.00	2,303,354.45
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	973,000.00	1,257,093.62
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	500,000.00	549,120.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	659,242.96
ユーロ小計			415,654,000.00	499,217,708.82 (60,245,593,100)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	575,000.00	889,640.00
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	820,000.00	884,001.32
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	810,000.00	847,155.83
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,176,968.10
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,670,000.00	1,736,899.53
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	570,000.00	571,789.80
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,410,000.00	1,513,640.64
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,580,000.00	1,642,956.04
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	1,045,142.25
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,613,877.84
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	1,828,000.00	1,885,257.71
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,150,000.00	1,256,119.70
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,370,000.00	1,488,176.20
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,194,860.94
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,550,000.00	1,750,587.36
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,495,169.00
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	1,761,000.00	1,880,207.02
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	830,000.00	841,952.00
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,025,000.00	1,508,468.71
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	2,004,427.82
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,486,301.02
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	2,156,881.42
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,275,000.00	1,533,003.90
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,345,000.00	2,350,275.05
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	2,080,253.76
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,135,000.00	1,942,109.85
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	285,000.00	322,329.30
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,570,572.96
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,628,486.54
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,884,638.12
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,375,000.00	2,596,336.60

		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,660,000.00	2,030,764.32
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	620,000.00	806,605.12
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,145,000.00	2,272,399.06
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,252,000.00	2,421,976.47
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	845,244.69
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,370,000.00	3,009,018.68
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,519,933.90
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,100,000.00	2,480,599.00
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	270,000.00	271,670.54
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,310,000.00	3,002,216.08
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,735,000.00	1,755,351.55
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,664,123.50
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	980,332.20
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,242,000.00	2,248,151.65
英債券小計			53,282,000.00	75,086,873.09 (10,072,153,156)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	6,850,000.00	7,362,749.90
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,760,000.00	6,115,276.80
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,420,000.00	5,023,011.76
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,000,000.00	4,302,618.40
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,787,186.86
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	2,550,000.00	2,734,033.50
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	5,685,000.00	8,816,010.90
スウェーデンクローナ小計			32,815,000.00	38,140,888.12 (437,857,395)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,670,000.00	5,966,937.90
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,787,237.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,720,000.00	2,907,038.08
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,650,000.00	2,821,932.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	3,091,965.08
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	3,061,950.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,570,000.00	2,852,301.65
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	3,181,560.25
ノルウェークローネ小計			26,480,000.00	28,670,921.96 (317,387,106)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,390,000.00	5,662,610.03
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	5,340,000.00	5,719,059.90
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,960,000.00	6,694,528.28
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	4,435,974.40
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,500,000.00	1,612,800.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	12,780,000.00	23,974,085.06
			35,130,000.00	48,099,057.67



デンマーククローネ小計				(778,723,743)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,475,331.65
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,180,000.00	1,270,865.90
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,810,000.00	2,916,653.55
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-22/07/25	1,600,000.00	1,590,947.27
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,970,000.00	2,212,319.85
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,217,117.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,970,000.00	2,201,179.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,290,000.00	2,457,215.80
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,030,000.00	2,165,664.90
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,990,000.00	2,231,227.80
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,100,000.00	3,382,503.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,190,000.00	2,395,881.90
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,516,408.30
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,178,403.75
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,390,000.00	2,706,603.30
ポーランドズロチ小計			31,165,000.00	33,918,323.47 (919,525,749)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,475,000.00	1,513,538.35
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,650,000.00	1,837,434.06
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,960,000.00	2,054,910.25
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,150,000.00	2,470,152.41
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,230,000.00	2,438,892.57
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,480,000.00	1,473,118.10
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,910,000.00	2,174,028.46
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,300,000.00	2,801,001.87
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,280,000.00	2,913,628.87
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,940,000.00	2,230,252.90
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,200,000.00	2,453,758.12
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,930,000.00	2,236,640.90
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	2,210,000.00	2,664,689.37
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,860,000.00	2,174,778.77
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	2,390,000.00	2,750,332.65
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	2,000,000.00	2,008,122.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,248,000.00	1,316,184.84
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	720,000.00	739,111.03
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,465,738.95
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	639,567.11
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	940,000.00	1,273,021.69
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	848,768.80		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	400,000.00	479,256.92		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	1,060,000.00	1,345,827.61		

豪ドル小計			38,560,000.00	44,302,757.40 (3,236,759,455)
シンガ ポールド ドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	480,000.00	489,064.41
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	558,000.00	564,964.78
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	450,000.00	461,754.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	420,000.00	445,914.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	510,000.00	528,615.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	584,076.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	270,000.00	285,471.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	596,851.20
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	260,000.00	283,478.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	400,000.00	434,480.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	640,000.00	755,840.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	365,000.00	414,749.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	583,695.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	389,895.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	568,042.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	301,000.00	345,317.73
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	133,000.00	157,420.79
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	317,000.00	402,590.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	440,000.00	570,680.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	210,000.00	237,324.15
シンガポールドドル小計			8,114,000.00	9,100,223.56 (699,443,182)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	471,448.98
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	868,062.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	830,000.00	854,204.29
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	786,041.62
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	653,593.52
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	833,399.96
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	475,000.00	493,050.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	881,709.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	337,677.72
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	1,047,914.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	831,480.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	750,000.00	800,625.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,177,000.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,520,000.00	1,639,320.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	794,493.91
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	750,000.00	792,187.53
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	656,764.44
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,040,000.00	1,194,960.04

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	692,045.98	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	500,000.00	510,014.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	390,000.00	456,631.22	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	798,475.89	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	700,000.00	798,449.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	1,130,000.00	1,155,255.44	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	871,222.88	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	930,000.00	957,806.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	1,000,630.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,383,362.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	479,938.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	995,362.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	600,000.00	634,500.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	871,455.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	1,021,159.95	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,137,706.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	489,222.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	1,032,490.36	
マレーシアリングット小計			28,320,000.00	30,399,660.94	(761,511,506)
イスラエル シュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-22/01/31	1,300,000.00	1,415,125.40	
		ISRAEL FIXED BOND-0.75%-22/07/31	1,000,000.00	1,013,770.00	
		ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,027,989.00	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,000,000.00	1,113,867.00	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,200,000.00	1,253,283.60	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,200,000.00	1,358,934.00	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,400,000.00	1,498,901.60	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,200,000.00	1,635,360.00	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,500,000.00	1,647,787.50	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,412,636.25	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	800,000.00	819,128.00	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,400,000.00	2,445,979.20	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,100,000.00	1,580,001.50	
イスラエルシュケル小計			15,350,000.00	18,222,763.05	(562,172,240)
合計				150,482,884,267	(150,482,884,267)

(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 215銘柄	100.0%	45.4%
加ドル	国債証券 33銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 292銘柄	100.0%	40.0%
英ポンド	国債証券 45銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドollar	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングgit	国債証券 36銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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）

	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	67,829,437	61,180,742
株式	33,752,819,650	31,167,364,370
派生商品評価勘定	348,900	-
未収配当金	4,351,580	257,024,263
前払金	-	10,590,000
流動資産合計	33,825,349,567	31,496,159,375
資産合計	33,825,349,567	31,496,159,375
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	18,167,100
前受金	460,000	-
未払解約金	41,011,259	10,813,428
未払利息	78	25
流動負債合計	41,471,337	28,980,553
負債合計	41,471,337	28,980,553
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	20,979,830,566	21,851,680,688

	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	12,804,047,664	9,615,498,134
元本等合計	33,783,878,230	31,467,178,822
純資産合計	33,783,878,230	31,467,178,822
負債純資産合計	33,825,349,567	31,496,159,375

## 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られ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られ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)

	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
1. 期首	2019年 6月18日	2019年12月17日
期首元本額	21,413,574,101円	20,979,830,566円
期首からの追加設定元本額	1,182,784,137円	4,242,931,061円
期首からの一部解約元本額	1,616,527,672円	3,371,080,939円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	566,011,536円	670,142,336円
DCインデックスバランス(株式40)	1,478,069,009円	1,687,460,130円
DCインデックスバランス(株式60)	2,873,166,184円	3,210,115,045円
DCインデックスバランス(株式80)	2,974,701,655円	3,296,050,845円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,342,512,868円	1,410,120,999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	3,502,989,777円	3,301,301,090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)	739,710,271円	749,065,066円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	50,516,169円	52,008,041円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	41,125,427円	42,727,323円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	61,558,148円	60,701,067円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	57,433,154円	58,029,296円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,932,782,940円	3,918,327,587円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	279,081,289円	291,188,168円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	797,180,254円	801,618,904円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,149,490,912円	1,174,177,211円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,133,500,973円	1,128,647,580円
計	20,979,830,566円	21,851,680,688円
2. 受益権の総数	20,979,830,566口	21,851,680,688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	447,575,000円	369,580,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020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

	2019年12月16日現在	2020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）

（2019年12月16日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,703,677,456
合計	1,703,677,456

（2020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	1,737,420,475
合計	1,737,420,475

（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)

(2019年12月16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	34,340,000	-	34,690,000	350,000
合計		34,340,000	-	34,690,000	350,000

(2020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	352,775,000	-	334,620,000	18,155,000
合計		352,775,000	-	334,620,000	18,155,000

## (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)

2019年12月16日現在		2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.6103円	1口当たり純資産額	1.4400円
(1万口当たり純資産額)	(16,103円)	(1万口当たり純資産額)	(14,400円)

## 附属明細表



第1 有価証券明細表  
(1)株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	2,656.00	1,859,200	
日本水産	19,700	473.00	9,318,100	
マルハニチロ	2,800	2,129.00	5,961,200	
カネコ種苗	600	1,436.00	861,600	
サカタのタネ	2,300	3,415.00	7,854,500	
ホクト	1,500	1,983.00	2,974,500	
ホクリヨウ	300	620.00	186,000	
住石ホールディングス	3,700	117.00	432,900	
日鉄鉱業	500	4,350.00	2,175,000	
三井松島ホールディングス	800	835.00	668,000	
国際石油開発帝石	78,900	706.10	55,711,290	
石油資源開発	2,500	1,868.00	4,670,000	
K & O エナジーグループ	900	1,479.00	1,331,100	
ヒノキヤグループ	500	1,648.00	824,000	
ショーボンドホールディングス	3,100	4,815.00	14,926,500	
ミライト・ホールディングス	5,900	1,478.00	8,720,200	
サンヨーホームズ	200	627.00	125,400	
日本アクア	900	554.00	498,600	
ファーストコーポレーション	700	531.00	371,700	
ベステラ	400	963.00	385,200	
キャンディル	400	480.00	192,000	
スペースバリューホールディングス	2,500	350.00	875,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	915.00	366,000	
第一カッター興業	300	2,119.00	635,700	
明豊ファシリティワークス	700	532.00	372,400	
安藤・間	11,800	628.00	7,410,400	
東急建設	5,800	561.00	3,253,800	
コムシスホールディングス	7,000	2,899.00	20,293,000	
ビーアールホールディングス	2,200	515.00	1,133,000	
高松コンストラクショングループ	1,200	2,280.00	2,736,000	
東建コーポレーション	600	7,170.00	4,302,000	
ソネック	300	811.00	243,300	
ヤマウラ	1,000	795.00	795,000	
大成建設	15,200	3,790.00	57,608,000	
大林組	45,500	996.00	45,318,000	
清水建設	46,200	845.00	39,039,000	

飛島建設	1,400	1,043.00	1,460,200
長谷工コーポレーション	17,600	1,294.00	22,774,400
松井建設	1,900	646.00	1,227,400
銭高組	200	3,860.00	772,000
鹿島建設	35,700	1,202.00	42,911,400
不動テトラ	1,200	1,390.00	1,668,000
大末建設	600	801.00	480,600
鉄建建設	1,000	2,025.00	2,025,000
西松建設	3,500	2,060.00	7,210,000
三井住友建設	11,000	471.00	5,181,000
大豊建設	1,000	2,317.00	2,317,000
前田建設工業	11,400	828.00	9,439,200
ナカノフドー建設	1,400	376.00	526,400
奥村組	2,500	2,390.00	5,975,000
東鉄工業	2,000	2,697.00	5,394,000
イチケン	400	1,467.00	586,800
富士ピー・エス	800	563.00	450,400
浅沼組	500	4,165.00	2,082,500
戸田建設	18,900	668.00	12,625,200
熊谷組	2,100	2,534.00	5,321,400
北野建設	300	2,560.00	768,000
植木組	200	2,416.00	483,200
矢作建設工業	2,100	729.00	1,530,900
ピーエス三菱	1,600	510.00	816,000
日本ハウスホールディングス	3,300	272.00	897,600
大東建託	5,000	10,375.00	51,875,000
新日本建設	2,000	803.00	1,606,000
N I P P O	3,800	2,561.00	9,731,800
東亜道路工業	300	3,180.00	954,000
前田道路	4,000	1,991.00	7,964,000
日本道路	400	7,090.00	2,836,000
東亜建設工業	1,400	1,460.00	2,044,000
日本国土開発	4,500	504.00	2,268,000
若築建設	900	1,120.00	1,008,000
東洋建設	5,300	394.00	2,088,200
五洋建設	18,100	554.00	10,027,400
福田組	500	4,675.00	2,337,500
住友林業	11,500	1,238.00	14,237,000
日本基礎技術	1,700	407.00	691,900
巴コーポレーション	2,200	375.00	825,000
大和ハウス工業	45,000	2,646.50	119,092,500
ライト工業	2,600	1,429.00	3,715,400

積水ハウス	49,300	2,019.00	99,536,700
日特建設	1,300	720.00	936,000
北陸電気工事	900	951.00	855,900
ユアテック	2,700	616.00	1,663,200
日本リーテック	1,000	2,188.00	2,188,000
四電工	300	2,399.00	719,700
中電工	1,800	2,219.00	3,994,200
関電工	6,500	943.00	6,129,500
きんでん	10,800	1,763.00	19,040,400
東京エネシス	1,600	790.00	1,264,000
トーエネック	500	3,575.00	1,787,500
住友電設	1,300	2,244.00	2,917,200
日本電設工業	2,500	2,403.00	6,007,500
協和エクシオ	6,900	2,485.00	17,146,500
新日本空調	1,200	2,401.00	2,881,200
九電工	3,200	2,907.00	9,302,400
三機工業	3,300	1,266.00	4,177,800
日揮ホールディングス	14,000	1,122.00	15,708,000
中外炉工業	500	1,482.00	741,000
ヤマト	1,500	620.00	930,000
太平電業	1,100	2,230.00	2,453,000
高砂熱学工業	4,000	1,730.00	6,920,000
三晃金属工業	200	2,052.00	410,400
朝日工業社	300	2,966.00	889,800
明星工業	3,000	744.00	2,232,000
大気社	2,200	3,125.00	6,875,000
ダイダン	1,100	2,737.00	3,010,700
日比谷総合設備	1,500	1,795.00	2,692,500
フィル・カンパニー	300	2,708.00	812,400
OSJBホールディングス	7,500	236.00	1,770,000
東洋エンジニアリング	2,000	383.00	766,000
レイズネクスト	2,500	1,196.00	2,990,000
日本製粉	4,300	1,592.00	6,845,600
日清製粉グループ本社	16,400	1,632.00	26,764,800
日東富士製粉	100	6,180.00	618,000
昭和産業	1,300	3,240.00	4,212,000
鳥越製粉	1,300	849.00	1,103,700
中部飼料	1,800	1,546.00	2,782,800
フィード・ワン	9,900	190.00	1,881,000
東洋精糖	300	1,254.00	376,200
日本甜菜製糖	800	1,676.00	1,340,800
三井製糖	1,300	2,005.00	2,606,500

塩水港精糖	1,700	206.00	350,200
日新製糖	700	1,880.00	1,316,000
森永製菓	3,400	4,270.00	14,518,000
中村屋	400	4,005.00	1,602,000
江崎グリコ	4,300	5,080.00	21,844,000
名糖産業	700	1,303.00	912,100
井村屋グループ	800	2,001.00	1,600,800
不二家	800	2,191.00	1,752,800
山崎製パン	10,900	1,854.00	20,208,600
第一屋製パン	300	951.00	285,300
モロゾフ	300	5,480.00	1,644,000
亀田製菓	800	5,120.00	4,096,000
寿スピリッツ	1,400	4,550.00	6,370,000
カルビー	6,600	2,926.00	19,311,600
森永乳業	2,700	4,630.00	12,501,000
六甲バター	1,000	1,509.00	1,509,000
ヤクルト本社	10,000	6,890.00	68,900,000
明治ホールディングス	9,600	8,290.00	79,584,000
雪印メグミルク	3,500	2,622.00	9,177,000
プリマハム	2,300	2,655.00	6,106,500
日本ハム	5,600	4,075.00	22,820,000
林兼産業	500	554.00	277,000
丸大食品	1,600	1,886.00	3,017,600
S Foods	1,200	2,593.00	3,111,600
柿安本店	500	2,530.00	1,265,000
伊藤ハム米久ホールディングス	9,400	628.00	5,903,200
サッポロホールディングス	5,000	1,962.00	9,810,000
アサヒグループホールディングス	30,500	3,896.00	118,828,000
キリンホールディングス	61,700	2,242.00	138,331,400
宝ホールディングス	10,800	930.00	10,044,000
オエノンホールディングス	3,900	392.00	1,528,800
養命酒製造	400	1,834.00	733,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,200	2,067.00	21,083,400
サントリー食品インターナショナル	9,700	4,215.00	40,885,500
ダイドーグループホールディングス	800	4,780.00	3,824,000
伊藤園	4,400	6,060.00	26,664,000
キーコーヒー	1,400	2,282.00	3,194,800
ユニカフェ	400	957.00	382,800
ジャパンフーズ	200	1,144.00	228,800
日清オイリオグループ	1,900	3,295.00	6,260,500
不二製油グループ本社	3,600	2,713.00	9,766,800
J - オイルミルズ	800	3,990.00	3,192,000

キッコーマン	10,500	4,950.00	51,975,000
味の素	32,100	1,796.00	57,651,600
キューピー	8,100	2,050.00	16,605,000
ハウス食品グループ本社	5,400	3,515.00	18,981,000
カゴメ	5,500	2,996.00	16,478,000
焼津水産化学工業	800	934.00	747,200
アリアケジャパン	1,300	6,780.00	8,814,000
ピエトロ	200	1,627.00	325,400
エバラ食品工業	400	2,158.00	863,200
やまみ	100	1,966.00	196,600
ニチレイ	6,900	2,996.00	20,672,400
東洋水産	7,500	5,690.00	42,675,000
イトアンド	500	1,760.00	880,000
大冷	200	1,989.00	397,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	1,040.00	832,000
日清食品ホールディングス	6,200	9,040.00	56,048,000
永谷園ホールディングス	700	2,132.00	1,492,400
一正蒲鉾	600	1,022.00	613,200
フジッコ	1,600	1,924.00	3,078,400
ロック・フィールド	1,600	1,285.00	2,056,000
日本たばこ産業	84,000	2,104.50	176,778,000
ケンコーマヨネーズ	800	2,007.00	1,605,600
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,674.00	1,674,000
なとり	800	1,719.00	1,375,200
イフジ産業	300	800.00	240,000
ピックルスコーポレーション	300	2,305.00	691,500
北の達人コーポレーション	5,100	547.00	2,789,700
ユーグレナ	6,300	762.00	4,800,600
ミヨシ油脂	600	1,086.00	651,600
理研ビタミン	1,400	2,226.00	3,116,400
片倉工業	2,000	1,153.00	2,306,000
ゲンゼ	1,000	3,760.00	3,760,000
東洋紡	5,600	1,437.00	8,047,200
ユニチカ	4,200	340.00	1,428,000
富士紡ホールディングス	700	3,085.00	2,159,500
倉敷紡績	1,400	2,256.00	3,158,400
シキボウ	800	961.00	768,800
日本毛織	4,600	996.00	4,581,600
ダイトウボウ	2,400	119.00	285,600
トーア紡コーポレーション	600	474.00	284,400
ダイドーリミテッド	2,000	211.00	422,000
帝国繊維	1,600	2,189.00	3,502,400

帝人	11,600	1,710.00	19,836,000
東レ	102,800	498.60	51,256,080
サカイオーベックス	400	2,096.00	838,400
住江織物	300	2,044.00	613,200
日本フェルト	800	473.00	378,400
イチカワ	200	1,283.00	256,600
日東製網	200	1,337.00	267,400
アツギ	1,200	597.00	716,400
ダイニック	600	719.00	431,400
セーレン	3,500	1,270.00	4,445,000
ソトー	600	937.00	562,200
東海染工	200	1,134.00	226,800
小松マテーレ	2,400	711.00	1,706,400
ワコールホールディングス	3,700	2,065.00	7,640,500
ホギメディカル	1,600	3,340.00	5,344,000
クラウディアホールディングス	400	417.00	166,800
T S Iホールディングス	4,700	458.00	2,152,600
マツオカコーポレーション	400	2,127.00	850,800
ワールド	2,000	1,539.00	3,078,000
三陽商会	800	833.00	666,400
ナイガイ	500	379.00	189,500
オンワードホールディングス	8,500	352.00	2,992,000
ルックホールディングス	500	730.00	365,000
ゴールドウイン	2,600	6,190.00	16,094,000
デサント	2,800	1,571.00	4,398,800
キング	700	507.00	354,900
ヤマトインターナショナル	1,300	364.00	473,200
特種東海製紙	900	4,265.00	3,838,500
王子ホールディングス	59,300	500.00	29,650,000
日本製紙	6,300	1,547.00	9,746,100
三菱製紙	1,600	349.00	558,400
北越コーポレーション	8,400	372.00	3,124,800
中越パルプ工業	600	1,397.00	838,200
巴川製紙所	500	887.00	443,500
大王製紙	6,200	1,445.00	8,959,000
阿波製紙	400	482.00	192,800
レンゴー	13,400	866.00	11,604,400
トモク	900	1,657.00	1,491,300
ザ・パック	1,100	3,085.00	3,393,500
クラレ	22,400	1,158.00	25,939,200
旭化成	94,200	853.20	80,371,440
共和レザー	800	666.00	532,800

昭和電工	10,100	2,553.00	25,785,300
住友化学	104,300	325.00	33,897,500
住友精化	600	3,365.00	2,019,000
日産化学	7,900	5,190.00	41,001,000
ラサ工業	500	1,446.00	723,000
クレハ	1,200	4,720.00	5,664,000
多木化学	600	7,390.00	4,434,000
テイカ	1,100	1,422.00	1,564,200
石原産業	2,600	699.00	1,817,400
片倉コープアグリ	400	1,227.00	490,800
日本曹達	2,100	2,811.00	5,903,100
東ソー	22,000	1,465.00	32,230,000
トクヤマ	4,100	2,378.00	9,749,800
セントラル硝子	2,900	1,839.00	5,333,100
東亜合成	8,900	1,028.00	9,149,200
大阪ソーダ	1,400	2,423.00	3,392,200
関東電化工業	3,400	859.00	2,920,600
デンカ	5,200	2,581.00	13,421,200
信越化学工業	24,400	11,850.00	289,140,000
日本カーバイド工業	500	1,311.00	655,500
堺化学工業	900	1,966.00	1,769,400
第一稀元素化学工業	1,600	746.00	1,193,600
エア・ウォーター	13,200	1,515.00	19,998,000
大陽日酸	13,600	1,800.00	24,480,000
日本化学工業	400	2,157.00	862,800
東邦アセチレン	200	1,251.00	250,200
日本パーカライズン	7,200	1,116.00	8,035,200
高压ガス工業	2,300	723.00	1,662,900
四国化成工業	2,200	1,062.00	2,336,400
戸田工業	300	1,891.00	567,300
ステラ ケミファ	800	2,539.00	2,031,200
保土谷化学工業	500	3,780.00	1,890,000
日本触媒	2,200	5,730.00	12,606,000
大日精化工業	1,300	2,304.00	2,995,200
カネカ	3,700	2,740.00	10,138,000
三菱瓦斯化学	13,200	1,582.00	20,882,400
三井化学	12,900	2,287.00	29,502,300
J S R	13,200	1,945.00	25,674,000
東京応化工業	2,400	4,855.00	11,652,000
大阪有機化学工業	1,300	1,932.00	2,511,600
三菱ケミカルホールディングス	94,900	633.10	60,081,190
K Hネオケム	2,500	1,997.00	4,992,500

ダイセル	18,500	814.00	15,059,000
住友ベークライト	2,200	3,030.00	6,666,000
積水化学工業	30,500	1,481.00	45,170,500
日本ゼオン	12,800	997.00	12,761,600
アイカ工業	4,300	3,230.00	13,889,000
宇部興産	7,200	1,843.00	13,269,600
積水樹脂	2,600	2,257.00	5,868,200
タキロンシーアイ	3,100	679.00	2,104,900
旭有機材	800	1,410.00	1,128,000
ニチバン	800	1,468.00	1,174,400
リケンテクノス	3,700	417.00	1,542,900
大倉工業	700	1,553.00	1,087,100
積水化成成品工業	1,900	570.00	1,083,000
群栄化学工業	300	2,695.00	808,500
タイガースポリマー	800	470.00	376,000
ミライアル	500	997.00	498,500
ダイキアクシス	500	801.00	400,500
ダイキョーニシカワ	3,100	525.00	1,627,500
竹本容器	500	706.00	353,000
森六ホールディングス	800	1,571.00	1,256,800
日本化薬	8,800	1,069.00	9,407,200
カーリットホールディングス	1,500	499.00	748,500
日本精化	1,200	1,352.00	1,622,400
扶桑化学工業	1,400	3,745.00	5,243,000
トリケミカル研究所	300	10,490.00	3,147,000
A D E K A	6,500	1,385.00	9,002,500
日油	5,300	3,660.00	19,398,000
新日本理化	2,400	162.00	388,800
ハリマ化成グループ	1,200	980.00	1,176,000
花王	34,700	8,643.00	299,912,100
第一工業製薬	500	4,620.00	2,310,000
石原ケミカル	400	1,872.00	748,800
日華化学	500	938.00	469,000
ニイタカ	300	4,750.00	1,425,000
三洋化成工業	800	4,700.00	3,760,000
有機合成薬品工業	1,100	337.00	370,700
大日本塗料	1,600	917.00	1,467,200
日本ペイントホールディングス	11,700	7,870.00	92,079,000
関西ペイント	16,000	2,165.00	34,640,000
神東塗料	1,200	181.00	217,200
中国塗料	4,100	740.00	3,034,000
日本特殊塗料	1,100	947.00	1,041,700



藤倉化成	1,900	496.00	942,400
太陽ホールディングス	1,000	4,840.00	4,840,000
D I C	6,000	2,639.00	15,834,000
サカティクス	3,100	974.00	3,019,400
東洋インキＳＣホールディングス	3,000	2,006.00	6,018,000
T & K T O K A	1,100	746.00	820,600
富士フィルムホールディングス	27,800	4,766.00	132,494,800
資生堂	28,800	6,833.00	196,790,400
ライオン	18,900	2,470.00	46,683,000
高砂香料工業	900	2,259.00	2,033,100
マンダム	3,300	2,002.00	6,606,600
ミルボン	1,900	5,040.00	9,576,000
ファンケル	5,900	3,015.00	17,788,500
コーセー	2,700	13,860.00	37,422,000
コタ	800	1,198.00	958,400
ポーラ・オルビスホールディングス	6,200	2,027.00	12,567,400
ノエビアホールディングス	1,200	4,470.00	5,364,000
アジュバンコスメジャパン	300	933.00	279,900
エステー	1,000	1,665.00	1,665,000
アグロ カネショウ	600	1,308.00	784,800
コニシ	2,400	1,393.00	3,343,200
長谷川香料	2,500	2,279.00	5,697,500
星光P M C	900	695.00	625,500
小林製薬	4,100	9,800.00	40,180,000
荒川化学工業	1,300	1,171.00	1,522,300
メック	1,000	1,863.00	1,863,000
日本高純度化学	400	2,484.00	993,600
タカラバイオ	3,800	3,090.00	11,742,000
J C U	1,800	3,100.00	5,580,000
新田ゼラチン	1,000	699.00	699,000
O A T アグリオ	300	1,067.00	320,100
デクセリアルズ	3,800	817.00	3,104,600
アース製薬	1,100	7,170.00	7,887,000
北興化学工業	1,500	597.00	895,500
大成ラミック	500	2,628.00	1,314,000
クミアイ化学工業	6,000	863.00	5,178,000
日本農薬	2,600	456.00	1,185,600
アキレス	1,000	1,607.00	1,607,000
有沢製作所	2,300	785.00	1,805,500
日東電工	10,000	5,840.00	58,400,000
レック	1,500	1,614.00	2,421,000
三光合成	1,700	279.00	474,300

きもと	2,500	154.00	385,000	
藤森工業	1,300	3,650.00	4,745,000	
前澤化成工業	900	996.00	896,400	
未来工業	800	1,895.00	1,516,000	
ウェーブロックホールディングス	500	699.00	349,500	
J S P	900	1,469.00	1,322,100	
エフピコ	1,600	7,990.00	12,784,000	
天馬	1,000	1,619.00	1,619,000	
信越ポリマー	2,600	867.00	2,254,200	
東リ	3,700	266.00	984,200	
ニフコ	5,300	2,311.00	12,248,300	
バルカー	1,200	1,858.00	2,229,600	
ユニ・チャーム	28,000	4,137.00	115,836,000	
ショーエイコーポレーション	200	853.00	170,600	
協和キリン	14,600	2,725.00	39,785,000	
武田薬品工業	120,600	3,922.00	472,993,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	125,700	1,741.50	218,906,550	
大日本住友製薬	10,700	1,416.00	15,151,200	
塩野義製薬	18,200	6,535.00	118,937,000	
わかもと製薬	1,900	280.00	532,000	
あすか製薬	1,700	1,141.00	1,939,700	
日本新薬	3,800	8,530.00	32,414,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,290.00	687,000	
中外製薬	15,100	16,000.00	241,600,000	
科研製薬	2,500	5,490.00	13,725,000	
エーザイ	17,400	8,161.00	142,001,400	
ロート製薬	7,400	3,220.00	23,828,000	
小野薬品工業	33,300	3,002.00	99,966,600	
久光製薬	3,800	5,400.00	20,520,000	
持田製薬	2,000	3,915.00	7,830,000	
参天製薬	27,000	1,967.00	53,109,000	
扶桑薬品工業	500	2,439.00	1,219,500	
日本ケミファ	200	2,587.00	517,400	
ツムラ	4,500	2,871.00	12,919,500	
日医工	4,100	1,235.00	5,063,500	
キッセイ薬品工業	2,600	2,550.00	6,630,000	
生化学工業	2,800	1,106.00	3,096,800	
栄研化学	2,500	1,742.00	4,355,000	
日水製薬	700	1,193.00	835,100	
鳥居薬品	900	3,080.00	2,772,000	
J C R ファーマ	1,000	11,240.00	11,240,000	
東和薬品	1,800	2,050.00	3,690,000	

富士製薬工業	1,000	1,164.00	1,164,000
沢井製薬	3,000	5,560.00	16,680,000
ゼリア新薬工業	2,600	1,993.00	5,181,800
第一三共	41,500	8,622.00	357,813,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,091.00	6,691,200
大幸薬品	1,700	2,195.00	3,731,500
ダイト	900	4,050.00	3,645,000
大塚ホールディングス	27,600	4,712.00	130,051,200
大正製薬ホールディングス	3,100	6,390.00	19,809,000
ペプチドリーム	7,400	4,780.00	35,372,000
日本コークス工業	12,200	63.00	768,600
ニチレキ	1,700	1,572.00	2,672,400
ユシロ化学工業	800	1,253.00	1,002,400
ビーピー・カストロール	500	1,187.00	593,500
富士石油	4,100	172.00	705,200
MORESCO	500	1,008.00	504,000
出光興産	16,100	2,370.00	38,157,000
JXTGホールディングス	218,100	393.40	85,800,540
コスモエネルギーホールディングス	4,200	1,589.00	6,673,800
横浜ゴム	8,400	1,521.00	12,776,400
TOYO TIRE	8,300	1,451.00	12,043,300
ブリヂストン	41,800	3,468.00	144,962,400
住友ゴム工業	13,000	1,096.00	14,248,000
藤倉コンポジット	1,300	355.00	461,500
オカモト	900	3,850.00	3,465,000
フコク	600	686.00	411,600
ニッタ	1,600	2,224.00	3,558,400
住友理工	2,800	642.00	1,797,600
三ツ星ベルト	1,900	1,695.00	3,220,500
バンドー化学	2,600	595.00	1,547,000
日東紡績	2,200	4,910.00	10,802,000
AGC	14,300	3,160.00	45,188,000
日本板硝子	6,900	407.00	2,808,300
石塚硝子	300	1,985.00	595,500
日本山村硝子	600	845.00	507,000
日本電気硝子	5,800	1,732.00	10,045,600
オハラ	600	999.00	599,400
住友大阪セメント	2,700	3,630.00	9,801,000
太平洋セメント	9,100	2,380.00	21,658,000
日本ヒューム	1,400	728.00	1,019,200
日本コンクリート工業	3,000	262.00	786,000
三谷セキサン	700	5,170.00	3,619,000

アジアパイルホールディングス	2,000	449.00	898,000
東海カーボン	15,200	1,037.00	15,762,400
日本カーボン	700	3,510.00	2,457,000
東洋炭素	800	1,634.00	1,307,200
ノリタケカンパニーリミテド	800	3,315.00	2,652,000
TOTO	10,300	4,170.00	42,951,000
日本碍子	17,400	1,509.00	26,256,600
日本特殊陶業	11,000	1,577.00	17,347,000
ダントーホールディングス	900	87.00	78,300
MARUWA	600	7,900.00	4,740,000
品川リフラクトリーズ	400	2,273.00	909,200
黒崎播磨	300	3,775.00	1,132,500
ヨータイ	1,100	679.00	746,900
イソライト工業	700	460.00	322,000
東京窯業	1,900	285.00	541,500
ニッカトー	600	650.00	390,000
フジミインコーポレーテッド	1,300	3,025.00	3,932,500
クニミネ工業	600	971.00	582,600
エーアンドエーマテリアル	200	1,103.00	220,600
ニチアス	4,000	2,199.00	8,796,000
ニチハ	2,000	2,161.00	4,322,000
日本製鉄	64,200	1,009.00	64,777,800
神戸製鋼所	26,300	400.00	10,520,000
合同製鐵	800	1,862.00	1,489,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	38,700	795.00	30,766,500
東京製鐵	7,000	615.00	4,305,000
共英製鋼	1,600	1,288.00	2,060,800
大和工業	3,100	2,088.00	6,472,800
東京鐵鋼	600	1,265.00	759,000
大阪製鐵	800	1,200.00	960,000
淀川製鋼所	1,900	1,733.00	3,292,700
丸一鋼管	4,700	2,646.00	12,436,200
モリ工業	400	2,419.00	967,600
大同特殊鋼	2,300	3,500.00	8,050,000
日本高周波鋼業	600	374.00	224,400
日本冶金工業	1,200	1,655.00	1,986,000
山陽特殊製鋼	1,000	959.00	959,000
愛知製鋼	800	2,946.00	2,356,800
日立金属	15,500	1,305.00	20,227,500
日本金属	400	647.00	258,800
大太平洋金属	1,000	1,671.00	1,671,000
新日本電工	9,500	162.00	1,539,000

栗本鐵工所	700	1,736.00	1,215,200
虹技	200	1,197.00	239,400
日本鑄鉄管	200	1,264.00	252,800
三菱製鋼	1,100	678.00	745,800
日亜鋼業	2,200	274.00	602,800
日本精線	200	3,385.00	677,000
エンビプロ・ホールディングス	600	598.00	358,800
シンニッタン	2,400	244.00	585,600
新家工業	400	1,166.00	466,400
大紀アルミニウム工業所	2,400	564.00	1,353,600
日本軽金属ホールディングス	36,300	176.00	6,388,800
三井金属鉱業	3,900	2,205.00	8,599,500
東邦亜鉛	800	1,490.00	1,192,000
三菱マテリアル	9,500	2,258.00	21,451,000
住友金属鉱山	18,300	2,900.00	53,070,000
D O W Aホールディングス	3,600	3,290.00	11,844,000
古河機械金属	2,600	1,064.00	2,766,400
エス・サイエンス	6,900	44.00	303,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	931.00	1,396,500
東邦チタニウム	2,600	640.00	1,664,000
U A C J	2,200	1,870.00	4,114,000
C Kサンエツ	300	3,295.00	988,500
古河電気工業	4,500	2,562.00	11,529,000
住友電気工業	53,600	1,274.00	68,286,400
フジクラ	17,300	315.00	5,449,500
昭和電線ホールディングス	1,700	1,003.00	1,705,100
タツタ電線	2,900	561.00	1,626,900
カナレ電気	200	1,826.00	365,200
平河ヒューテック	700	992.00	694,400
リョービ	1,800	1,283.00	2,309,400
アーレスティ	2,100	357.00	749,700
アサヒホールディングス	2,500	2,701.00	6,752,500
稲葉製作所	800	1,352.00	1,081,600
宮地エンジニアリンググループ	500	1,574.00	787,000
トーカロ	3,900	1,061.00	4,137,900
アルファC o	500	910.00	455,000
S U M C O	17,000	1,517.00	25,789,000
川田テクノロジーズ	300	4,850.00	1,455,000
R S T e c h n o l o g i e s	400	3,130.00	1,252,000
信和	800	721.00	576,800
東洋製罐グループホールディングス	9,100	1,264.00	11,502,400
ホッカンホールディングス	800	1,654.00	1,323,200

コロナ	800	1,001.00	800,800
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,173.00	5,867,100
駒井ハルテック	300	1,413.00	423,900
高田機工	100	2,301.00	230,100
三和ホールディングス	13,500	925.00	12,487,500
文化シャッター	4,200	740.00	3,108,000
三協立山	1,900	965.00	1,833,500
アルインコ	1,000	911.00	911,000
東洋シャッター	300	708.00	212,400
LIXILグループ	21,100	1,555.00	32,810,500
日本フィルコン	1,100	513.00	564,300
ノーリツ	2,900	1,191.00	3,453,900
長府製作所	1,500	2,244.00	3,366,000
リンナイ	2,800	8,860.00	24,808,000
ダイニチ工業	800	627.00	501,600
日東精工	1,900	450.00	855,000
三洋工業	200	1,863.00	372,600
岡部	2,900	811.00	2,351,900
ジーテクト	1,800	1,075.00	1,935,000
東プレ	2,600	1,261.00	3,278,600
高周波熱錬	2,800	522.00	1,461,600
東京製網	1,100	553.00	608,300
サンコール	1,100	408.00	448,800
モリテック スチール	1,100	296.00	325,600
パイオラックス	2,100	1,615.00	3,391,500
エイチワン	1,400	551.00	771,400
日本発條	15,400	716.00	11,026,400
中央発條	200	2,689.00	537,800
アドバネクス	200	1,201.00	240,200
立川ブラインド工業	700	1,196.00	837,200
三益半導体工業	1,100	2,105.00	2,315,500
日本ドライケミカル	400	1,600.00	640,000
日本製鋼所	4,300	1,487.00	6,394,100
三浦工業	6,200	4,370.00	27,094,000
タクマ	4,800	1,439.00	6,907,200
ツガミ	3,000	876.00	2,628,000
オークマ	1,700	4,540.00	7,718,000
芝浦機械	1,600	2,234.00	3,574,400
アマダ	17,800	882.00	15,699,600
アイダエンジニアリング	3,700	726.00	2,686,200
滝澤鉄工所	400	994.00	397,600
F U J I	6,200	1,818.00	11,271,600

牧野フライス製作所	1,700	3,265.00	5,550,500
オーエスジー	6,600	1,583.00	10,447,800
ダイジェット工業	200	1,271.00	254,200
旭ダイヤモンド工業	3,800	492.00	1,869,600
D M G 森精機	9,100	1,308.00	11,902,800
ソディック	3,400	796.00	2,706,400
ディスコ	1,900	23,510.00	44,669,000
日東工器	800	1,926.00	1,540,800
日進工具	600	2,430.00	1,458,000
パンチ工業	1,300	390.00	507,000
富士ダイス	600	640.00	384,000
豊和工業	800	791.00	632,800
O K K	600	416.00	249,600
東洋機械金属	1,000	405.00	405,000
津田駒工業	300	900.00	270,000
島精機製作所	2,200	1,492.00	3,282,400
オプトラン	1,600	2,255.00	3,608,000
N C ホールディングス	400	532.00	212,800
イワキポンプ	900	986.00	887,400
フリー	1,400	932.00	1,304,800
ヤマシンフィルタ	3,100	989.00	3,065,900
日阪製作所	1,800	744.00	1,339,200
やまびこ	2,800	899.00	2,517,200
平田機工	700	5,590.00	3,913,000
ペガサスミシン製造	1,400	327.00	457,800
マルマエ	500	955.00	477,500
タツモ	700	1,585.00	1,109,500
ナプテスコ	8,400	3,185.00	26,754,000
三井海洋開発	1,500	1,518.00	2,277,000
レオン自動機	1,400	1,240.00	1,736,000
S M C	4,600	52,500.00	241,500,000
ホソカワミクロン	500	5,600.00	2,800,000
ユニオンツール	500	2,670.00	1,335,000
オイレス工業	1,800	1,373.00	2,471,400
日精エー・エス・ビー機械	400	3,175.00	1,270,000
サトーホールディングス	2,000	2,380.00	4,760,000
技研製作所	1,300	4,860.00	6,318,000
日本エアータック	500	976.00	488,000
カワタ	400	742.00	296,800
日精樹脂工業	1,200	796.00	955,200
オカダアイヨン	400	898.00	359,200
ワイエイシイホールディングス	600	446.00	267,600

小松製作所	65,700	2,100.00	137,970,000
住友重機械工業	8,300	2,385.00	19,795,500
日立建機	5,800	2,820.00	16,356,000
日工	2,000	629.00	1,258,000
巴工業	600	1,807.00	1,084,200
井関農機	1,500	1,115.00	1,672,500
TOWA	1,500	1,102.00	1,653,000
丸山製作所	300	1,128.00	338,400
北川鉄工所	600	1,627.00	976,200
ローツェ	600	4,915.00	2,949,000
タカキタ	500	585.00	292,500
クボタ	76,900	1,558.50	119,848,650
荏原実業	400	2,566.00	1,026,400
三菱化工機	500	1,670.00	835,000
月島機械	2,700	1,174.00	3,169,800
帝国電機製作所	1,200	1,199.00	1,438,800
新東工業	3,400	750.00	2,550,000
澁谷工業	1,300	2,908.00	3,780,400
アイチ コーポレーション	2,500	709.00	1,772,500
小森コーポレーション	3,700	680.00	2,516,000
鶴見製作所	1,100	1,785.00	1,963,500
住友精密工業	200	2,222.00	444,400
酒井重工業	300	2,135.00	640,500
荏原製作所	6,000	2,433.00	14,598,000
石井鐵工所	200	2,504.00	500,800
西島製作所	1,500	789.00	1,183,500
北越工業	1,500	1,064.00	1,596,000
ダイキン工業	18,500	15,915.00	294,427,500
オルガノ	500	5,250.00	2,625,000
トーヨーカネツ	600	2,052.00	1,231,200
栗田工業	7,800	2,887.00	22,518,600
椿本チエイン	2,100	2,640.00	5,544,000
大同工業	700	678.00	474,600
木村化工機	1,200	422.00	506,400
アネスト岩田	2,300	839.00	1,929,700
ダイフク	7,400	8,410.00	62,234,000
サムコ	400	1,819.00	727,600
加藤製作所	800	1,133.00	906,400
油研工業	300	1,447.00	434,100
タダノ	7,000	857.00	5,999,000
フジテック	5,300	1,739.00	9,216,700
C K D	4,000	1,750.00	7,000,000



キトー	1,100	1,250.00	1,375,000
平和	4,000	1,809.00	7,236,000
理想科学工業	1,300	1,381.00	1,795,300
SANKYO	3,200	2,719.00	8,700,800
日本金銭機械	1,600	585.00	936,000
マースグループホールディングス	900	1,608.00	1,447,200
フクシマガリレイ	900	3,580.00	3,222,000
オーイズミ	600	368.00	220,800
ダイコク電機	700	1,236.00	865,200
竹内製作所	2,400	1,683.00	4,039,200
アマノ	3,800	2,262.00	8,595,600
JUKI	2,000	597.00	1,194,000
サンデンホールディングス	1,900	363.00	689,700
蛇の目マシン工業	1,300	434.00	564,200
マックス	2,200	1,571.00	3,456,200
グローリー	3,700	2,467.00	9,127,900
新晃工業	1,400	1,411.00	1,975,400
大和冷機工業	2,100	955.00	2,005,500
セガサミーホールディングス	14,400	1,330.00	19,152,000
日本ピストンリング	500	1,162.00	581,000
リケン	700	2,727.00	1,908,900
TPR	1,900	1,386.00	2,633,400
ツバキ・ナカシマ	2,900	898.00	2,604,200
ホシザキ	4,200	8,950.00	37,590,000
大豊工業	1,200	551.00	661,200
日本精工	27,300	792.00	21,621,600
NTN	33,500	224.00	7,504,000
ジェイテクト	13,900	849.00	11,801,100
不二越	1,300	3,255.00	4,231,500
日本トムソン	4,400	348.00	1,531,200
THK	8,400	2,648.00	22,243,200
ユーシン精機	1,100	704.00	774,400
前澤給装工業	500	1,949.00	974,500
イーグル工業	1,800	719.00	1,294,200
前澤工業	1,000	336.00	336,000
日本ピラー工業	1,500	1,302.00	1,953,000
キッツ	5,800	705.00	4,089,000
マキタ	18,900	3,775.00	71,347,500
日立造船	11,400	390.00	4,446,000
三菱重工業	24,300	2,691.50	65,403,450
IHI	10,400	1,535.00	15,964,000
スター精密	2,200	1,240.00	2,728,000

日清紡ホールディングス	9,700	775.00	7,517,500
イビデン	8,900	2,828.00	25,169,200
コニカミノルタ	31,800	396.00	12,592,800
ブラザー工業	17,700	1,958.00	34,656,600
ミネベアミツミ	26,900	1,920.00	51,648,000
日立製作所	69,700	3,425.00	238,722,500
三菱電機	145,000	1,389.00	201,405,000
富士電機	8,800	2,717.00	23,909,600
東洋電機製造	600	1,169.00	701,400
安川電機	15,600	3,575.00	55,770,000
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,009.00	1,917,100
明電舎	2,700	1,642.00	4,433,400
オリジン	400	1,413.00	565,200
山洋電気	700	4,375.00	3,062,500
デンヨー	1,300	1,788.00	2,324,400
東芝テック	1,800	3,890.00	7,002,000
芝浦メカトロニクス	300	2,708.00	812,400
マブチモーター	4,000	3,345.00	13,380,000
日本電産	34,900	6,430.00	224,407,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	347.00	347,000
トレックス・セミコンダクター	900	1,264.00	1,137,600
東光高岳	800	1,001.00	800,800
ダイヘン	1,600	3,410.00	5,456,000
ヤーマン	2,400	813.00	1,951,200
JVCケンウッド	12,000	168.00	2,016,000
ミマキエンジニアリング	1,300	379.00	492,700
第一精工	600	2,273.00	1,363,800
日新電機	3,400	1,039.00	3,532,600
大崎電気工業	3,000	485.00	1,455,000
オムロン	13,000	6,920.00	89,960,000
日東工業	2,100	1,787.00	3,752,700
I D E C	2,100	1,640.00	3,444,000
正興電機製作所	400	927.00	370,800
不二電機工業	300	1,283.00	384,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,900	1,731.00	8,481,900
サクサホールディングス	400	1,741.00	696,400
メルコホールディングス	500	2,700.00	1,350,000
テクノメディカ	300	1,815.00	544,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	575.00	230,000
日本電気	17,600	4,835.00	85,096,000
富士通	14,000	11,615.00	162,610,000
沖電気工業	5,900	1,022.00	6,029,800

岩崎通信機	700	840.00	588,000
電気興業	700	2,512.00	1,758,400
サンケン電気	1,600	2,206.00	3,529,600
ナカヨ	300	1,485.00	445,500
アイホン	800	1,509.00	1,207,200
ルネサスエレクトロニクス	69,400	591.00	41,015,400
セイコーエプソン	18,000	1,281.00	23,058,000
ワコム	9,800	534.00	5,233,200
アルバック	2,700	2,998.00	8,094,600
アクセル	600	670.00	402,000
E I Z O	1,100	4,065.00	4,471,500
日本信号	3,700	1,131.00	4,184,700
京三製作所	3,500	502.00	1,757,000
能美防災	1,900	1,989.00	3,779,100
ホーチキ	1,100	1,263.00	1,389,300
星和電機	700	588.00	411,600
エレコム	1,600	4,920.00	7,872,000
パナソニック	165,700	928.20	153,802,740
シャープ	16,800	1,136.00	19,084,800
アンリツ	9,400	2,314.00	21,751,600
富士通ゼネラル	4,000	2,151.00	8,604,000
ソニー	90,800	7,317.00	664,383,600
T D K	7,000	10,270.00	71,890,000
帝国通信工業	700	1,203.00	842,100
タムラ製作所	4,900	421.00	2,062,900
アルプスアルパイン	12,900	1,381.00	17,814,900
池上通信機	500	836.00	418,000
日本電波工業	1,400	356.00	498,400
鈴木	700	732.00	512,400
日本トリム	200	2,963.00	592,600
ローランド ディー . ジー .	800	1,210.00	968,000
フォスター電機	1,600	1,102.00	1,763,200
S M K	400	2,416.00	966,400
ヨコオ	1,000	2,476.00	2,476,000
ホシデン	4,000	920.00	3,680,000
ヒロセ電機	2,200	11,680.00	25,696,000
日本航空電子工業	3,300	1,440.00	4,752,000
T O A	1,600	713.00	1,140,800
マクセルホールディングス	3,200	981.00	3,139,200
古野電気	1,900	918.00	1,744,200
ユニデンホールディングス	400	1,816.00	726,400
スミダコーポレーション	1,100	750.00	825,000

アイコム	800	2,955.00	2,364,000
リオン	600	2,280.00	1,368,000
本多通信工業	1,300	431.00	560,300
船井電機	1,600	481.00	769,600
横河電機	13,300	1,562.00	20,774,600
新電元工業	500	2,263.00	1,131,500
アズビル	9,200	2,919.00	26,854,800
東亜ディーケーケー	700	838.00	586,600
日本光電工業	6,000	3,410.00	20,460,000
チノー	500	1,290.00	645,000
共和電業	1,600	388.00	620,800
日本電子材料	600	878.00	526,800
堀場製作所	2,900	5,270.00	15,283,000
アドバンテスト	10,800	5,480.00	59,184,000
小野測器	700	507.00	354,900
エスベック	1,300	1,653.00	2,148,900
キーエンス	13,100	42,120.00	551,772,000
日置電機	800	2,859.00	2,287,200
シスメックス	10,400	7,656.00	79,622,400
日本マイクロニクス	2,600	992.00	2,579,200
メガチップス	1,400	2,071.00	2,899,400
O B A R A G R O U P	900	3,265.00	2,938,500
澤藤電機	200	1,518.00	303,600
原田工業	700	793.00	555,100
コーセル	2,000	875.00	1,750,000
イリソ電子工業	1,200	3,470.00	4,164,000
オブテックスグループ	2,400	1,254.00	3,009,600
千代田インテグレ	700	1,757.00	1,229,900
アイ・オー・データ機器	500	955.00	477,500
レーザーテック	6,400	9,350.00	59,840,000
スタンレー電気	10,200	2,554.00	26,050,800
岩崎電気	600	1,856.00	1,113,600
ウシオ電機	8,000	1,331.00	10,648,000
岡谷電機産業	1,200	333.00	399,600
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	324.00	453,600
エノモト	400	989.00	395,600
日本セラミック	1,500	2,231.00	3,346,500
遠藤照明	800	603.00	482,400
古河電池	1,100	1,492.00	1,641,200
双信電機	800	355.00	284,000
山一電機	1,100	1,439.00	1,582,900
図研	1,000	2,557.00	2,557,000

日本電子	2,900	2,680.00	7,772,000	
カシオ計算機	12,800	1,801.00	23,052,800	
ファナック	13,800	18,855.00	260,199,000	
日本シイエムケイ	3,500	405.00	1,417,500	
エンプラス	800	2,396.00	1,916,800	
大真空	500	1,831.00	915,500	
ローム	6,400	7,070.00	45,248,000	
浜松ホトニクス	10,400	4,645.00	48,308,000	
三井ハイテック	1,600	1,551.00	2,481,600	
新光電気工業	4,900	1,464.00	7,173,600	
京セラ	20,400	5,722.00	116,728,800	
太陽誘電	6,500	3,135.00	20,377,500	
村田製作所	42,600	6,160.00	262,416,000	
双葉電子工業	2,300	955.00	2,196,500	
北陸電気工業	600	890.00	534,000	
ニチコン	4,900	731.00	3,581,900	
日本ケミコン	1,100	1,672.00	1,839,200	
K O A	2,200	969.00	2,131,800	
市光工業	2,300	508.00	1,168,400	
小糸製作所	8,700	4,360.00	37,932,000	
ミツバ	2,700	484.00	1,306,800	
S C R E E Nホールディングス	2,500	4,780.00	11,950,000	
キャノン電子	1,500	1,645.00	2,467,500	
キャノン	78,100	2,190.00	171,039,000	代用有価証券 10,000株
リコー	36,900	827.00	30,516,300	
象印マホービン	4,300	1,579.00	6,789,700	
M U T O Hホールディングス	200	1,508.00	301,600	
東京エレクトロン	9,200	21,880.00	201,296,000	
トヨタ紡織	4,200	1,401.00	5,884,200	
芦森工業	300	883.00	264,900	
ユニプレス	2,800	958.00	2,682,400	
豊田自動織機	11,800	5,620.00	66,316,000	
モリタホールディングス	2,500	1,743.00	4,357,500	
三櫻工業	1,900	665.00	1,263,500	
デンソー	31,900	3,903.00	124,505,700	
東海理化電機製作所	3,800	1,565.00	5,947,000	
三井E & Sホールディングス	5,300	509.00	2,697,700	
川崎重工業	11,300	1,660.00	18,758,000	
名村造船所	4,700	165.00	775,500	
サノヤスホールディングス	1,800	149.00	268,200	
日本車輛製造	500	2,599.00	1,299,500	
三菱ロジスネクスト	2,000	986.00	1,972,000	

近畿車輛	200	1,231.00	246,200	
日産自動車	171,200	408.30	69,900,960	
いすゞ自動車	42,100	955.00	40,205,500	
トヨタ自動車	161,800	6,700.00	1,084,060,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,200	712.00	12,958,400	
三菱自動車工業	53,900	296.00	15,954,400	
エフテック	1,100	501.00	551,100	
レシップホールディングス	600	573.00	343,800	
G M B	300	672.00	201,600	
ファルテック	300	650.00	195,000	
武蔵精密工業	3,300	974.00	3,214,200	
日産車体	2,800	964.00	2,699,200	
新明和工業	3,900	1,023.00	3,989,700	
極東開発工業	2,700	1,291.00	3,485,700	
日信工業	3,000	2,201.00	6,603,000	
トピー工業	1,200	1,241.00	1,489,200	
ティラド	600	1,384.00	830,400	
タチエス	2,400	878.00	2,107,200	
N O K	7,800	1,340.00	10,452,000	
フタバ産業	4,100	456.00	1,869,600	
K Y B	1,600	2,125.00	3,400,000	
大同メタル工業	2,900	540.00	1,566,000	
プレス工業	7,300	270.00	1,971,000	
ミクニ	1,900	282.00	535,800	
太平洋工業	3,100	961.00	2,979,100	
ケーヒン	3,300	2,542.00	8,388,600	
河西工業	2,000	450.00	900,000	
アイシン精機	12,000	3,220.00	38,640,000	
マツダ	42,700	710.00	30,317,000	
今仙電機製作所	1,400	737.00	1,031,800	
本田技研工業	114,200	2,741.00	313,022,200	
スズキ	28,800	3,581.00	103,132,800	
S U B A R U	45,000	2,322.00	104,490,000	
安永	700	968.00	677,600	
ヤマハ発動機	18,900	1,569.00	29,654,100	
ショーワ	3,400	2,242.00	7,622,800	
T B K	1,700	423.00	719,100	
エクセディ	2,000	1,629.00	3,258,000	
豊田合成	4,700	2,223.00	10,448,100	
愛三工業	2,300	561.00	1,290,300	
盟和産業	200	961.00	192,200	
日本プラスト	1,200	455.00	546,000	

ヨロズ	1,400	1,082.00	1,514,800
エフ・シー・シー	2,400	1,882.00	4,516,800
シマノ	5,400	20,220.00	109,188,000
テイ・エス テック	3,400	2,961.00	10,067,400
ジャムコ	800	745.00	596,000
テルモ	41,000	3,941.00	161,581,000
クリエートメディック	500	943.00	471,500
日機装	4,300	951.00	4,089,300
日本エム・ディ・エム	800	1,555.00	1,244,000
島津製作所	17,300	2,678.00	46,329,400
JMS	1,200	788.00	945,600
長野計器	1,000	944.00	944,000
ブイ・テクノロジー	700	3,600.00	2,520,000
東京計器	900	914.00	822,600
愛知時計電機	200	4,350.00	870,000
インターアクション	800	1,935.00	1,548,000
オーバル	1,300	220.00	286,000
東京精密	2,600	3,340.00	8,684,000
マニー	5,800	2,810.00	16,298,000
ニコン	22,100	923.00	20,398,300
トプコン	7,300	858.00	6,263,400
オリンパス	80,200	1,774.50	142,314,900
理研計器	1,300	2,359.00	3,066,700
タムロン	1,200	1,818.00	2,181,600
HOYA	29,000	9,750.00	282,750,000
シード	600	710.00	426,000
ノーリツ鋼機	1,000	1,370.00	1,370,000
エー・アンド・デイ	1,300	677.00	880,100
朝日インテック	16,400	3,020.00	49,528,000
シチズン時計	16,900	363.00	6,134,700
リズム時計工業	500	623.00	311,500
大研医器	1,000	575.00	575,000
メニコン	2,000	5,100.00	10,200,000
シンシア	200	422.00	84,400
松風	600	1,484.00	890,400
セイコーホールディングス	2,000	1,793.00	3,586,000
ニプロ	10,000	1,140.00	11,400,000
中本パックス	400	1,434.00	573,600
スノーピーク	800	1,002.00	801,600
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,115.00	6,172,500
トランザクション	800	1,025.00	820,000
粧美堂	300	350.00	105,000

ニホンフラッシュ	1,400	1,308.00	1,831,200
前田工織	1,600	2,339.00	3,742,400
永大産業	1,900	311.00	590,900
アートネイチャー	1,500	595.00	892,500
バンダイナムコホールディングス	15,000	5,941.00	89,115,000
アイフィスジャパン	300	695.00	208,500
共立印刷	2,600	137.00	356,200
SHOEI	1,300	2,426.00	3,153,800
フランスベッドホールディングス	2,100	836.00	1,755,600
パイロットコーポレーション	2,400	3,345.00	8,028,000
萩原工業	800	1,378.00	1,102,400
トッパン・フォームズ	3,100	1,094.00	3,391,400
フジシールインターナショナル	3,200	2,071.00	6,627,200
タカラトミー	6,500	865.00	5,622,500
廣済堂	1,000	781.00	781,000
エステールホールディングス	300	604.00	181,200
アーク	5,500	117.00	643,500
タカノ	600	712.00	427,200
プロネクサス	1,200	1,091.00	1,309,200
ホクシン	600	119.00	71,400
ウッドワン	500	1,146.00	573,000
大建工業	1,000	1,640.00	1,640,000
凸版印刷	20,400	1,789.00	36,495,600
大日本印刷	19,000	2,426.00	46,094,000
共同印刷	400	2,801.00	1,120,400
NISSHA	3,000	1,003.00	3,009,000
光村印刷	100	1,479.00	147,900
TAKARA & COMPANY	700	1,796.00	1,257,200
アシックス	12,000	1,222.00	14,664,000
ツツミ	500	1,803.00	901,500
小松ウオール工業	400	1,773.00	709,200
ヤマハ	8,600	5,270.00	45,322,000
河合楽器製作所	400	2,655.00	1,062,000
クリナップ	1,400	501.00	701,400
ビジョン	8,800	3,955.00	34,804,000
オリバー	300	2,508.00	752,400
兼松サステック	100	1,406.00	140,600
キングジム	1,200	940.00	1,128,000
リンテック	3,400	2,481.00	8,435,400
イトーキ	3,100	352.00	1,091,200
任天堂	8,900	46,970.00	418,033,000
三菱鉛筆	2,400	1,420.00	3,408,000



タカラスタANDARD	3,000	1,472.00	4,416,000
コクヨ	6,900	1,266.00	8,735,400
ナカバヤシ	1,400	579.00	810,600
グロープライド	600	2,106.00	1,263,600
オカムラ	5,000	766.00	3,830,000
美津濃	1,300	1,976.00	2,568,800
東京電力ホールディングス	115,800	344.00	39,835,200
中部電力	44,400	1,412.50	62,715,000
関西電力	55,000	1,070.00	58,850,000
中国電力	20,900	1,440.00	30,096,000
北陸電力	13,300	690.00	9,177,000
東北電力	36,200	1,051.00	38,046,200
四国電力	13,100	809.00	10,597,900
九州電力	29,900	904.00	27,029,600
北海道電力	13,600	420.00	5,712,000
沖縄電力	2,840	1,792.00	5,089,280
電源開発	11,600	1,999.00	23,188,400
エフオン	800	546.00	436,800
イーレックス	2,100	1,339.00	2,811,900
レノバ	2,400	891.00	2,138,400
東京瓦斯	27,900	2,469.50	68,899,050
大阪瓦斯	28,100	2,078.00	58,391,800
東邦瓦斯	7,100	5,530.00	39,263,000
北海道瓦斯	800	1,589.00	1,271,200
広島ガス	3,000	348.00	1,044,000
西部瓦斯	1,600	2,543.00	4,068,800
静岡ガス	4,100	968.00	3,968,800
メタウォーター	700	4,635.00	3,244,500
SBSホールディングス	1,300	2,250.00	2,925,000
東武鉄道	15,100	3,695.00	55,794,500
相鉄ホールディングス	4,700	2,901.00	13,634,700
東急	36,600	1,581.00	57,864,600
京浜急行電鉄	18,600	1,694.00	31,508,400
小田急電鉄	21,600	2,626.00	56,721,600
京王電鉄	7,500	6,140.00	46,050,000
京成電鉄	10,100	3,390.00	34,239,000
富士急行	2,000	3,075.00	6,150,000
東日本旅客鉄道	25,500	8,153.00	207,901,500
西日本旅客鉄道	12,900	6,391.00	82,443,900
東海旅客鉄道	12,100	17,705.00	214,230,500
西武ホールディングス	19,500	1,270.00	24,765,000
鴻池運輸	2,300	1,151.00	2,647,300

西日本鉄道	4,000	2,862.00	11,448,000
ハマキョウレックス	1,100	3,150.00	3,465,000
サカイ引越センター	800	5,800.00	4,640,000
近鉄グループホールディングス	13,700	5,010.00	68,637,000
阪急阪神ホールディングス	18,300	3,730.00	68,259,000
南海電気鉄道	6,500	2,504.00	16,276,000
京阪ホールディングス	6,100	4,850.00	29,585,000
神戸電鉄	300	3,670.00	1,101,000
名古屋鉄道	11,300	3,075.00	34,747,500
山陽電気鉄道	1,000	2,160.00	2,160,000
日本通運	4,800	5,680.00	27,264,000
ヤマトホールディングス	24,100	2,394.00	57,695,400
山九	3,800	4,035.00	15,333,000
丸運	1,000	234.00	234,000
丸全昭和運輸	1,100	2,872.00	3,159,200
センコーグループホールディングス	7,600	801.00	6,087,600
トナミホールディングス	300	6,030.00	1,809,000
ニッコンホールディングス	4,900	2,146.00	10,515,400
日本石油輸送	100	3,005.00	300,500
福山通運	1,800	3,575.00	6,435,000
セイノーホールディングス	10,300	1,424.00	14,667,200
エスライン	500	1,010.00	505,000
神奈川中央交通	300	4,125.00	1,237,500
日立物流	2,500	2,839.00	7,097,500
丸和運輸機関	1,500	2,823.00	4,234,500
C & F ロジホールディングス	1,400	1,400.00	1,960,000
九州旅客鉄道	12,000	2,899.00	34,788,000
S Gホールディングス	14,400	3,455.00	49,752,000
日本郵船	11,500	1,472.00	16,928,000
商船三井	8,700	1,836.00	15,973,200
川崎汽船	4,200	980.00	4,116,000
N S ユナイテッド海運	800	1,463.00	1,170,400
明治海運	1,500	320.00	480,000
飯野海運	6,500	333.00	2,164,500
共栄タンカー	200	795.00	159,000
乾汽船	800	930.00	744,000
日本航空	24,300	2,092.00	50,835,600
A N A ホールディングス	25,100	2,565.50	64,394,050
パスコ	300	1,465.00	439,500
トランコム	400	6,900.00	2,760,000
日新	1,200	1,601.00	1,921,200
三菱倉庫	4,300	2,701.00	11,614,300

三井倉庫ホールディングス	1,600	1,501.00	2,401,600
住友倉庫	4,900	1,295.00	6,345,500
澁澤倉庫	800	2,019.00	1,615,200
東陽倉庫	2,400	320.00	768,000
日本トランスシティ	3,100	538.00	1,667,800
ケイヒン	300	1,281.00	384,300
中央倉庫	800	959.00	767,200
川西倉庫	200	1,017.00	203,400
安田倉庫	1,100	880.00	968,000
ファイブホールディングス	300	1,174.00	352,200
東洋埠頭	400	1,323.00	529,200
宇徳	1,200	455.00	546,000
上組	7,700	2,092.00	16,108,400
サンリツ	300	601.00	180,300
キムラユニティー	400	994.00	397,600
キューソー流通システム	300	1,563.00	468,900
近鉄エクスプレス	2,900	1,744.00	5,057,600
東海運	800	265.00	212,000
エーアイティー	1,000	753.00	753,000
内外トランスライン	500	999.00	499,500
日本コンセプト	400	1,312.00	524,800
NEC ネットエスアイ	4,000	1,972.00	7,888,000
クロスキャット	400	1,052.00	420,800
システナ	5,100	1,454.00	7,415,400
デジタルアーツ	700	8,130.00	5,691,000
日鉄ソリューションズ	2,100	2,824.00	5,930,400
キューブシステム	800	758.00	606,400
エイジア	300	1,254.00	376,200
コア	600	1,102.00	661,200
ラクーンホールディングス	700	788.00	551,600
ソリトンシステムズ	600	1,447.00	868,200
ソフトクリエイティブホールディングス	600	2,079.00	1,247,400
T I S	14,200	2,157.00	30,629,400
ネオス	600	683.00	409,800
電算システム	600	3,315.00	1,989,000
グリー	8,700	440.00	3,828,000
コーエーテクモホールディングス	2,900	3,230.00	9,367,000
三菱総合研究所	600	3,880.00	2,328,000
ボルテージ	400	431.00	172,400
電算	200	2,155.00	431,000
A G S	800	791.00	632,800
ファインデックス	1,200	955.00	1,146,000

ブレインパッド	400	4,585.00	1,834,000
K L a b	2,800	698.00	1,954,400
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	874.00	1,573,200
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,768.00	553,600
ネクソン	39,700	2,379.00	94,446,300
アイスタイル	4,100	282.00	1,156,200
エムアップホールディングス	400	2,235.00	894,000
エイチーム	1,000	819.00	819,000
エニグモ	1,400	999.00	1,398,600
テクノスジャパン	1,200	579.00	694,800
コロプラ	4,700	949.00	4,460,300
ブロードリーフ	7,000	513.00	3,591,000
クロス・マーケティンググループ	700	304.00	212,800
デジタルハーツホールディングス	800	812.00	649,600
システム情報	1,100	1,293.00	1,422,300
メディアドゥ	500	4,565.00	2,282,500
じげん	3,600	337.00	1,213,200
ブイキューブ	900	1,215.00	1,093,500
エンカレッジ・テクノロジー	300	797.00	239,100
サイバーリンクス	200	1,643.00	328,600
フィックスターズ	1,500	1,265.00	1,897,500
C A R T A H O L D I N G S	700	1,050.00	735,000
オブティム	800	3,255.00	2,604,000
セレス	500	1,186.00	593,000
S H I F T	600	10,300.00	6,180,000
ティーガイア	1,300	2,066.00	2,685,800
セック	200	3,080.00	616,000
日本アジアグループ	1,600	291.00	465,600
テクマトリックス	1,000	3,670.00	3,670,000
プロシップ	400	1,181.00	472,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,400	1,723.00	5,858,200
G M O ペイメントゲートウェイ	3,000	11,160.00	33,480,000
ザッパラス	600	384.00	230,400
システムリサーチ	400	1,893.00	757,200
インターネットイニシアティブ	2,100	3,835.00	8,053,500
さくらインターネット	1,600	603.00	964,800
ヴィンクス	400	1,202.00	480,800
G M O クラウド	300	7,090.00	2,127,000
S R A ホールディングス	800	2,314.00	1,851,200
システムインテグレータ	500	837.00	418,500
朝日ネット	1,000	1,355.00	1,355,000
e B A S E	1,700	1,181.00	2,007,700

アバント	1,400	1,014.00	1,419,600
アドソル日進	500	2,341.00	1,170,500
フリービット	800	811.00	648,800
コムチュア	1,600	2,717.00	4,347,200
サイバーコム	300	1,735.00	520,500
アステリア	900	462.00	415,800
アイル	800	1,486.00	1,188,800
マークラインズ	700	2,051.00	1,435,700
メディカル・データ・ビジョン	1,100	1,025.00	1,127,500
g u m i	1,900	957.00	1,818,300
ショーケース	400	574.00	229,600
モバイルファクトリー	300	1,042.00	312,600
テラスカイ	500	2,768.00	1,384,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,385.00	831,000
P C Iホールディングス	600	1,175.00	705,000
パイプドHD	200	1,482.00	296,400
アイビーシー	200	931.00	186,200
ネオジャパン	300	1,819.00	545,700
P R T I M E S	100	2,492.00	249,200
ランドコンピュータ	200	1,064.00	212,800
ダブルスタンダード	200	4,200.00	840,000
オープンドア	700	1,155.00	808,500
マイネット	500	1,015.00	507,500
アカツキ	500	3,785.00	1,892,500
ベネフィットジャパン	100	1,391.00	139,100
U b i c o mホールディングス	300	1,844.00	553,200
L I N E	3,300	5,350.00	17,655,000
カナミックネットワーク	1,300	840.00	1,092,000
ノムラシステムコーポレーション	400	532.00	212,800
チェンジ	500	5,640.00	2,820,000
シンクロ・フード	700	321.00	224,700
オークネット	900	1,129.00	1,016,100
エイトレッド	200	1,921.00	384,200
A O I T Y O H o l d i n g s	1,500	446.00	669,000
マクロミル	2,900	696.00	2,018,400
ビーグリー	300	1,652.00	495,600
オロ	400	2,458.00	983,200
ユーザーローカル	100	3,130.00	313,000
テモナ	300	738.00	221,400
サインポスト	300	1,650.00	495,000
ソルクシーズ	600	655.00	393,000
フェイス	500	650.00	325,000

プロトコーポレーション	1,300	996.00	1,294,800
ハイマックス	200	1,949.00	389,800
野村総合研究所	20,200	2,797.00	56,499,400
サイバネットシステム	1,100	646.00	710,600
C Eホールディングス	800	480.00	384,000
日本システム技術	200	1,411.00	282,200
インタージホールディングス	1,800	855.00	1,539,000
東邦システムサイエンス	400	921.00	368,400
ソースネクスト	6,900	275.00	1,897,500
インフォコム	1,600	2,949.00	4,718,400
HEROZ	200	3,565.00	713,000
ラクスル	1,100	2,852.00	3,137,200
F I G	1,600	260.00	416,000
システムサポート	300	2,132.00	639,600
イーソル	700	1,239.00	867,300
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,975.00	3,160,000
東海ソフト	100	1,179.00	117,900
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	950.00	285,000
トビラシステムズ	200	1,938.00	387,600
フォーカスシステムズ	900	837.00	753,300
クレスコ	900	1,396.00	1,256,400
フジ・メディア・ホールディングス	13,700	1,033.00	14,152,100
オービック	4,900	18,380.00	90,062,000
ジャストシステム	2,300	7,170.00	16,491,000
T D Cソフト	1,300	904.00	1,175,200
Zホールディングス	195,500	440.00	86,020,000
トレンドマイクロ	6,300	5,960.00	37,548,000
I Dホールディングス	600	1,367.00	820,200
日本オラクル	2,900	11,850.00	34,365,000
アルファシステムズ	500	3,815.00	1,907,500
フューチャー	1,700	1,700.00	2,890,000
C A C Holdings	1,000	1,269.00	1,269,000
S Bテクノロジー	500	2,747.00	1,373,500
トーセ	400	809.00	323,600
オービックビジネスコンサルタント	1,500	5,820.00	8,730,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,500	3,695.00	24,017,500
アイティフォー	1,800	666.00	1,198,800
東計電算	200	4,055.00	811,000
エクスネット	200	965.00	193,000
大塚商会	7,700	5,410.00	41,657,000
サイボウズ	1,700	3,050.00	5,185,000
ソフトブレーン	900	462.00	415,800

電通国際情報サービス	900	4,660.00	4,194,000
A C C E S S	1,400	911.00	1,275,400
デジタルガレージ	2,600	3,585.00	9,321,000
E Mシステムズ	2,100	919.00	1,929,900
ウェザーニューズ	500	3,700.00	1,850,000
C I J	1,000	841.00	841,000
ビジネスエンジニアリング	200	2,616.00	523,200
日本エンタープライズ	1,500	246.00	369,000
WOWOW	700	2,455.00	1,718,500
スカラ	1,000	653.00	653,000
インテリジェント ウェイブ	900	773.00	695,700
I M A G I C A G R O U P	1,300	382.00	496,600
ネットワンシステムズ	5,400	3,325.00	17,955,000
システムソフト	3,200	92.00	294,400
アルゴグラフィックス	1,200	3,560.00	4,272,000
マーベラス	2,200	690.00	1,518,000
エイベックス	2,400	854.00	2,049,600
日本ユニシス	4,400	3,150.00	13,860,000
兼松エレクトロニクス	800	3,720.00	2,976,000
東京放送ホールディングス	8,700	1,672.00	14,546,400
日本テレビホールディングス	11,900	1,171.00	13,934,900
朝日放送グループホールディングス	1,400	788.00	1,103,200
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,543.00	6,017,700
スカパーJ S A Tホールディングス	9,400	430.00	4,042,000
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,369.00	2,842,800
日本BS放送	500	1,037.00	518,500
ビジョン	1,400	747.00	1,045,800
スマートバリュー	400	1,128.00	451,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	600	1,226.00	735,600
コネクシオ	800	1,400.00	1,120,000
クロップス	300	715.00	214,500
日本電信電話	190,200	2,474.00	470,554,800
K D D I	106,000	3,141.00	332,946,000
ソフトバンク	129,300	1,346.00	174,037,800
光通信	1,500	23,610.00	35,415,000
N T T ドコモ	101,700	2,895.00	294,421,500
エムティーアイ	1,400	605.00	847,000
G M O インターネット	5,600	2,680.00	15,008,000
アイドママーケティングコミュニケーション	400	474.00	189,600
K A D O K A W A	3,800	1,774.00	6,741,200
学研ホールディングス	1,900	1,458.00	2,770,200
ゼンリン	2,800	1,221.00	3,418,800

昭文社ホールディングス	700	404.00	282,800
インプレスホールディングス	1,300	141.00	183,300
アイネット	700	1,405.00	983,500
松竹	900	14,160.00	12,744,000
東宝	8,400	3,890.00	32,676,000
東映	500	14,340.00	7,170,000
エヌ・ティ・ティ・データ	37,900	1,185.00	44,911,500
ピー・シー・エー	200	4,195.00	839,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,570.00	771,000
D T S	3,200	2,250.00	7,200,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,100	5,440.00	33,184,000
シーイーシー	1,500	1,731.00	2,596,500
カブコン	6,700	3,850.00	25,795,000
アイ・エス・ピー	300	1,959.00	587,700
ジャステック	900	1,203.00	1,082,700
S C S K	3,300	5,220.00	17,226,000
日本システムウエア	500	2,161.00	1,080,500
アイネス	1,400	1,301.00	1,821,400
T K C	1,200	5,430.00	6,516,000
富士ソフト	1,800	4,210.00	7,578,000
N S D	4,600	1,595.00	7,337,000
コナミホールディングス	5,200	3,530.00	18,356,000
福井コンピュータホールディングス	600	2,644.00	1,586,400
J B C Cホールディングス	1,000	1,471.00	1,471,000
ミロク情報サービス	1,300	2,339.00	3,040,700
ソフトバンクグループ	112,900	4,905.00	553,774,500
ハウスイ	200	897.00	179,400
高千穂交易	600	942.00	565,200
カワニシホールディングス	200	1,451.00	290,200
伊藤忠食品	400	4,875.00	1,950,000
エレマテック	1,400	862.00	1,206,800
J A L U X	400	1,714.00	685,600
あらた	1,100	4,415.00	4,856,500
トーメンデバイス	200	3,315.00	663,000
東京エレクトロン デバイス	500	2,675.00	1,337,500
フィールズ	1,200	331.00	397,200
双日	79,000	238.00	18,802,000
アルフレッサ ホールディングス	15,900	2,207.00	35,091,300
横浜冷凍	3,800	892.00	3,389,600
神栄	300	481.00	144,300
ラサ商事	800	853.00	682,400
アルコニックス	1,600	1,159.00	1,854,400



神戸物産	4,900	6,050.00	29,645,000
ハイパー	300	553.00	165,900
あい ホールディングス	2,100	1,511.00	3,173,100
ディーブイエックス	600	872.00	523,200
ダイワボウホールディングス	1,200	7,450.00	8,940,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,400	1,492.00	5,072,800
ラクト・ジャパン	500	3,690.00	1,845,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	1,061.00	2,864,700
八洲電機	1,100	877.00	964,700
メディアスホールディングス	900	912.00	820,800
レスターホールディングス	1,500	2,110.00	3,165,000
ジューテックホールディングス	400	979.00	391,600
大光	700	663.00	464,100
OCHIホールディングス	500	1,454.00	727,000
TOKAIホールディングス	7,600	958.00	7,280,800
黒谷	500	519.00	259,500
Cominix	300	705.00	211,500
三洋貿易	1,500	984.00	1,476,000
ビューティガレージ	300	1,483.00	444,900
ウイン・パートナーズ	1,100	897.00	986,700
ミタチ産業	500	595.00	297,500
シップヘルスケアホールディングス	2,300	4,375.00	10,062,500
明治電機工業	500	1,422.00	711,000
デリカフーズホールディングス	600	614.00	368,400
スターティアホールディングス	400	603.00	241,200
コメダホールディングス	3,100	1,835.00	5,688,500
ピーバンドットコム	200	919.00	183,800
アセンテック	200	3,035.00	607,000
富士興産	500	434.00	217,000
協栄産業	200	1,197.00	239,400
小野建	1,300	1,178.00	1,531,400
南陽	300	1,448.00	434,400
佐島電機	1,000	798.00	798,000
エコートレーディング	400	518.00	207,200
伯東	900	949.00	854,100
コンドーテック	1,100	1,066.00	1,172,600
中山福	900	504.00	453,600
ナガイレーベン	1,900	2,604.00	4,947,600
三菱食品	1,600	2,768.00	4,428,800
松田産業	1,100	1,312.00	1,443,200
第一興商	2,100	3,390.00	7,119,000
メディバルホールディングス	15,400	2,072.00	31,908,800

S P K	600	1,350.00	810,000
萩原電気ホールディングス	500	2,036.00	1,018,000
アズワン	900	11,020.00	9,918,000
スズデン	500	1,131.00	565,500
シモジマ	900	1,207.00	1,086,300
ドウシシャ	1,400	1,565.00	2,191,000
小津産業	300	1,681.00	504,300
高速	900	1,430.00	1,287,000
たけびし	600	1,403.00	841,800
リックス	400	1,535.00	614,000
丸文	1,400	461.00	645,400
ハピネット	1,200	1,089.00	1,306,800
橋本総業ホールディングス	300	2,025.00	607,500
日本ライフライン	4,200	1,346.00	5,653,200
タカショー	1,000	462.00	462,000
マルカ	500	1,828.00	914,000
I D O M	4,000	515.00	2,060,000
進和	900	1,860.00	1,674,000
エスケイジャパン	500	305.00	152,500
ダイトロン	600	1,661.00	996,600
シークス	1,900	1,020.00	1,938,000
田中商事	500	672.00	336,000
オーハシテクニカ	800	1,547.00	1,237,600
白銅	600	1,354.00	812,400
伊藤忠商事	97,500	2,270.00	221,325,000
丸紅	148,700	500.60	74,439,220
高島	300	1,700.00	510,000
長瀬産業	8,100	1,267.00	10,262,700
蝶理	1,000	1,771.00	1,771,000
豊田通商	15,900	2,699.00	42,914,100
三共生興	2,300	427.00	982,100
兼松	5,300	1,287.00	6,821,100
ツカモトコーポレーション	300	1,121.00	336,300
三井物産	123,700	1,635.00	202,249,500
日本紙パルプ商事	800	3,820.00	3,056,000
カメイ	1,900	1,008.00	1,915,200
東都水産	200	3,335.00	667,000
O U G ホールディングス	200	2,560.00	512,000
スターゼン	500	4,370.00	2,185,000
山善	5,600	888.00	4,972,800
椿本興業	300	3,640.00	1,092,000
住友商事	90,100	1,238.00	111,543,800

内田洋行	600	6,180.00	3,708,000
三菱商事	100,200	2,341.50	234,618,300
第一実業	700	3,615.00	2,530,500
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	2,193.00	7,894,800
西華産業	800	1,190.00	952,000
佐藤商事	1,200	863.00	1,035,600
菱洋エレクトロ	1,500	2,671.00	4,006,500
東京産業	1,400	524.00	733,600
ユアサ商事	1,400	2,903.00	4,064,200
神鋼商事	400	1,916.00	766,400
トルク	1,000	337.00	337,000
阪和興業	2,700	1,913.00	5,165,100
正栄食品工業	900	4,280.00	3,852,000
カナデン	1,200	1,269.00	1,522,800
菱電商事	1,100	1,434.00	1,577,400
フルサト工業	800	1,379.00	1,103,200
岩谷産業	3,200	3,740.00	11,968,000
ナイス	700	780.00	546,000
昭光通商	500	608.00	304,000
ニチモウ	200	1,797.00	359,400
極東貿易	400	1,464.00	585,600
イワキ	2,000	441.00	882,000
三愛石油	3,500	991.00	3,468,500
稲畑産業	3,200	1,227.00	3,926,400
G S Iクレオス	400	1,094.00	437,600
明和産業	1,500	450.00	675,000
クワザワ	600	518.00	310,800
ヤマエ久野	400	1,218.00	487,200
ワキタ	3,100	939.00	2,910,900
東邦ホールディングス	4,600	2,006.00	9,227,600
サンゲツ	3,900	1,383.00	5,393,700
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,120.00	2,352,000
シナネンホールディングス	600	2,585.00	1,551,000
伊藤忠エネクス	3,200	845.00	2,704,000
サンリオ	4,000	1,618.00	6,472,000
サンワテクノス	1,100	792.00	871,200
リョーサン	1,600	2,264.00	3,622,400
新光商事	2,300	842.00	1,936,600
トーホー	700	1,754.00	1,227,800
三信電気	800	1,507.00	1,205,600
東陽テクニカ	1,600	1,022.00	1,635,200
モスフードサービス	1,900	2,909.00	5,527,100

加賀電子	1,400	1,961.00	2,745,400
ソーダニッカ	1,600	519.00	830,400
立花エレテック	1,100	1,662.00	1,828,200
フォーバル	700	988.00	691,600
PALTAC	2,300	4,865.00	11,189,500
三谷産業	2,100	334.00	701,400
太平洋興発	600	602.00	361,200
西本Wismettacホールディングス	300	2,037.00	611,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,767.00	176,700
国際紙パルプ商事	3,500	286.00	1,001,000
ヤマタネ	700	1,169.00	818,300
丸紅建材リース	200	1,540.00	308,000
日鉄物産	1,000	3,505.00	3,505,000
泉州電業	500	2,720.00	1,360,000
トラスコ中山	3,000	2,563.00	7,689,000
オートバックスセブン	5,300	1,377.00	7,298,100
モリト	1,200	655.00	786,000
加藤産業	2,100	3,615.00	7,591,500
北恵	400	943.00	377,200
イノテック	800	943.00	754,400
イエローハット	2,700	1,412.00	3,812,400
J Kホールディングス	1,300	785.00	1,020,500
日伝	1,300	2,261.00	2,939,300
北沢産業	1,200	271.00	325,200
杉本商事	800	1,831.00	1,464,800
因幡電機産業	4,100	2,332.00	9,561,200
東テク	500	2,010.00	1,005,000
ミスミグループ本社	17,900	2,682.00	48,007,800
アルテック	1,300	220.00	286,000
タキヒヨー	500	1,755.00	877,500
蔵王産業	300	1,415.00	424,500
スズケン	6,100	3,960.00	24,156,000
ジェコス	1,000	875.00	875,000
グローセル	1,600	444.00	710,400
ローソン	3,600	5,850.00	21,060,000
サンエー	1,200	4,185.00	5,022,000
カワチ薬品	1,100	2,647.00	2,911,700
エービーシー・マート	2,200	6,220.00	13,684,000
ハードオフコーポレーション	600	695.00	417,000
アスクル	1,500	3,640.00	5,460,000
ゲオホールディングス	2,600	1,308.00	3,400,800
アダストリア	2,000	1,627.00	3,254,000

ジーフット	900	454.00	408,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	500.00	100,000
くら寿司	700	4,835.00	3,384,500
キャンドウ	700	2,053.00	1,437,100
パルグループホールディングス	1,500	1,304.00	1,956,000
エディオン	6,500	1,000.00	6,500,000
サーラコーポレーション	3,000	549.00	1,647,000
ワッツ	600	858.00	514,800
ハローズ	600	3,020.00	1,812,000
フジオフードシステム	1,200	1,512.00	1,814,400
あみやき亭	300	3,030.00	909,000
ひらまつ	2,700	180.00	486,000
大黒天物産	300	4,425.00	1,327,500
ハニーズホールディングス	1,300	1,050.00	1,365,000
ファーマライズホールディングス	400	651.00	260,400
アルペン	1,100	1,789.00	1,967,900
ハブ	400	671.00	268,400
クオールホールディングス	2,100	1,156.00	2,427,600
ジinzホールディングス	800	6,230.00	4,984,000
ビックカメラ	8,500	1,100.00	9,350,000
D C Mホールディングス	7,900	1,094.00	8,642,600
Monotaro	10,200	4,130.00	42,126,000
東京一番フーズ	400	497.00	198,800
DDホールディングス	600	910.00	546,000
きちりホールディングス	400	607.00	242,800
アークランドサービスホールディングス	1,100	1,898.00	2,087,800
J.フロント リテイリング	17,000	861.00	14,637,000
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,722.00	3,616,200
マツモトキヨシホールディングス	5,900	3,835.00	22,626,500
ブロンコビリー	800	2,530.00	2,024,000
ZOZO	9,800	2,220.00	21,756,000
トレジャー・ファクトリー	400	683.00	273,200
物語コーポレーション	400	8,220.00	3,288,000
ココカラファイン	1,500	5,750.00	8,625,000
三越伊勢丹ホールディングス	25,000	681.00	17,025,000
Hamee	500	1,898.00	949,000
ウエルシアホールディングス	4,200	8,950.00	37,590,000
クリエイトSDホールディングス	2,400	3,420.00	8,208,000
丸善CHIホールディングス	1,800	390.00	702,000
ミサワ	300	481.00	144,300
ティーライフ	200	1,024.00	204,800
エー・ピーカンパニー	300	466.00	139,800

チムニー	400	1,634.00	653,600
シュッピン	1,000	725.00	725,000
オイシックス・ラ・大地	1,400	2,019.00	2,826,600
ネクステージ	2,100	770.00	1,617,000
ジョイフル本田	4,200	1,341.00	5,632,200
鳥貴族	400	1,570.00	628,000
キリン堂ホールディングス	600	2,194.00	1,316,400
ホットランド	1,000	1,195.00	1,195,000
すかいらーくホールディングス	16,000	1,754.00	28,064,000
SFPホールディングス	800	1,546.00	1,236,800
綿半ホールディングス	500	1,781.00	890,500
ヨシックス	200	2,038.00	407,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,100	1,124.00	4,608,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	560.00	392,000
B E E N O S	700	951.00	665,700
あさひ	1,100	1,436.00	1,579,600
日本調剤	900	1,588.00	1,429,200
コスモス薬品	1,200	16,720.00	20,064,000
トーエル	700	694.00	485,800
オンリー	300	601.00	180,300
セブン&アイ・ホールディングス	55,900	3,579.00	200,066,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,700	755.00	5,813,500
ツルハホールディングス	3,100	15,780.00	48,918,000
サンマルクホールディングス	1,100	1,742.00	1,916,200
フェリシモ	300	1,096.00	328,800
トリドールホールディングス	3,500	1,241.00	4,343,500
T O K Y O B A S E	1,300	346.00	449,800
ウイルプラスホールディングス	200	708.00	141,600
J Mホールディングス	1,100	2,711.00	2,982,100
サツドラホールディングス	200	1,975.00	395,000
アレンザホールディングス	800	866.00	692,800
串カツ田中ホールディングス	300	1,581.00	474,300
パロックジャパンリミテッド	1,000	620.00	620,000
クスリのアオキホールディングス	1,300	8,550.00	11,115,000
力の源ホールディングス	700	667.00	466,900
スシローグローバルホールディングス	7,800	2,190.00	17,082,000
L I X I L ビバ	1,400	2,593.00	3,630,200
メディカルシステムネットワーク	1,500	488.00	732,000
はるやまホールディングス	700	734.00	513,800
ノジマ	2,500	2,538.00	6,345,000
カッパ・クリエイト	2,000	1,464.00	2,928,000

ライトオン	1,100	557.00	612,700
ジーンズメイト	500	219.00	109,500
良品計画	19,000	1,443.00	27,417,000
三城ホールディングス	1,600	298.00	476,800
アドヴァン	2,200	1,308.00	2,877,600
アルビス	500	2,126.00	1,063,000
コナカ	1,800	286.00	514,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,596.00	319,200
G - 7ホールディングス	900	2,418.00	2,176,200
イオン北海道	1,900	790.00	1,501,000
コジマ	2,500	534.00	1,335,000
ヒマラヤ	500	798.00	399,000
コーナン商事	2,000	3,025.00	6,050,000
エコス	500	1,808.00	904,000
ワタミ	1,700	986.00	1,676,200
マルシェ	400	600.00	240,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	31,400	2,266.00	71,152,400
西松屋チェーン	3,100	939.00	2,910,900
ゼンショーホールディングス	6,800	2,141.00	14,558,800
幸楽苑ホールディングス	900	1,510.00	1,359,000
ハークスレイ	300	960.00	288,000
サイゼリヤ	2,100	2,062.00	4,330,200
V Tホールディングス	6,000	332.00	1,992,000
魚力	400	1,568.00	627,200
フジ・コーポレーション	400	1,941.00	776,400
ユナイテッドアローズ	1,500	1,792.00	2,688,000
ハイデイ日高	2,100	1,773.00	3,723,300
京都きもの友禅	1,000	228.00	228,000
コロワイド	4,700	1,540.00	7,238,000
ピーシーデポコーポレーション	1,900	660.00	1,254,000
壱番屋	1,000	5,090.00	5,090,000
P L A N T	400	562.00	224,800
スギホールディングス	2,900	6,990.00	20,271,000
薬王堂ホールディングス	600	2,430.00	1,458,000
ヴィア・ホールディングス	1,800	451.00	811,800
スクロール	2,200	401.00	882,200
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,840.00	2,760,000
ファミリーマート	11,400	1,837.00	20,941,800
木曽路	1,900	2,476.00	4,704,400
S R Sホールディングス	1,700	896.00	1,523,200
千趣会	2,600	370.00	962,000
タカキュー	1,200	142.00	170,400

リテールパートナーズ	1,900	1,488.00	2,827,200
ケーヨー	3,000	633.00	1,899,000
上新電機	1,700	2,050.00	3,485,000
日本瓦斯	2,300	4,515.00	10,384,500
ロイヤルホールディングス	2,500	1,895.00	4,737,500
東天紅	100	968.00	96,800
いなげや	1,800	1,645.00	2,961,000
島忠	2,700	2,778.00	7,500,600
チヨダ	1,500	1,090.00	1,635,000
ライフコーポレーション	1,100	3,360.00	3,696,000
リンガーハット	1,800	2,368.00	4,262,400
MrMaxHD	2,000	464.00	928,000
テンアライド	1,400	382.00	534,800
AOKIホールディングス	2,900	629.00	1,824,100
オークワ	2,200	1,549.00	3,407,800
コメリ	2,200	2,563.00	5,638,600
青山商事	2,900	785.00	2,276,500
しまむら	1,700	7,340.00	12,478,000
はせがわ	800	331.00	264,800
高島屋	10,400	946.00	9,838,400
松屋	2,900	650.00	1,885,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,700	785.00	5,259,500
近鉄百貨店	600	3,175.00	1,905,000
丸井グループ	13,100	1,976.00	25,885,600
アクシアル リテイリング	1,200	4,130.00	4,956,000
イオン	55,000	2,376.00	130,680,000
イズミ	2,900	3,230.00	9,367,000
平和堂	2,900	1,881.00	5,454,900
フジ	1,700	1,851.00	3,146,700
ヤオコー	1,600	7,420.00	11,872,000
ゼビオホールディングス	1,800	861.00	1,549,800
ケーズホールディングス	13,800	1,424.00	19,651,200
Olympicグループ	800	877.00	701,600
日産東京販売ホールディングス	2,200	240.00	528,000
シルバーライフ	200	2,056.00	411,200
一家ダイニングプロジェクト	200	602.00	120,400
Genky DrugStores	600	3,270.00	1,962,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	652.00	195,600
ブックオフグループホールディングス	900	802.00	721,800
アインホールディングス	1,800	6,910.00	12,438,000
元気寿司	400	2,363.00	945,200
ヤマダ電機	43,500	542.00	23,577,000



アークランドサカモト	2,200	1,604.00	3,528,800	
ニトリホールディングス	6,200	19,085.00	118,327,000	
愛眼	1,200	216.00	259,200	
ケーユーホールディングス	800	808.00	646,400	
吉野家ホールディングス	4,700	2,253.00	10,589,100	
松屋フーズホールディングス	700	3,650.00	2,555,000	
サガミホールディングス	1,900	1,239.00	2,354,100	
関西スーパーマーケット	1,200	1,078.00	1,293,600	
王将フードサービス	1,000	6,000.00	6,000,000	
プレナス	1,600	1,784.00	2,854,400	
ミニストップ	1,100	1,530.00	1,683,000	
アークス	2,900	2,140.00	6,206,000	
パローホールディングス	3,200	2,145.00	6,864,000	
藤久	200	1,000.00	200,000	
ベルク	700	6,700.00	4,690,000	
大庄	800	1,271.00	1,016,800	
ファーストリテイリング	1,900	60,800.00	115,520,000	
サンドラッグ	5,400	3,525.00	19,035,000	
サックスパー ホールディングス	1,300	576.00	748,800	
ヤマザワ	400	1,696.00	678,400	
やまや	300	2,266.00	679,800	
ベルーナ	3,100	609.00	1,887,900	
島根銀行	400	517.00	206,800	
じもとホールディングス	9,800	94.00	921,200	
めぶきフィナンシャルグループ	74,300	242.00	17,980,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	1,127.00	2,254,000	
九州フィナンシャルグループ	31,300	446.00	13,959,800	
ゆうちょ銀行	40,500	871.00	35,275,500	
富山第一銀行	3,400	256.00	870,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,700	345.00	28,186,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,500	718.00	6,821,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,400	411.00	3,452,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,404.00	1,825,200	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,211.00	5,527,500	
新生銀行	10,500	1,366.00	14,343,000	
あおぞら銀行	8,500	1,940.00	16,490,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	978,200	429.10	419,745,620	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	157,000	373.90	58,702,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,000	3,005.00	81,135,000	
三井住友フィナンシャルグループ	98,900	3,105.00	307,084,500	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	47,700	503.00	23,993,100	

群馬銀行	27,400	331.00	9,069,400
武蔵野銀行	2,100	1,528.00	3,208,800
千葉興業銀行	4,000	240.00	960,000
筑波銀行	6,000	167.00	1,002,000
七十七銀行	4,800	1,522.00	7,305,600
青森銀行	1,100	2,208.00	2,428,800
秋田銀行	900	1,496.00	1,346,400
山形銀行	1,600	1,286.00	2,057,600
岩手銀行	900	2,578.00	2,320,200
東邦銀行	12,800	222.00	2,841,600
東北銀行	700	933.00	653,100
みちのく銀行	900	1,147.00	1,032,300
ふくおかフィナンシャルグループ	12,000	1,693.00	20,316,000
静岡銀行	35,400	694.00	24,567,600
十六銀行	1,800	1,997.00	3,594,600
スルガ銀行	14,600	392.00	5,723,200
八十二銀行	34,500	400.00	13,800,000
山梨中央銀行	1,700	838.00	1,424,600
大垣共立銀行	2,800	2,202.00	6,165,600
福井銀行	1,200	1,587.00	1,904,400
北國銀行	1,400	2,759.00	3,862,600
清水銀行	600	1,756.00	1,053,600
富山銀行	300	2,291.00	687,300
滋賀銀行	2,900	2,370.00	6,873,000
南都銀行	2,400	2,092.00	5,020,800
百五銀行	12,800	318.00	4,070,400
京都銀行	5,100	3,870.00	19,737,000
紀陽銀行	5,100	1,612.00	8,221,200
ほくほくフィナンシャルグループ	9,500	888.00	8,436,000
広島銀行	21,100	502.00	10,592,200
山陰合同銀行	8,400	518.00	4,351,200
中国銀行	12,300	953.00	11,721,900
鳥取銀行	500	1,264.00	632,000
伊予銀行	20,400	626.00	12,770,400
百十四銀行	1,500	1,923.00	2,884,500
四国銀行	2,200	808.00	1,777,600
阿波銀行	2,300	2,562.00	5,892,600
大分銀行	800	2,280.00	1,824,000
宮崎銀行	1,000	2,301.00	2,301,000
佐賀銀行	900	1,157.00	1,041,300
沖縄銀行	1,300	3,095.00	4,023,500
琉球銀行	3,300	930.00	3,069,000

セブン銀行	47,800	292.00	13,957,600
みずほフィナンシャルグループ	1,943,300	133.70	259,819,210
高知銀行	500	681.00	340,500
山口フィナンシャルグループ	17,800	648.00	11,534,400
長野銀行	500	1,101.00	550,500
名古屋銀行	1,100	2,397.00	2,636,700
北洋銀行	21,500	212.00	4,558,000
愛知銀行	500	2,878.00	1,439,000
中京銀行	600	2,139.00	1,283,400
大光銀行	500	1,441.00	720,500
愛媛銀行	2,000	1,137.00	2,274,000
トマト銀行	600	1,027.00	616,200
京葉銀行	6,100	495.00	3,019,500
栃木銀行	7,000	165.00	1,155,000
北日本銀行	500	1,922.00	961,000
東和銀行	2,600	694.00	1,804,400
福島銀行	1,400	179.00	250,600
大東銀行	800	605.00	484,000
トモニホールディングス	11,000	340.00	3,740,000
フィデアホールディングス	14,200	106.00	1,505,200
池田泉州ホールディングス	16,400	165.00	2,706,000
F P G	4,400	625.00	2,750,000
マーキュリアインベストメント	700	565.00	395,500
S B Iホールディングス	16,000	2,146.00	34,336,000
ジャフコ	2,200	3,425.00	7,535,000
大和証券グループ本社	114,700	447.60	51,339,720
野村ホールディングス	251,700	463.40	116,637,780
岡三証券グループ	12,200	331.00	4,038,200
丸三証券	4,300	434.00	1,866,200
東洋証券	5,500	125.00	687,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,400	238.00	3,903,200
光世証券	400	519.00	207,600
水戸証券	4,200	196.00	823,200
いちよし証券	2,700	440.00	1,188,000
松井証券	8,200	821.00	6,732,200
だいこう証券ビジネス	700	916.00	641,200
マネックスグループ	10,500	217.00	2,278,500
極東証券	1,900	525.00	997,500
岩井コスモホールディングス	1,400	1,002.00	1,402,800
藍澤証券	2,600	695.00	1,807,000
マネーパートナーズグループ	1,600	193.00	308,800
スパークス・グループ	6,800	204.00	1,387,200

かんぽ生命保険	5,000	1,365.00	6,825,000
S O M P Oホールディングス	26,900	3,601.00	96,866,900
アニコム ホールディングス	1,200	4,675.00	5,610,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	37,400	3,117.00	116,575,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,700	2,592.00	30,326,400
第一生命ホールディングス	80,900	1,342.00	108,567,800
東京海上ホールディングス	50,600	4,726.00	239,135,600
T & Dホールディングス	42,700	949.00	40,522,300
アドバンスクリエイト	300	2,090.00	627,000
全国保証	4,000	3,940.00	15,760,000
ジェイリース	400	344.00	137,600
イントラスト	500	705.00	352,500
日本モーゲージサービス	300	1,861.00	558,300
C a s a	500	1,083.00	541,500
アルヒ	2,300	1,432.00	3,293,600
プレミアグループ	800	1,747.00	1,397,600
クレディセゾン	10,000	1,295.00	12,950,000
芙蓉総合リース	1,500	5,710.00	8,565,000
みずほリース	2,200	2,314.00	5,090,800
東京センチュリー	2,900	5,480.00	15,892,000
日本証券金融	6,300	492.00	3,099,600
アイフル	21,700	236.00	5,121,200
リコーリース	1,100	2,927.00	3,219,700
イオンフィナンシャルサービス	8,700	1,228.00	10,683,600
アコム	28,700	419.00	12,025,300
ジャックス	1,600	1,762.00	2,819,200
オリエントコーポレーション	38,500	123.00	4,735,500
日立キャピタル	3,400	2,250.00	7,650,000
アプラスフィナンシャル	6,900	67.00	462,300
オリックス	89,400	1,373.00	122,746,200
三菱UFJリース	36,300	499.00	18,113,700
九州リースサービス	700	484.00	338,800
日本取引所グループ	41,100	2,336.00	96,009,600
イー・ギャランティ	1,500	2,030.00	3,045,000
アサックス	800	648.00	518,400
N E Cキャピタルソリューション	600	1,966.00	1,179,600
いちご	18,200	274.00	4,986,800
日本駐車場開発	14,400	134.00	1,929,600
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,322.00	925,400
A Dワークスグループ	2,800	169.00	473,200
ヒューリック	30,500	1,018.00	31,049,000
三栄建築設計	600	1,198.00	718,800

野村不動産ホールディングス	8,700	1,946.00	16,930,200
三重交通グループホールディングス	3,000	463.00	1,389,000
サムティ	2,000	1,290.00	2,580,000
ディア・ライフ	2,000	465.00	930,000
コーセーアールイー	400	495.00	198,000
日本商業開発	900	1,448.00	1,303,200
プレサンスコーポレーション	2,400	1,120.00	2,688,000
THEグローバル社	800	213.00	170,400
ハウスコム	300	1,323.00	396,900
日本管理センター	1,000	1,183.00	1,183,000
サンセイランディック	500	825.00	412,500
エストラスト	200	621.00	124,200
フージャースホールディングス	2,900	518.00	1,502,200
オープンハウス	4,200	3,365.00	14,133,000
東急不動産ホールディングス	38,900	521.00	20,266,900
飯田グループホールディングス	11,900	1,643.00	19,551,700
イーランド	300	673.00	201,900
ムゲンエステート	1,000	520.00	520,000
ビーロッド	700	664.00	464,800
ファーストブラザーズ	300	683.00	204,900
ハウストゥ	800	992.00	793,600
シーアールイー	400	1,228.00	491,200
プロパティエージェント	200	981.00	196,200
ケイアイスター不動産	500	1,636.00	818,000
アグレ都市デザイン	300	451.00	135,300
グッドコムアセット	400	1,714.00	685,600
ジェイ・エス・ビー	300	2,397.00	719,100
テンポイノベーション	300	641.00	192,300
グローバル・リンク・マネジメント	300	606.00	181,800
パーク24	7,700	1,984.00	15,276,800
パラカ	400	1,640.00	656,000
三井不動産	70,500	2,044.50	144,137,250
三菱地所	100,200	1,648.00	165,129,600
平和不動産	2,600	2,967.00	7,714,200
東京建物	15,100	1,263.00	19,071,300
ダイビル	3,700	968.00	3,581,600
京阪神ビルディング	2,300	1,352.00	3,109,600
住友不動産	32,200	2,849.50	91,753,900
テーオーシー	2,900	672.00	1,948,800
東京楽天地	200	4,485.00	897,000
レオパレス21	18,700	230.00	4,301,000
スターツコーポレーション	1,900	2,115.00	4,018,500

フジ住宅	1,700	511.00	868,700
空港施設	1,500	405.00	607,500
明和地所	800	401.00	320,800
ゴールドクレスト	1,200	1,462.00	1,754,400
エスリード	600	1,345.00	807,000
日神グループホールディングス	2,200	369.00	811,800
日本エスコン	2,600	780.00	2,028,000
タカラレーベン	6,500	332.00	2,158,000
A V A N T I A	900	717.00	645,300
イオンモール	7,200	1,423.00	10,245,600
毎日コムネット	400	770.00	308,000
ファースト住建	700	913.00	639,100
カチタス	3,500	2,629.00	9,201,500
トーセイ	2,000	1,068.00	2,136,000
サンフロンティア不動産	2,000	850.00	1,700,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	819.00	1,064,700
インテリックス	400	481.00	192,400
ランドビジネス	600	375.00	225,000
グランディハウス	1,200	378.00	453,600
日本空港ビルデング	4,600	4,680.00	21,528,000
日本工営	900	2,914.00	2,622,600
L I F U L L	4,900	401.00	1,964,900
ジェイエシーリクルートメント	900	1,136.00	1,022,400
日本M&Aセンター	10,500	4,635.00	48,667,500
メンバーズ	400	1,465.00	586,000
中広	200	546.00	109,200
UTグループ	2,200	2,177.00	4,789,400
アイティメディア	600	1,423.00	853,800
タケエイ	1,300	905.00	1,176,500
E・Jホールディングス	300	1,430.00	429,000
ビーネックスグループ	1,800	840.00	1,512,000
コシダカホールディングス	3,400	441.00	1,499,400
アルトナー	300	876.00	262,800
パソナグループ	1,500	1,120.00	1,680,000
C D S	300	1,242.00	372,600
リンクアンドモチベーション	3,100	404.00	1,252,400
G C A	1,700	632.00	1,074,400
エス・エム・エス	4,300	2,458.00	10,569,400
サニーサイドアップグループ	500	772.00	386,000
パーソルホールディングス	13,800	1,360.00	18,768,000
リニカル	700	861.00	602,700
クックパッド	4,900	293.00	1,435,700

エスクリ	500	393.00	196,500
アイ・ケイ・ケイ	700	570.00	399,000
学情	500	1,183.00	591,500
スタジオアリス	700	1,615.00	1,130,500
シミックホールディングス	700	1,450.00	1,015,000
エプロ	300	1,048.00	314,400
N J S	300	1,779.00	533,700
総合警備保障	5,500	5,080.00	27,940,000
カカクコム	10,200	2,604.00	26,560,800
アイロムグループ	500	3,125.00	1,562,500
セントケア・ホールディング	900	401.00	360,900
サイネックス	300	662.00	198,600
ルネサンス	800	1,043.00	834,400
ディップ	1,900	2,161.00	4,105,900
オプトホールディング	700	1,406.00	984,200
新日本科学	1,500	664.00	996,000
ツクイ	3,300	512.00	1,689,600
キャリアデザインセンター	300	950.00	285,000
ベネフィット・ワン	5,000	2,020.00	10,100,000
エムスリー	30,600	4,330.00	132,498,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	325.00	292,500
プラス	200	464.00	92,800
アウトソーシング	7,900	631.00	4,984,900
ウェルネット	1,400	702.00	982,800
ワールドホールディングス	500	1,673.00	836,500
ディー・エヌ・エー	6,800	1,424.00	9,683,200
博報堂D Yホールディングス	19,300	1,209.00	23,333,700
ぐるなび	2,400	690.00	1,656,000
タカミヤ	1,500	472.00	708,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	823.00	905,300
ファンコミュニケーションズ	3,900	440.00	1,716,000
ライク	500	1,532.00	766,000
ビジネス・ブレークスルー	600	356.00	213,600
エスプール	3,500	717.00	2,509,500
W D Bホールディングス	600	2,631.00	1,578,600
手間いらず	100	4,675.00	467,500
ティア	800	497.00	397,600
C D G	100	1,537.00	153,700
バリューコマース	800	2,735.00	2,188,000
インフォマート	15,200	853.00	12,965,600
J Pホールディングス	4,300	272.00	1,169,600
エコナックホールディングス	2,400	97.00	232,800

E P Sホールディングス	1,900	1,032.00	1,960,800
レッグス	400	906.00	362,400
プレステージ・インターナショナル	5,200	795.00	4,134,000
アミューズ	800	2,175.00	1,740,000
ドリームインキュベータ	400	1,294.00	517,600
クイック	900	1,111.00	999,900
T A C	900	187.00	168,300
ケネディクス	12,900	525.00	6,772,500
電通グループ	14,300	2,674.00	38,238,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	655.00	327,500
ぴあ	400	3,400.00	1,360,000
イオンファンタジー	500	1,671.00	835,500
シーティーエス	1,600	845.00	1,352,000
ネクシィーズグループ	400	988.00	395,200
みらかホールディングス	3,900	2,544.00	9,921,600
アルプス技研	1,200	1,802.00	2,162,400
ダイオーズ	300	1,063.00	318,900
日本空調サービス	1,400	703.00	984,200
オリエンタルランド	14,700	15,030.00	220,941,000
ダスキン	3,400	2,694.00	9,159,600
明光ネットワークジャパン	1,800	837.00	1,506,600
ファルコホールディングス	800	1,540.00	1,232,000
秀英予備校	300	418.00	125,400
田谷	300	535.00	160,500
ラウンドワン	3,900	798.00	3,112,200
リゾートトラスト	6,300	1,380.00	8,694,000
ビー・エム・エル	1,800	2,973.00	5,351,400
ワタベウェディング	300	375.00	112,500
りらいあコミュニケーションズ	2,500	991.00	2,477,500
リソー教育	6,400	308.00	1,971,200
早稲田アカデミー	600	924.00	554,400
ユー・エス・エス	15,500	1,821.00	28,225,500
東京個別指導学院	500	567.00	283,500
サイバーエージェント	8,500	4,990.00	42,415,000
楽天	64,600	923.00	59,625,800
クリーク・アンド・リバー社	800	1,021.00	816,800
テー・オー・ダブリュー	2,200	375.00	825,000
山田コンサルティンググループ	900	1,285.00	1,156,500
セントラルスポーツ	500	2,382.00	1,191,000
フルキャストホールディングス	1,400	1,447.00	2,025,800
エン・ジャパン	2,500	2,737.00	6,842,500
リソルホールディングス	200	3,380.00	676,000



テクノプロ・ホールディングス	2,800	5,990.00	16,772,000
アトラ	400	241.00	96,400
インターワークス	300	368.00	110,400
アイ・アールジャパンホールディングス	600	9,670.00	5,802,000
K e e P e r 技研	500	1,591.00	795,500
ファーストロジック	300	565.00	169,500
三機サービス	300	951.00	285,300
G u n o s y	900	914.00	822,600
デザインワン・ジャパン	500	249.00	124,500
イー・ガーディアン	600	2,430.00	1,458,000
リブセンス	900	274.00	246,600
ジャパンマテリアル	4,200	1,575.00	6,615,000
ベクトル	1,800	846.00	1,522,800
ウチヤマホールディングス	700	333.00	233,100
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	788.00	945,600
ライクキッズ	300	1,003.00	300,900
キャリアリンク	400	533.00	213,200
I B J	900	732.00	658,800
アサンテ	600	1,436.00	861,600
N・フィールド	900	529.00	476,100
バリューHR	500	1,385.00	692,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	3,820.00	4,202,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,997.00	998,500
E R Iホールディングス	400	645.00	258,000
アビスト	200	2,553.00	510,600
シグマクシス	1,000	1,672.00	1,672,000
ウィルグループ	900	632.00	568,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,000	198.00	396,000
リクルートホールディングス	99,300	3,538.00	351,323,400
エラン	800	1,782.00	1,425,600
土木管理総合試験所	600	360.00	216,000
ネットマーケティング	500	606.00	303,000
日本郵政	113,600	776.00	88,153,600
ベルシステム24ホールディングス	2,300	1,340.00	3,082,000
鎌倉新書	1,100	1,116.00	1,227,600
S M N	300	985.00	295,500
一蔵	200	380.00	76,000
L I T A L I C O	500	2,364.00	1,182,000
グローバルキッズCOMPANY	300	551.00	165,300
エアトリ	700	1,114.00	779,800
アトラエ	400	3,165.00	1,266,000
ストライク	500	4,650.00	2,325,000

ソラスト	3,800	1,128.00	4,286,400
セラク	400	915.00	366,000
インソース	600	2,713.00	1,627,800
ベikalレント・コンサルティング	800	9,030.00	7,224,000
Orchestra Holdings	300	1,285.00	385,500
アイモバイル	500	664.00	332,000
キャリアインデックス	600	313.00	187,800
MS - Japan	500	761.00	380,500
船場	200	970.00	194,000
グレイステクノロジー	600	4,780.00	2,868,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	3,095.00	4,333,000
フルテック	200	1,247.00	249,400
グリーンズ	400	487.00	194,800
ツナググループ・ホールディングス	300	416.00	124,800
GameWith	400	580.00	232,000
ソウルドアウト	300	2,283.00	684,900
MS&Consulting	300	534.00	160,200
ミダック	200	1,550.00	310,000
日総工産	1,000	639.00	639,000
キュービーネットホールディングス	600	2,076.00	1,245,600
RPAホールディングス	1,000	740.00	740,000
スプリックス	400	770.00	308,000
マネジメントソリューションズ	600	1,091.00	654,600
プロレド・パートナーズ	200	4,400.00	880,000
and factory	100	985.00	98,500
ギークス	100	1,171.00	117,100
カーブスホールディングス	3,800	601.00	2,283,800
フォーラムエンジニアリング	700	865.00	605,500
アドバンテッジリスクマネジメント	700	804.00	562,800
リログループ	7,600	2,125.00	16,150,000
東祥	900	1,282.00	1,153,800
エイチ・アイ・エス	2,100	1,768.00	3,712,800
ラックランド	300	2,145.00	643,500
共立メンテナンス	2,300	3,520.00	8,096,000
イチネンホールディングス	1,600	1,186.00	1,897,600
建設技術研究所	1,000	1,645.00	1,645,000
スペース	900	983.00	884,700
長大	600	1,028.00	616,800
燦ホールディングス	600	1,180.00	708,000
スバル興業	100	7,350.00	735,000
東京テアトル	600	1,225.00	735,000
タナベ経営	300	1,271.00	381,300

ナガワ	400	7,260.00	2,904,000	
よみうりランド	300	3,615.00	1,084,500	
東京都競馬	900	3,525.00	3,172,500	
常磐興産	500	1,454.00	727,000	
カナモト	2,300	2,245.00	5,163,500	
東京ドーム	5,600	784.00	4,390,400	
西尾レントオール	1,300	2,158.00	2,805,400	
トランス・コスモス	1,300	2,200.00	2,860,000	
乃村工藝社	5,900	909.00	5,363,100	
藤田観光	600	1,754.00	1,052,400	
KNT-CTホールディングス	900	1,022.00	919,800	
日本管財	1,500	1,869.00	2,803,500	
トーカイ	1,300	2,556.00	3,322,800	
白洋舎	200	2,906.00	581,200	
セコム	14,700	9,326.00	137,092,200	
セントラル警備保障	700	4,180.00	2,926,000	
丹青社	2,600	765.00	1,989,000	
メイテック	1,700	5,150.00	8,755,000	
応用地質	1,500	1,336.00	2,004,000	
船井総研ホールディングス	2,900	2,346.00	6,803,400	
進学会ホールディングス	500	499.00	249,500	
オオバ	1,000	604.00	604,000	
いであ	300	1,745.00	523,500	
学究社	400	1,100.00	440,000	
ベネッセホールディングス	4,600	2,774.00	12,760,400	
イオンディライト	1,700	3,140.00	5,338,000	
ナック	800	857.00	685,600	
ニチイ学館	2,000	1,600.00	3,200,000	
ダイセキ	2,300	2,594.00	5,966,200	
ステップ	500	1,423.00	711,500	
合 計	17,023,440		31,167,364,370	

## (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）

	2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	166,523,489	753,488,934
コール・ローン	3,145,255,097	934,256,262
株式	210,467,110,343	221,493,732,724
投資証券	5,815,239,695	5,943,134,870
派生商品評価勘定	79,198,902	216,638,290
未収入金	440,681	1,668,501
未収配当金	259,500,406	281,728,041
その他未収収益	-	38,477
差入委託証拠金	413,076,384	977,852,570
流動資産合計	220,346,344,997	230,602,538,669
<b>資産合計</b>		
220,346,344,997		
230,602,538,669		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	257,183	710,720
未払金	-	779,500
未払解約金	43,733,713	59,029,578
未払利息	3,646	383
流動負債合計	43,994,542	60,520,181
<b>負債合計</b>		
43,994,542		
60,520,181		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	79,674,652,979	90,076,685,860
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	140,627,697,476	140,465,332,628
元本等合計	220,302,350,455	230,542,018,488
<b>純資産合計</b>		
220,302,350,455		
230,542,018,488		
<b>負債純資産合計</b>		
220,346,344,997		
230,602,538,669		

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年12月16日現在	2020年 6月15日現在
1.	期首	2019年 6月18日	2019年12月17日
	期首元本額	50,023,894,747円	79,674,652,979円
	期首からの追加設定元本額	31,663,114,820円	21,859,759,588円
	期首からの一部解約元本額	2,012,356,588円	11,457,726,707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）	18,640,569,871円	20,639,023,932円
	DCインデックスバランス（株式20）	109,992,860円	128,229,444円
	DCインデックスバランス（株式40）	288,224,996円	321,710,681円
	DCインデックスバランス（株式60）	559,244,998円	617,668,439円
	DCインデックスバランス（株式80）	579,155,862円	626,202,499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	2,024,843,992円	1,845,422,371円
	日興五大陸株式ファンド	4,919,411,603円	4,682,532,756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）	71,920,825円	65,700,296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）	141,714,299円	145,287,200円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	6,921,196,311円	6,691,801,519円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	36,975,565,997円	45,917,133,859円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,901,851円	4,841,692円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,020,522円	4,119,797円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,013,161円	5,650,684円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	5,617,117円	5,621,598円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,856,501,168円	3,724,377,685円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	27,269,522円	27,909,475円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	77,445,621円	75,736,874円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	111,907,219円	113,294,962円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	110,203,312円	107,681,596円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,238,931,872円	4,326,738,501円
計	79,674,652,979円	90,076,685,860円
2. 受益権の総数	79,674,652,979口	90,076,685,860口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 6月18日 至 2019年12月16日	自 2019年12月17日 至 2020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

	2019年12月16日現在	2020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	(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

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

（有価証券に関する注記）

（2019年12月16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	7,980,366,329
投資証券	262,710,251
合計	7,717,656,078

（2020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	5,108,016,604
投資証券	892,773,237
合計	6,000,789,841

（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）

（2019年12月16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	4,880,243,533	-	4,933,804,832	53,561,299
合計		4,880,243,533	-	4,933,804,832	53,561,299

(2020年 6月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,766,667,420	-	2,970,011,100	203,343,680
合計		2,766,667,420	-	2,970,011,100	203,343,680

## (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)

(2019年12月16日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,305,586,080	-	4,330,966,500	25,380,420
	米ドル	3,495,233,180	-	3,515,387,000	20,153,820
	ユーロ	810,352,900	-	815,579,500	5,226,600
合計		4,305,586,080	-	4,330,966,500	25,380,420

(2020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	1,041,758,390	-	1,054,343,000	12,584,610
	米ドル	727,011,390	-	728,456,000	1,444,610
	ユーロ	314,747,000	-	325,887,000	11,140,000
	売建	8,246,880	-	8,247,600	720
	ニュージーランドドル	8,246,880	-	8,247,600	720
合計		1,050,005,270	-	1,062,590,600	12,583,890

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2019年12月16日現在		2020年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.7650円	1口当たり純資産額	2.5594円
(1万口当たり純資産額)	(27,650円)	(1万口当たり純資産額)	(25,594円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES CO	40,745	15.94	649,475.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,070	20.07	463,014.90	
	CHENIERE ENERGY INC	12,390	46.10	571,179.00	
	CHEVRON CORP	105,451	92.39	9,742,617.89	
	CONCHO RESOURCES INC	11,125	58.00	645,250.00	
	CONOCOPHILLIPS	58,300	43.73	2,549,459.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,470	46.96	444,711.20	
	EOG RESOURCES INC	34,112	52.57	1,793,267.84	
	EXXON MOBIL CORP	237,531	47.17	11,204,337.27	
	HALLIBURTON CO	47,837	12.78	611,356.86	
	HESS CORP	16,170	49.61	802,193.70	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,740	31.38	242,881.20	
	KINDER MORGAN INC	108,650	15.50	1,684,075.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	34,972	36.62	1,280,674.64	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,851	12.77	291,807.27	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,231	18.50	947,773.50	
	ONEOK INC	22,780	34.09	776,570.20	
	PHILLIPS 66	25,755	77.26	1,989,831.30	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,660	98.23	948,901.80	
	SCHLUMBERGER LTD	81,251	19.00	1,543,769.00	
	VALERO ENERGY CORP	22,292	63.79	1,422,006.68	
	WILLIAMS COS INC	68,944	18.23	1,256,849.12	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,315	235.04	2,894,517.60	
	ALBEMARLE CORP	5,730	77.32	443,043.60	
	AMCOR PLC	86,480	9.81	848,368.80	
	AVERY DENNISON CORP	4,640	113.50	526,640.00	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,010	22.19	222,121.90	
	BALL CORP	17,440	68.33	1,191,675.20	
	CELANESE CORP	7,140	88.52	632,032.80	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,140	29.40	356,916.00	
CORTEVA INC	42,482	27.54	1,169,954.28		
CROWN HOLDINGS INC	8,775	65.23	572,393.25		
DOW INC	41,195	41.23	1,698,469.85		

DUPONT DE NEMOURS INC	42,872	51.01	2,186,900.72
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,115	69.63	565,047.45
ECOLAB INC	14,410	204.06	2,940,504.60
FMC CORP	6,990	97.34	680,406.60
FREEPORT-MCMORAN INC	83,608	10.49	877,047.92
INTERNATIONAL PAPER CO	20,830	34.92	727,383.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,415	126.85	686,892.75
LINDE PLC	29,900	201.94	6,038,006.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	15,260	66.61	1,016,468.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,465	197.05	682,778.25
MOSAIC CO/THE	23,430	13.28	311,150.40
NEWMONT CORP	46,892	55.45	2,600,161.40
NUCOR CORP	17,449	41.20	718,898.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,220	98.92	516,362.40
PPG INDUSTRIES INC	12,704	101.63	1,291,107.52
RPM INTERNATIONAL INC	8,430	73.39	618,677.70
SEALED AIR CORP	7,116	30.58	217,607.28
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,687	547.62	2,566,694.94
STEEL DYNAMICS INC	12,240	26.42	323,380.80
VULCAN MATERIALS CO	7,563	112.09	847,736.67
WESTROCK CO	13,449	28.21	379,396.29
3M CO	32,236	154.87	4,992,389.32
AERCAP HOLDINGS NV	6,440	34.25	220,570.00
ALLEGION PLC	5,950	102.41	609,339.50
AMETEK INC	12,693	87.66	1,112,668.38
BOEING CO/THE	29,952	189.51	5,676,203.52
CARRIER GLOBAL CORP	47,448	21.54	1,022,029.92
CATERPILLAR INC	30,756	123.15	3,787,601.40
CUMMINS INC	8,245	167.08	1,377,574.60
DEERE & CO	16,450	154.97	2,549,256.50
DOVER CORP	8,100	96.61	782,541.00
EATON CORP PLC	22,896	86.01	1,969,284.96
EMERSON ELECTRIC CO	33,620	61.35	2,062,587.00
FASTENAL CO	31,926	40.06	1,278,955.56
FORTIVE CORP	16,594	63.65	1,056,208.10

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,000	58.40	408,800.00
GENERAL DYNAMICS CORP	14,502	149.20	2,163,698.40
GENERAL ELECTRIC CO	488,293	7.25	3,540,124.25
HD SUPPLY HOLDINGS INC	8,950	34.29	306,895.50
HEICO CORP	2,000	109.49	218,980.00
HEICO CORP-CLASS A	4,130	91.32	377,151.60
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,926	144.51	5,769,706.26
HOWMET AEROSPACE INC	20,893	14.00	292,502.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,230	182.29	406,506.70
IDEX CORP	3,890	152.59	593,575.10
ILLINOIS TOOL WORKS	17,805	164.94	2,936,756.70
INGERSOLL-RAND INC	22,598	31.22	705,509.56
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,080	80.49	650,359.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,370	43.96	499,825.20
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	13,200	22.21	293,172.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	45,104	34.45	1,553,832.80
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,155	193.15	2,347,738.25
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,220	218.99	486,157.80
LOCKHEED MARTIN CORP	14,216	381.87	5,428,663.92
MASCO CORP	15,489	45.79	709,241.31
NORDSON CORP	3,030	185.68	562,610.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,894	317.68	2,825,445.92
OTIS WORLDWIDE CORP	23,724	56.04	1,329,492.96
OWENS CORNING	6,290	52.72	331,608.80
PACCAR INC	18,394	73.17	1,345,888.98
PARKER HANNIFIN CORP	7,450	180.16	1,342,192.00
PENTAIR PLC	8,438	37.50	316,425.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	84,106	65.37	5,498,009.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,273	208.19	1,305,975.87
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,230	389.81	2,428,516.30
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,000	37.06	370,600.00
SMITH (A.O.) CORP	7,970	46.95	374,191.50
SNAP-ON INC	3,080	135.01	415,830.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,466	131.09	1,240,897.94
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,320	333.54	773,812.80

TEXTRON INC	11,916	34.15	406,931.40
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,636	90.39	1,142,168.04
TRANSDIGM GROUP INC	2,890	447.39	1,292,957.10
UNITED RENTALS INC	4,690	143.49	672,968.10
WABTEC CORP	10,600	60.89	645,434.00
WW GRAINGER INC	2,777	303.75	843,513.75
XYLEM INC	10,568	64.16	678,042.88
CINTAS CORP	5,007	266.20	1,332,863.40
COPART INC	11,450	85.04	973,708.00
COSTAR GROUP INC	2,245	668.09	1,499,862.05
EQUIFAX INC	7,074	167.98	1,188,290.52
IHS MARKIT LTD	20,423	69.81	1,425,729.63
NIELSEN HOLDINGS PLC	20,905	15.12	316,083.60
REPUBLIC SERVICES INC	12,330	81.73	1,007,730.90
ROBERT HALF INTL INC	7,365	51.29	377,750.85
ROLLINS INC	8,030	41.41	332,522.30
TRANSUNION	11,060	87.91	972,284.60
VERISK ANALYTICS INC	8,390	162.67	1,364,801.30
WASTE CONNECTIONS INC	14,246	90.21	1,285,131.66
WASTE MANAGEMENT INC	24,634	103.89	2,559,226.26
AMERCO	635	314.89	199,955.15
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,210	77.73	560,433.30
CSX CORP	43,703	69.57	3,040,417.71
DELTA AIR LINES INC	8,455	30.43	257,285.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,017	73.57	736,950.69
FEDEX CORP	14,648	132.72	1,944,082.56
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,500	114.10	513,450.00
KANSAS CITY SOUTHERN	5,040	147.27	742,240.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,140	38.97	278,245.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	14,180	178.18	2,526,592.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,655	157.88	892,811.40
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,120	35.87	291,264.40
UBER TECHNOLOGIES INC	53,230	32.24	1,716,135.20
UNION PACIFIC CORP	38,696	166.18	6,430,501.28
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	39,267	101.48	3,984,815.16

XPO LOGISTICS INC	4,830	74.84	361,477.20
APTIV PLC	14,350	75.66	1,085,721.00
AUTOLIV INC	4,250	63.14	268,345.00
BORGWARNER INC	9,890	33.55	331,809.50
FORD MOTOR COMPANY	236,795	6.46	1,529,695.70
GENERAL MOTORS CORP	69,685	27.96	1,948,392.60
LEAR CORP	2,710	110.29	298,885.90
TESLA INC	8,265	935.28	7,730,089.20
DR HORTON INC	19,466	54.00	1,051,164.00
GARMIN LTD	7,065	91.67	647,648.55
HASBRO INC	6,698	74.30	497,661.40
LENNAR CORP-CL A	14,960	59.25	886,380.00
LULULEMON ATHLETICA INC	6,660	296.36	1,973,757.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,268	97.74	319,414.32
NEWELL BRANDS INC	27,246	15.30	416,863.80
NIKE INC -CL B	69,648	96.43	6,716,156.64
NVR INC	220	3,175.37	698,581.40
PULTE GROUP INC	15,390	33.89	521,567.10
RALPH LAUREN CORP	2,895	74.77	216,459.15
VF CORP	17,460	61.25	1,069,425.00
WHIRLPOOL CORP	4,264	122.10	520,634.40
ARAMARK	10,720	25.30	271,216.00
CARNIVAL CORP	23,087	19.98	461,278.26
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,435	991.83	1,423,276.05
DARDEN RESTAURANTS INC	6,553	75.94	497,634.82
DOMINO'S PIZZA INC	2,090	378.15	790,333.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,620	77.45	1,209,769.00
LAS VEGAS SANDS CORP	20,770	49.87	1,035,799.90
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	16,493	92.26	1,521,644.18
MCDONALD'S CORP	41,811	189.17	7,909,386.87
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	13,580	17.80	241,724.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,920	19.17	554,396.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,358	61.18	694,882.44
STARBUCKS CORP	65,734	76.38	5,020,762.92
VAIL RESORTS INC	2,220	184.20	408,924.00

WYNN RESORTS LTD	5,560	92.30	513,215.80
YUM! BRANDS INC	17,054	91.28	1,556,689.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	42,940	71.68	3,077,939.20
ALPHABET INC-CL A	16,850	1,412.92	23,807,702.00
ALPHABET INC-CL C	17,272	1,413.18	24,408,444.96
ALTICE USA INC- A	16,770	24.06	403,486.20
CABLE ONE INC	250	1,725.68	431,420.00
CHARTER COMMUNICATION-A	8,231	522.57	4,301,273.67
COMCAST CORP-CLASS A	254,974	39.46	10,061,274.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,520	22.07	210,106.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,870	19.70	411,139.00
DISH NETWORK CORP-A	12,729	32.70	416,238.30
ELECTRONIC ARTS INC	16,124	121.97	1,966,644.28
FACEBOOK INC-CLASS A	135,280	228.58	30,922,302.40
FOX CORP - CLASS A	17,524	28.29	495,753.96
FOX CORP- CLASS B	11,786	27.95	329,418.70
IAC/INTERACTIVECORP	4,350	274.30	1,193,205.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	23,496	17.28	406,010.88
LIBERTY BROADBAND-A	1,280	127.33	162,982.40
LIBERTY BROADBAND-C	6,500	128.48	835,120.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	5,555	35.79	198,813.45
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	8,020	35.36	283,587.20
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C(N)	1,276	35.36	45,119.36
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,160	36.29	368,706.40
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,820	49.12	384,118.40
MATCH GROUP INC	3,070	87.25	267,857.50
NETFLIX INC	24,630	418.07	10,297,064.10
NEWS CORP - CLASS A	18,680	11.72	218,929.60
OMNICOM GROUP	11,727	55.03	645,336.81
PINTEREST INC- CLASS A	18,920	20.89	395,238.80
ROKU INC	5,670	108.07	612,756.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	5.93	280,369.40
SNAP INC - A	47,130	20.18	951,083.40
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,440	134.00	862,960.00
THE WALT DISNEY CO.	101,352	115.49	11,705,142.48

TWITTER INC	44,060	33.40	1,471,604.00
VIACOMCBS INC - CLASS B	31,833	22.90	728,975.70
ZILLOW GROUP INC - C	6,770	56.79	384,468.30
ADVANCE AUTO PARTS INC	4,408	135.73	598,297.84
AMAZON.COM INC	23,785	2,545.02	60,533,300.70
AUTOZONE INC	1,307	1,100.51	1,438,366.57
BEST BUY CO INC	12,554	77.76	976,199.04
BOOKING HOLDINGS INC	2,298	1,623.92	3,731,768.16
BURLINGTON STORES INC	3,830	203.53	779,519.90
CARMAX INC	9,609	89.98	864,617.82
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	14,180	184.00	2,609,120.00
DOLLAR TREE INC	13,176	87.77	1,156,457.52
EBAY INC	45,437	47.66	2,165,527.42
EXPEDIA INC	7,412	82.52	611,638.24
GENUINE PARTS CO	7,831	85.59	670,255.29
HOME DEPOT INC	61,260	242.45	14,852,487.00
LKQ CORP	16,840	25.88	435,903.40
LOWE'S COS INC	42,942	126.05	5,412,839.10
MERCADOLIBRE INC	2,490	896.43	2,232,110.70
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,115	410.35	1,688,590.25
ROSS STORES INC	20,022	92.48	1,851,634.56
TARGET CORP	28,390	116.90	3,318,791.00
TIFFANY & CO	5,820	119.12	693,278.40
TJX COMPANIES INC	67,256	52.46	3,528,249.76
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,990	118.45	709,515.50
ULTA BEAUTY INC	3,150	226.63	713,884.50
WAYFAIR INC- CLASS A	3,350	184.76	618,946.00
COSTCO WHOLESALE CORP	24,829	298.70	7,416,422.30
KROGER CO	45,030	32.26	1,452,667.80
SYSCO CORP	27,926	54.26	1,515,264.76
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	42,062	41.40	1,741,366.80
WALMART INC	79,942	117.74	9,412,371.08
ALTRIA GROUP INC	103,968	39.13	4,068,267.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,963	39.43	1,142,011.09
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,420	65.25	1,201,905.00



BUNGE LTD	9,207	39.39	362,663.73
CAMPBELL SOUP CO	8,995	47.07	423,394.65
COCA-COLA CO/THE	228,742	45.60	10,430,635.20
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,620	38.15	405,153.00
CONAGRA BRANDS INC	27,710	32.41	898,081.10
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,030	170.28	1,707,908.40
GENERAL MILLS INC	33,139	60.15	1,993,310.85
HERSHEY CO/THE	8,325	129.11	1,074,840.75
HORMEL FOODS CORP	17,870	46.67	833,992.90
INGREDION INC	3,120	82.19	256,432.80
JM SMUCKER CO/THE	6,390	104.70	669,033.00
KELLOGG CO	14,738	63.59	937,189.42
KEURIG DR PEPPER INC	19,450	28.12	546,934.00
KRAFT HEINZ CO/THE	36,031	31.80	1,145,785.80
LAMB WESTON HOLDING INC	8,960	64.97	582,131.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,155	166.54	1,191,593.70
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,590	38.05	440,999.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	80,175	50.73	4,067,277.75
MONSTER BEVERAGE CORP	22,840	68.30	1,559,972.00
PEPSICO INC	77,981	129.00	10,059,549.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	87,208	70.42	6,141,187.36
TYSON FOODS INC-CL A	17,926	62.20	1,114,997.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,000	73.08	1,023,120.00
CLOROX COMPANY	7,296	205.12	1,496,555.52
COLGATE-PALMOLIVE CO	45,390	72.79	3,303,938.10
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,820	191.38	2,453,491.60
KIMBERLY-CLARK CORP	18,813	135.94	2,557,439.22
PROCTER & GAMBLE CO	138,739	115.62	16,041,003.18
ABBOTT LABORATORIES	98,946	89.02	8,808,172.92
ABIOMED INC	2,390	241.68	577,615.20
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,600	251.40	1,156,440.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,954	94.87	849,465.98
ANTHEM INC	14,121	265.74	3,752,514.54
BAXTER INTERNATIONAL INC	27,519	83.97	2,310,770.43
BECTON DICKINSON AND CO	15,147	230.88	3,497,139.36

BOSTON SCIENTIFIC CORP	77,458	35.35	2,738,140.30
CARDINAL HEALTH INC	17,575	52.89	929,541.75
CENTENE CORP	33,927	61.94	2,101,438.38
CERNER CORP	16,450	66.96	1,101,492.00
CIGNA CORP	20,840	190.02	3,960,016.80
COOPER COS INC/THE	2,840	288.40	819,056.00
CVS HEALTH CORP	72,938	64.15	4,678,972.70
DANAHER CORP	35,109	168.38	5,911,653.42
DAVITA INC	5,038	78.25	394,223.50
DENTSPLY SIRONA INC	11,502	43.38	498,956.76
DEXCOM INC	5,340	370.23	1,977,028.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	36,600	67.98	2,488,068.00
HCA HEALTHCARE INC	15,775	100.55	1,586,176.25
HENRY SCHEIN INC	8,370	56.63	473,993.10
HOLOGIC INC	15,488	50.15	776,723.20
HUMANA INC	7,375	378.72	2,793,060.00
IDEXX LABORATORIES INC	4,870	302.83	1,474,782.10
INSULET CORP	3,850	180.56	695,156.00
INTUITIVE SURGICAL INC	6,475	558.41	3,615,704.75
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,665	167.73	950,190.45
MASIMO CORP	2,870	217.39	623,909.30
MCKESSON CORP	9,114	148.25	1,351,150.50
MEDTRONIC PLC	75,188	93.21	7,008,273.48
MOLINA HEALTHCARE INC	3,380	169.89	574,228.20
QUEST DIAGNOSTICS	7,906	110.60	874,403.60
RESMED INC	8,170	160.69	1,312,837.30
STERIS PLC	4,210	151.82	639,162.20
STRYKER CORP	18,853	187.79	3,540,404.87
TELADOC HEALTH INC	3,930	172.27	677,021.10
TELEFLEX INC	2,650	352.25	933,462.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,270	285.15	15,189,940.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,440	95.58	424,375.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,944	115.29	569,993.76
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	7,850	216.68	1,700,938.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,590	200.73	921,350.70

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,062	125.19	1,384,851.78
ABBVIE INC	98,546	92.46	9,111,563.16
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,720	86.11	1,439,759.20
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,960	109.30	1,416,528.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,580	125.39	825,066.20
AMGEN INC	33,071	217.90	7,206,170.90
AVANTOR INC	22,000	16.98	373,560.00
BEIGENE LTD-ADR	2,360	163.92	386,851.20
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,150	448.85	516,177.50
BIOGEN INC	9,723	279.27	2,715,342.21
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,710	105.72	1,132,261.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	126,595	56.17	7,110,841.15
CATALENT INC	8,690	69.57	604,563.30
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	26,486	22.07	584,546.02
ELI LILLY & CO	48,264	143.54	6,927,814.56
EXACT SCIENCES CORP	8,580	85.37	732,474.60
GILEAD SCIENCES INC	70,794	73.20	5,182,120.80
ILLUMINA INC	8,210	341.61	2,804,618.10
INCYTE CORP	10,910	92.07	1,004,483.70
IONIS PHARMACEUTICALS INC	8,570	58.37	500,230.90
IQVIA HOLDINGS INC	10,733	138.82	1,489,955.06
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,140	104.68	328,695.20
JOHNSON & JOHNSON	148,021	142.15	21,041,185.15
MERCK & CO. INC.	142,363	76.30	10,862,296.90
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,275	764.42	974,635.50
MODERNA INC	15,100	62.00	936,200.00
MYLAN NV	26,285	15.94	418,982.90
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,510	114.82	632,658.20
PERKINELMER INC	6,460	97.14	627,524.40
PERRIGO CO PLC	7,139	51.49	367,587.11
PFIZER INC	310,650	33.75	10,484,437.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,620	588.39	3,306,751.80
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,730	158.85	592,510.50
SEATTLE GENETICS INC	7,000	151.16	1,058,120.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	68,320	11.25	768,600.00

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,364	339.76	7,598,392.64
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,390	268.56	3,864,578.40
WATERS CORP	3,666	185.56	680,262.96
ZOETIS INC	26,560	134.07	3,560,899.20
BANK OF AMERICA CORP	440,869	24.78	10,924,733.82
CITIGROUP INC	118,017	52.25	6,166,388.25
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,680	25.82	611,417.60
COMERICA INC	7,850	39.14	307,249.00
EAST WEST BANCORP INC	7,460	36.52	272,439.20
FIFTH THIRD BANCORP	34,439	20.80	716,503.39
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,280	106.70	1,096,876.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	50,560	9.88	499,785.60
JPMORGAN CHASE & CO	172,650	99.87	17,242,555.50
KEYCORP	58,568	13.22	774,268.96
M & T BANK CORP	7,243	108.96	789,197.28
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	27,220	12.20	332,084.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,970	110.76	2,765,677.20
REGIONS FINANCIAL CORP	62,744	11.90	746,653.60
SIGNATURE BANK	3,150	107.88	339,822.00
SVB FINANCIAL GROUP	2,420	208.53	504,642.60
TRUIST FINANCIAL CORP	78,220	39.47	3,087,343.40
US BANCORP	74,091	37.51	2,779,153.41
WELLS FARGO & CO	218,230	27.97	6,103,893.10
ZIONS BANCORP NA	9,240	34.88	322,291.20
ALLY FINANCIAL INC	20,430	20.44	417,589.20
AMERICAN EXPRESS CO	38,404	101.68	3,904,918.72
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,520	146.64	956,092.80
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,500	49.22	467,590.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	42,962	38.44	1,651,459.28
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	77,580	181.21	14,058,271.80
BLACKROCK INC	8,580	527.04	4,522,003.20
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	38,280	55.73	2,133,344.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,245	70.63	1,924,314.35
CARLYLE GROUP INC/THE	7,170	29.38	210,654.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,300	99.90	629,370.00

CME GROUP INC	20,040	174.72	3,501,388.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,950	52.99	898,180.50
E*TRADE FINANCIAL CORP	14,490	47.68	690,883.20
EQUITABLE HOLDINGS INC	23,170	20.60	477,302.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,210	286.98	634,225.80
FRANKLIN RESOURCES INC	15,725	21.79	342,647.75
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,408	201.78	3,714,366.24
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	30,850	93.26	2,877,071.00
INVESCO LTD	22,157	10.34	229,103.38
KKR & CO INC -A	28,560	29.15	832,524.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,060	492.79	1,015,147.40
MOODY'S CORP	9,087	266.98	2,426,047.26
MORGAN STANLEY	66,505	46.28	3,077,851.40
MSCI INC	4,990	320.95	1,601,540.50
NASDAQ INC	5,835	115.15	671,900.25
NORTHERN TRUST CORP	10,690	83.61	893,790.90
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,020	71.60	574,232.00
S&P GLOBAL INC	13,642	316.91	4,323,286.22
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,934	36.56	2,483,667.04
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,725	56.29	434,840.25
STATE STREET CORP	18,797	63.12	1,186,466.64
SYNCHRONY FINANCIAL	34,440	23.77	818,638.80
T ROWE PRICE GROUP INC	13,565	120.93	1,640,415.45
TD AMERITRADE HOLDING CORP	14,090	39.28	553,455.20
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	62.53	272,630.80
VOYA FINANCIAL INC	9,110	47.86	436,004.60
AFLAC INC	35,714	36.64	1,308,560.96
ALLEGHANY CORP	820	504.28	413,509.60
ALLSTATE CORP	18,863	95.70	1,805,189.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,850	62.33	302,300.50
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	49,495	33.04	1,635,314.80
AON PLC	12,792	181.95	2,327,504.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,845	30.61	791,115.45
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,470	95.32	1,093,320.40
ASSURANT INC	3,300	107.03	353,199.00

ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	9,520	31.00	295,120.00
BROWN & BROWN INC	15,430	40.67	627,538.10
CHUBB LTD	25,245	125.69	3,173,044.05
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,940	61.03	545,608.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	177.74	211,510.60
EVEREST RE GROUP LTD	2,314	214.95	497,394.30
FNF GROUP	15,131	31.87	482,224.97
GLOBE LIFE INC	5,426	75.90	411,833.40
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	20,032	40.03	801,880.96
LINCOLN NATIONAL CORP	8,243	40.68	335,325.24
LOEWS CORP	16,785	33.02	554,240.70
MARKEL CORP	795	949.95	755,210.25
MARSH & MCLENNAN COS	28,133	104.34	2,935,397.22
METLIFE INC	45,945	37.45	1,720,640.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,700	41.88	657,516.00
PROGRESSIVE CORP	34,260	76.60	2,624,316.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,602	63.16	1,301,222.32
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,610	87.98	317,607.80
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,437	183.46	447,092.02
TRAVELERS COS INC/THE	13,654	113.33	1,547,407.82
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,918	186.77	1,292,074.86
WR BERKLEY CORP	9,914	57.02	565,296.28
CBRE GROUP INC - A	16,420	47.57	781,099.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.03	198,276.00
JONES LANG LASALLE INC	2,800	109.17	305,676.00
ACCENTURE PLC-CL A	35,608	201.59	7,178,216.72
ADOBE INC	27,059	406.54	11,000,565.86
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,840	100.34	887,005.60
ANSYS INC	4,560	270.27	1,232,431.20
AUTODESK INC	12,610	222.96	2,811,525.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	24,131	147.01	3,547,498.31
AVALARA INC	4,050	105.95	429,097.50
BLACK KNIGHT INC	9,530	72.10	687,113.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,490	76.97	576,505.30
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	6,100	121.63	741,943.00

CADENCE DESIGN SYS INC	16,100	89.46	1,440,306.00	
CDK GLOBAL INC	5,890	41.47	244,258.30	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,250	106.08	769,080.00	
CITRIX SYSTEMS INC	6,348	140.74	893,417.52	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	29,908	54.80	1,638,958.40	
COUPA SOFTWARE INC	3,730	224.01	835,557.30	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,680	93.12	528,921.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,090	98.12	205,070.80	
DATADOG INC-CLASS A	5,760	78.05	449,568.00	
DOCUSIGN INC	9,380	150.60	1,412,628.00	
DROPBOX INC-CLASS A	17,230	21.03	362,346.90	
DYNATRACE INC	6,630	35.89	237,950.70	
EPAM SYSTEMS INC	3,010	235.00	707,350.00	
FAIR ISAAC CORP	1,620	413.52	669,902.40	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	34,468	137.08	4,724,873.44	
FISERV INC	32,304	100.34	3,241,383.36	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,540	258.99	1,175,814.60	
FORTINET INC	8,040	130.34	1,047,933.60	
GARTNER INC	4,890	118.73	580,589.70	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,729	178.58	2,987,464.82	
GODADDY INC-CLASS A	10,840	76.26	826,658.40	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,520	103.65	572,148.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	49,682	121.91	6,056,732.62	
INTUIT INC	14,576	280.68	4,091,191.68	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,240	172.25	730,340.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,490	98.91	839,745.90	
MASTERCARD INC	50,250	297.79	14,963,947.50	
MICROSOFT CORP	406,214	187.74	76,262,616.36	
MONGODB INC	2,470	193.67	478,364.90	
NORTONLIFELOCK INC	35,105	19.85	696,834.25	
OKTA INC	6,500	179.24	1,165,060.00	
ORACLE CORP	125,873	51.86	6,527,773.78	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,050	221.85	1,342,192.50	
PAYCHEX INC	17,382	73.76	1,282,096.32	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,150	302.80	953,820.00	

PAYPAL HOLDINGS INC	62,527	155.26	9,707,942.02
PTC INC	5,940	75.16	446,450.40
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,390	261.88	1,149,653.20
SALESFORCE.COM INC	47,035	175.11	8,236,298.85
SERVICENOW INC	10,560	385.13	4,066,972.80
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	17,030	30.86	525,545.80
SPLUNK INC	8,490	178.88	1,518,691.20
SQUARE INC - A	21,050	86.72	1,825,456.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,730	56.65	834,454.50
SYNOPSIS INC	8,407	179.60	1,509,897.20
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,280	354.51	808,282.80
TWILIO INC - A	6,580	191.89	1,262,636.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,400	342.71	822,504.00
VERISIGN INC	5,840	204.17	1,192,352.80
VISA INC-CLASS A SHARES	95,832	192.26	18,424,660.32
VMWARE INC	4,435	135.85	602,494.75
WESTERN UNION CO	24,501	22.52	551,762.52
WIX.COM LTD	2,700	216.06	583,362.00
WORKDAY INC-CLASS A	9,860	173.55	1,711,203.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	6,100	219.52	1,339,072.00
AMPHENOL CORP-CL A	15,980	95.01	1,518,259.80
APPLE INC	245,982	338.80	83,338,701.60
ARISTA NETWORKS INC	2,870	222.78	639,378.60
ARROW ELECTRONICS INC	5,360	66.20	354,832.00
CDW CORP/DE	8,560	114.10	976,696.00
CISCO SYSTEMS INC	238,280	45.07	10,739,279.60
COGNEX CORP	8,920	55.16	492,027.20
CORNING INC	43,248	26.93	1,164,668.64
DELL TECHNOLOGIES -C	10,272	46.90	481,756.80
F5 NETWORKS INC	4,015	140.32	563,384.80
FLIR SYSTEMS INC	8,145	41.26	336,062.70
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	71,155	10.15	722,223.25
HP INC	78,505	16.28	1,278,061.40
IPG PHOTONICS CORP	1,840	156.14	287,297.60
JUNIPER NETWORKS INC	18,453	23.89	440,842.17



KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	10,590	95.67	1,013,145.30
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,195	140.60	1,292,817.00
NETAPP INC	13,636	42.46	578,984.56
SEAGATE TECHNOLOGY	14,074	50.61	712,285.14
TE CONNECTIVITY LTD	18,015	78.59	1,415,798.85
TRIMBLE INC	13,610	41.13	559,779.30
WESTERN DIGITAL CORP	17,778	42.95	763,565.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,910	258.33	751,740.30
AT&T INC	402,677	30.50	12,281,648.50
CENTURYLINK INC	60,306	10.08	607,884.48
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,585	22.33	169,410.97
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	27,011	21.77	588,029.47
T-MOBILE US INC	24,969	102.31	2,554,578.39
VERIZON COMMUNICATIONS INC	232,207	56.53	13,126,661.71
AES CORP	34,668	12.67	439,243.56
ALLIANT ENERGY CORP	12,340	48.55	599,107.00
AMEREN CORPORATION	14,992	71.75	1,075,676.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,838	81.80	2,277,148.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,345	127.29	1,189,525.05
ATMOS ENERGY CORP	7,060	100.43	709,035.80
CENTERPOINT ENERGY INC	33,312	18.00	599,616.00
CMS ENERGY CORP	16,110	58.30	939,213.00
CONSOLIDATED EDISON INC	19,126	75.38	1,441,717.88
DOMINION ENERGY INC	46,111	83.15	3,834,129.65
DTE ENERGY COMPANY	11,458	105.07	1,203,892.06
DUKE ENERGY CORP	40,976	86.74	3,554,258.24
EDISON INTERNATIONAL	20,859	57.57	1,200,852.63
ENTERGY CORP	11,607	96.42	1,119,146.94
ESSENTIAL UTILITIES INC	14,140	43.97	621,735.80
EVERGY INC	12,630	60.08	758,810.40
EVERSOURCE ENERGY	17,950	84.31	1,513,364.50
EXELON CORP	52,046	37.91	1,973,063.86
FIRSTENERGY CORP	32,535	40.43	1,315,390.05
NEXTERA ENERGY INC	27,355	246.91	6,754,223.05
NISOURCE INC	19,580	23.26	455,430.80

	NRG ENERGY INC	15,760	33.68	530,796.80	
	OGE ENERGY CORP	12,270	30.86	378,652.20	
	PINNACLE WEST CAPITAL	7,239	75.60	547,268.40	
	PPL CORP	44,198	26.55	1,173,456.90	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	26,338	49.71	1,309,261.98	
	SEMPRA ENERGY	16,867	124.05	2,092,351.35	
	SOUTHERN CO	58,705	56.17	3,297,459.85	
	UGI CORP	12,640	31.03	392,219.20	
	VISTRA ENERGY CORP	20,980	20.20	423,796.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	17,790	90.31	1,606,614.90	
	XCEL ENERGY INC	29,764	63.65	1,894,478.60	
	ADVANCED MICRO DEVICES	65,430	53.50	3,500,505.00	
	ANALOG DEVICES INC	20,210	118.41	2,393,066.10	
	APPLIED MATERIALS INC	52,893	56.55	2,991,099.15	
	BROADCOM INC	22,380	300.25	6,719,595.00	
	INTEL CORP	240,522	59.33	14,270,170.26	
	KLA CORP	8,879	184.69	1,639,862.51	
	LAM RESEARCH CORP	8,517	284.52	2,423,256.84	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	39,914	33.73	1,346,299.22	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,220	57.15	812,673.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,734	99.63	1,368,318.42	
	MICRON TECHNOLOGY INC	62,127	48.69	3,024,963.63	
	NVIDIA CORP	34,365	357.30	12,278,614.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	16,427	106.17	1,744,054.59	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	21,090	18.99	400,499.10	
	QORVO INC	6,090	108.90	663,201.00	
	QUALCOMM INC	64,162	85.24	5,469,168.88	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,050	126.91	1,275,445.50	
	TERADYNE INC	8,220	71.75	589,785.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	52,482	123.97	6,506,193.54	
	XILINX INC	13,865	90.70	1,257,555.50	
米ドル小計		16,535,271		1,464,188,031.37	(157,019,524,484)
加ドル	CAMECO CORP	19,892	13.82	274,907.44	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	68,364	24.34	1,663,979.76	

CENOVUS ENERGY INC	55,183	6.21	342,686.43
ENBRIDGE INC	113,217	42.13	4,769,832.21
IMPERIAL OIL LTD	16,232	23.14	375,608.48
INTER PIPELINE LTD	24,540	12.15	298,161.00
KEYERA CORP	12,200	20.71	252,662.00
PARKLAND CORP	7,370	34.57	254,780.90
PEMBINA PIPELINE CORP	34,362	33.46	1,149,752.52
SUNCOR ENERGY INC	80,249	24.87	1,995,792.63
TC ENERGY CORP	54,293	58.88	3,196,771.84
AGNICO EAGLE MINES LTD	14,905	80.56	1,200,746.80
B2GOLD CORP	55,700	6.97	388,229.00
BARRICK GOLD CORP	101,324	32.74	3,317,347.76
CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,000	45.07	360,560.00
FRANCO-NEVADA CORP	10,995	175.68	1,931,601.60
KINROSS GOLD CORP	81,465	8.43	686,749.95
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,580	49.84	626,987.20
LUNDIN MINING CORP	35,450	6.56	232,552.00
NUTRIEN LTD	32,518	49.27	1,602,161.86
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,120	35.54	395,204.80
TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,375	14.11	358,041.25
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,945	51.86	1,293,647.70
YAMANA GOLD INC	50,700	6.64	336,648.00
CAE INC	14,195	24.25	344,228.75
WSP GLOBAL INC	5,830	84.74	494,034.20
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,810	54.25	315,192.50
THOMSON REUTERS CORP	11,066	91.65	1,014,198.90
AIR CANADA	7,190	19.40	139,486.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	39,878	119.52	4,766,218.56
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,335	342.39	2,511,430.65
MAGNA INTERNATIONAL INC	17,668	60.03	1,060,610.04
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,950	21.87	217,606.50
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,698	75.74	1,188,966.52
QUEBECOR INC -CL B	10,270	29.50	302,965.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	29,755	23.05	685,852.75
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,110	120.38	374,381.80

DOLLARAMA INC	15,530	47.90	743,887.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	50,470	41.77	2,108,131.90
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	31.07	257,570.30
LOBLAW COMPANIES LTD	11,679	66.44	775,952.76
METRO INC	16,340	57.41	938,079.40
WESTON (GEORGE) LTD	4,918	97.91	481,521.38
SAPUTO INC	16,060	32.41	520,504.60
BAUSCH HEALTH COS INC	21,544	23.22	500,251.68
CANOPY GROWTH CORP	11,710	22.44	262,772.40
CRONOS GROUP INC	7,240	8.77	63,494.80
BANK OF MONTREAL	38,081	74.45	2,835,130.45
BANK OF NOVA SCOTIA	70,449	58.51	4,121,970.99
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25,165	94.02	2,366,013.30
NATIONAL BANK OF CANADA	18,230	60.99	1,111,847.70
ROYAL BANK OF CANADA	79,759	91.35	7,285,984.65
TORONTO-DOMINION BANK	101,370	62.41	6,326,501.70
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	76,999	46.44	3,575,833.56
CI FINANCIAL CORP	9,990	16.81	167,931.90
IGM FINANCIAL INC	5,685	33.12	188,287.20
ONEX CORPORATION	4,665	59.99	279,853.35
TMX GROUP LTD	3,030	128.93	390,657.90
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,460	421.32	615,127.20
GREAT-WEST LIFECO INC	14,894	23.80	354,477.20
IA FINANCIAL CORP INC	6,525	45.59	297,474.75
INTACT FINANCIAL CORP	8,055	131.04	1,055,527.20
MANULIFE FINANCIAL CORP	114,621	18.78	2,152,582.38
POWER CORP OF CANADA	34,419	23.86	821,237.34
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,274	50.15	1,618,541.10
BLACKBERRY LTD	27,808	7.14	198,549.12
CGI INC	13,900	89.49	1,243,911.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,130	1,471.03	1,662,263.90
OPEN TEXT CORP	17,290	56.92	984,146.80
SHOPIFY INC - CLASS-A	5,910	1,009.23	5,964,549.30
BCE INC	10,040	57.29	575,191.60
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	20,945	59.58	1,247,903.10

	TELUS CORP	21,332	23.30	497,035.60	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	18.76	508,020.80	
	ALTAGAS LTD	11,770	15.08	177,491.60	
	ATCO LTD -CLASS I	4,130	36.38	150,249.40	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,320	31.02	227,066.40	
	EMERA INC	12,030	53.32	641,439.60	
	FORTIS INC	24,915	51.39	1,280,381.85	
	HYDRO ONE LTD	19,820	25.21	499,662.20	
加ドル小計		2,163,606		98,795,593.66 (7,771,261,397)	
ユーロ	ENI SPA	139,816	8.58	1,200,599.99	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,435	10.80	361,098.00	
	NESTE OYJ	25,900	34.91	904,169.00	
	OMV AG	7,890	31.40	247,746.00	
	REPSOL SA	81,149	8.68	705,022.51	
	TENARIS SA	19,915	6.25	124,548.41	
	TOTAL SA	138,747	35.09	4,869,325.96	
	VOPAK	3,530	47.83	168,839.90	
	AIR LIQUIDE SA	26,450	123.05	3,254,672.50	
	AKZO NOBEL	10,697	74.24	794,145.28	
	ARCELORMITTAL	35,962	9.52	342,609.97	
	ARKEMA	4,795	80.08	383,983.60	
	BASF SE	52,615	51.12	2,689,678.80	
	COVESTRO AG	9,190	32.72	300,696.80	
	CRH PLC	42,390	29.60	1,254,744.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,440	22.73	260,031.20	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	4,960	35.74	177,270.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,545	45.60	344,052.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,272	118.90	1,221,340.80	
	LANXESS AG	5,195	45.40	235,853.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,840	27.24	322,521.60	
	SOLVAY SA	3,231	70.42	227,527.02	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	29,305	10.60	310,633.00	
	SYMRISE AG	6,400	95.82	613,248.00	
	THYSSENKRUPP AG	19,305	6.94	134,131.14	

UMICORE	10,350	41.73	431,905.50
UPM-KYMMENE OYJ	29,468	25.73	758,211.64
VOESTALPINE AG	7,119	19.26	137,111.94
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	17,586	22.63	397,971.18
AIRBUS GROUP SE	33,668	66.95	2,254,072.60
ALSTOM	12,120	41.25	499,950.00
ANDRITZ AG	3,810	32.72	124,663.20
BOUYGUES SA	11,990	27.54	330,204.60
BRENTAG AG	6,735	44.96	302,805.60
CNH INDUSTRIAL NV	61,720	6.07	375,134.16
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	28,726	29.91	859,194.66
DASSAULT AVIATION SA	135	848.00	114,480.00
EIFFAGE	5,490	80.86	443,921.40
FERROVIAL SA	29,515	24.60	726,069.00
GEA GROUP AG	6,680	26.91	179,758.80
HOCHTIEF AG	1,490	76.05	113,314.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,880	52.30	412,124.00
KION GROUP AG	3,820	51.84	198,028.80
KNORR-BREMSE AG	2,970	94.00	279,180.00
KONE OYJ-B	18,724	59.48	1,113,703.52
LEGRAND SA	13,818	62.50	863,625.00
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	22,040	6.19	136,559.84
METSO OYJ	4,590	29.79	136,736.10
MTU AERO ENGINES AG	3,460	155.90	539,414.00
PRYSMIAN SPA	13,115	19.20	251,873.57
SAFRAN SA	17,790	89.84	1,598,253.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,918	91.12	2,817,248.16
SIEMENS AG-REG	43,016	98.56	4,239,656.96
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	14.84	174,518.40
THALES SA	5,655	70.58	399,129.90
VINCI SA	28,610	82.98	2,374,057.80
WARTSILA OYJ ABP	21,180	7.21	152,877.24
BUREAU VERITAS SA	14,440	18.84	272,049.60
RANDSTAD NV	8,295	38.52	319,523.40
TELEPERFORMANCE	3,510	208.40	731,484.00

WOLTERS KLUWER	16,107	66.60	1,072,726.20
ADP	1,740	98.95	172,173.00
AENA SA	3,970	124.00	492,280.00
ATLANTIA SPA	30,320	14.37	435,850.00
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	10.47	125,011.80
DEUTSCHE POST AG-REG	55,633	30.21	1,680,672.93
FRAPORT AG	2,750	43.00	118,250.00
GETLINK	24,830	12.96	321,796.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,335	56.15	973,360.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,880	44.08	126,950.40
CONTINENTAL AG	6,845	86.30	590,723.50
DAIMLER AG	47,022	36.02	1,693,732.44
FAURECIA	4,660	32.87	153,174.20
FERRARI NV	6,584	148.65	978,711.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	60,657	8.19	496,962.80
MICHELIN (CGDE)-B	9,989	89.94	898,410.66
PEUGEOT SA	39,060	13.46	525,942.90
PIRELLI & C SPA	24,100	3.90	93,990.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	8,230	50.12	412,487.60
RENAULT SA	10,857	22.00	238,854.00
VALEO SA	12,380	22.00	272,360.00
VOLKSWAGEN AG	1,951	146.40	285,626.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,803	133.96	1,447,169.88
ADIDAS AG	10,591	230.10	2,436,989.10
ESSILORLUXOTTICA	16,425	113.90	1,870,807.50
HERMES INTERNATIONAL	1,857	738.40	1,371,208.80
KERING	4,347	487.35	2,118,510.45
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	15,574	379.15	5,904,882.10
MONCLER SPA	12,280	34.02	417,765.60
PUMA SE	4,530	65.60	297,168.00
SEB SA	1,300	134.20	174,460.00
ACCOR SA	7,646	25.78	197,113.88
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,093	120.70	614,725.10
SODEXO	4,090	64.00	261,760.00
ALTICE EUROPE NV	34,400	3.60	123,840.00

BOLLORE	47,430	2.78	132,045.12
JC DECAUX SA	5,130	18.46	94,699.80
PUBLICIS GROUPE	14,745	29.60	436,452.00
SCOUT24 AG	5,880	67.60	397,488.00
SES	21,670	6.79	147,312.66
TELENET GROUP HOLDING NV	2,110	37.42	78,956.20
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,800	66.94	321,312.00
VIVENDI	45,820	22.12	1,013,538.40
DELIVERY HERO SE	6,940	84.30	585,042.00
INDITEX	59,795	24.41	1,459,595.95
JUST EAT TAKEAWAY	6,500	82.20	534,300.00
PROSUS	27,820	77.00	2,142,140.00
ZALANDO SE	7,390	61.80	456,702.00
CARREFOUR SA	31,793	14.04	446,373.72
COLRUYT SA	3,945	53.62	211,530.90
JERONIMO MARTINS	15,165	15.09	228,839.85
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	64,328	23.42	1,506,561.76
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	5,840	8.48	49,569.92
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	43,801	45.20	1,979,805.20
DANONE	34,144	61.24	2,090,978.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	31,170	7.46	232,528.20
HEINEKEN HOLDING NV	6,325	73.15	462,673.75
HEINEKEN NV	14,483	81.46	1,179,785.18
KERRY GROUP PLC-A	9,300	109.20	1,015,560.00
PERNOD-RICARD SA	12,596	143.65	1,809,415.40
REMY COINTREAU	1,360	115.20	156,672.00
BEIERSDORF AG	5,415	98.24	531,969.60
HENKEL AG & CO KGAA	7,080	73.95	523,566.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	9,853	81.80	805,975.40
L'OREAL	14,196	263.40	3,739,226.40
UNILEVER NV	82,425	47.33	3,901,175.25
BIOMERIEUX	2,140	113.40	242,676.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	86.40	164,160.00
DIASORIN SPA	1,330	167.00	222,110.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,483	74.24	852,497.92



FRESENIUS SE & CO KGAA	22,885	42.22	966,204.70
KONINKLIJKE PHILIPS NV	49,741	40.20	1,999,588.20
ORPEA	2,780	99.28	275,998.40
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	2,130	288.00	613,440.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,700	42.62	328,212.50
BAYER AG-REG	54,964	65.23	3,585,301.72
EUROFINS SCIENTIFIC	595	570.60	339,507.00
GALAPAGOS NV	2,690	172.20	463,218.00
GRIFOLS SA	16,550	27.92	462,076.00
IPSEN	2,270	70.75	160,602.50
MERCK KGAA	7,630	101.30	772,919.00
ORION OYJ-CLASS B	5,150	43.21	222,531.50
QIAGEN N.V.	15,284	38.15	583,084.60
RECORDATI SPA	6,540	40.56	265,262.40
SANOFI	63,246	89.02	5,630,158.92
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,710	209.40	358,074.00
UCB SA	7,948	87.72	697,198.56
ABN AMRO BANK NV-CVA	22,380	7.64	171,072.72
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	389,073	3.12	1,217,409.41
BANCO SANTANDER SA	927,149	2.21	2,051,780.73
BANKINTER SA	40,610	4.23	172,064.57
BNP PARIBAS	62,662	34.97	2,191,290.14
CAIXABANK S.A	247,550	1.85	460,071.67
COMMERZBANK AG	48,544	4.16	201,943.04
CREDIT AGRICOLE SA	70,292	8.12	571,192.79
ERSTE GROUP BANK AG	18,678	22.50	420,255.00
FINECOBANK SPA	38,820	11.58	449,535.60
ING GROEP NV-CVA	225,935	6.37	1,439,657.82
INTESA SANPAOLO	852,493	1.62	1,382,743.64
KBC GROEP NV	14,349	49.07	704,105.43
MEDIOBANCA SPA	33,950	6.80	231,131.60
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	7,760	17.26	133,937.60
SOCIETE GENERALE	50,369	14.76	743,748.65
UNICREDIT SPA	113,836	7.94	904,085.51
AMUNDI SA	3,300	66.00	217,800.00

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	119,335	8.27	987,855.13
DEUTSCHE BOERSE AG	10,920	149.45	1,631,994.00
EURAZEO SE	1,877	46.08	86,492.16
EXOR NV	5,564	48.57	270,243.48
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,452	73.18	325,797.36
NATIXIS	49,540	2.27	112,554.88
SOFINA	800	228.50	182,800.00
WENDEL	1,690	82.40	139,256.00
AEGON NV	77,949	2.57	200,562.77
AGEAS	9,104	32.79	298,520.16
ALLIANZ SE-REG	23,348	178.08	4,157,811.84
ASSICURAZIONI GENERALI	64,878	13.42	870,987.15
AXA	103,232	18.28	1,887,700.35
CNP ASSURANCES	10,340	10.98	113,533.20
HANNOVER RUECK SE-REG	3,055	154.70	472,608.50
MAPFRE SA	59,864	1.71	102,487.16
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,906	224.70	1,776,478.20
NN GROUP NV	14,100	30.12	424,692.00
POSTE ITALIANE SPA	25,780	8.24	212,633.44
SAMPO OYJ-A SHS	24,259	30.57	741,597.63
SCOR SE	7,452	24.38	181,679.76
AROUNDTOWN SA	56,420	5.49	310,084.32
DEUTSCHE WOHNEN SE	20,720	39.65	821,548.00
LEG IMMOBILIEN AG	3,800	117.00	444,600.00
VONOVIA SE	30,348	53.14	1,612,692.72
ADYEN NV	990	1,170.50	1,158,795.00
AMADEUS IT GROUP SA	26,010	48.40	1,258,884.00
ATOS SE	5,240	69.52	364,284.80
CAP GEMINI SA	8,799	96.16	846,111.84
DASSAULT SYSTEMES SA	7,260	147.15	1,068,309.00
EDENRED	13,336	39.22	523,037.92
NEMETSCHKE SE	3,020	59.95	181,049.00
NEXI SPA	20,200	14.16	286,032.00
SAP SE	58,722	115.30	6,770,646.60
TEAMVIEWER AG	7,050	42.53	299,836.50

WIRECARD AG	7,040	92.13	648,595.20
WORLDLINE SA	7,950	67.80	539,010.00
INGENICO GROUP	3,850	127.75	491,837.50
NOKIA OYJ	337,866	3.72	1,259,226.58
CELLNEX TELECOM SA	15,470	48.75	754,162.50
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	183,136	14.59	2,671,954.24
ELISA OYJ	9,185	53.02	486,988.70
ILIAD SA	956	160.70	153,629.20
KONINKLIJKE KPN NV	194,906	2.24	438,343.59
ORANGE S.A.	111,554	10.41	1,161,277.14
PROXIMUS	8,290	19.42	160,991.80
TELECOM ITALIA SPA	535,213	0.35	189,144.27
TELECOM ITALIA-RSP	334,757	0.37	124,596.55
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	54,770	2.59	142,182.92
TELEFONICA SA	267,639	4.54	1,215,616.33
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,700	35.12	235,304.00
E.ON SE	134,319	9.73	1,307,998.42
EDF	32,475	8.16	265,125.90
ELIA GROUP SA/NV	1,600	94.50	151,200.00
ENAGAS SA	12,350	20.72	255,892.00
ENDESA SA	16,390	21.43	351,237.70
ENEL SPA	454,627	7.34	3,339,235.31
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,171	4.10	624,966.29
ENGIE	107,554	10.95	1,178,254.07
FORTUM OYJ	27,245	16.70	454,991.50
IBERDROLA SA	324,662	9.75	3,165,454.50
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,152	16.50	250,083.76
RED ELECTRICA CORPORACION SA	28,700	16.27	466,949.00
RWE AG	34,935	29.70	1,037,569.50
SNAM SPA	119,980	4.32	518,913.50
SUEZ	20,969	10.37	217,448.53
TERNA SPA	77,357	6.04	467,390.99
UNIPER SE	11,740	27.46	322,380.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,224	20.45	618,080.80
VERBUND AG	4,580	39.00	178,620.00

	ASML HOLDING NV	23,872	306.00	7,304,832.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	69,985	19.53	1,366,807.05	
	STMICROELECTRONICS NV	37,673	22.90	862,711.70	
ユーロ小計		10,621,810		203,947,388.81 (24,612,370,881)	
英ポンド	BP PLC	1,133,308	3.23	3,661,151.49	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	231,688	13.50	3,128,714.75	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	209,339	13.05	2,733,548.66	
	ANGLO AMERICAN PLC	62,234	18.25	1,135,894.96	
	ANTOFAGASTA PLC	25,070	8.68	217,607.60	
	BHP GROUP PLC	115,391	16.67	1,924,029.53	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,891	50.08	445,261.28	
	EVRAZ PLC	27,180	2.87	78,224.04	
	GLENCORE PLC	634,313	1.72	1,093,175.02	
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,079	20.90	231,551.10	
	MONDI PLC	30,300	14.33	434,350.50	
	RIO TINTO PLC	64,085	45.96	2,945,346.60	
	ASHTED GROUP PLC	24,840	23.61	586,472.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	175,515	5.04	885,999.72	
	BUNZL PLC	20,946	18.84	394,622.64	
	DCC PLC	5,200	67.02	348,504.00	
	FERGUSON PLC	13,262	60.68	804,738.16	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	299,980	1.18	355,626.29	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	98,015	3.27	320,999.12	
	SMITHS GROUP PLC	21,173	12.58	266,356.34	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,940	95.70	377,058.00	
	EXPERIAN PLC	49,948	27.24	1,360,583.52	
	INTERTEK GROUP PLC	8,415	52.78	444,143.70	
	RELX PLC	107,025	18.34	1,962,838.50	
	RENTOKIL INITIAL PLC	94,500	4.80	453,978.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	68,420	5.25	359,752.36	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,680	41.81	279,290.80	
	BURBERRY GROUP PLC	23,124	15.94	368,596.56	
	PERSIMMON PLC	20,620	23.24	479,208.80	
	TAYLOR WIMPEY PLC	207,190	1.51	313,892.85	

COMPASS GROUP PLC	91,108	11.50	1,047,742.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC(N)	2,773	107.50	298,097.50	
GVC HOLDINGS PLC	39,790	7.45	296,674.24	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,283	38.52	357,581.16	
WHITBREAD PLC	10,770	23.64	254,602.80	
AUTO TRADER GROUP PLC	48,880	5.30	259,064.00	
INFORMA PLC	72,880	4.60	335,685.28	
ITV PLC	197,275	0.78	155,255.42	
PEARSON PLC	44,059	5.73	252,458.07	
WPP PLC	71,004	6.18	439,230.74	
JD SPORTS FASHION PLC	22,530	6.28	141,533.46	
KINGFISHER PLC	114,937	1.96	226,310.95	
NEXT PLC	6,767	50.28	340,244.76	
OCADO GROUP PLC	28,950	19.58	566,841.00	
SAINSBURY (J) PLC	118,901	1.95	231,856.95	
TESCO PLC	544,264	2.26	1,231,125.16	
WM MORRISON SUPERMARKETS	129,955	1.83	238,987.24	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,905	19.28	364,488.40	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	128,457	30.00	3,853,710.00	
COCA-COLA HBC AG-CDI	12,840	20.56	263,990.40	
DIAGEO PLC	131,302	27.80	3,650,195.60	
IMPERIAL BRANDS PLC	51,242	14.85	761,199.91	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39,865	69.08	2,753,874.20	
UNILEVER PLC	64,027	43.04	2,755,722.08	
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-	
SMITH & NEPHEW PLC	53,936	16.01	863,785.04	
ASTRAZENECA PLC	73,733	82.01	6,046,843.33	
GLAXOSMITHKLINE PLC	280,841	15.99	4,491,209.27	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	23.05	177,254.50	
BARCLAYS PLC	1,008,251	1.17	1,180,258.62	
HSBC HOLDINGS PLC	1,137,761	3.80	4,327,473.96	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,075,336	0.31	1,301,254.78	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	302,430	1.18	358,984.41	
STANDARD CHARTERED PLC	171,830	4.26	733,542.27	
3I GROUP PLC	50,419	8.13	409,906.47	

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,720	16.15	350,778.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,527	79.62	1,475,119.74	
	M&G PLC	134,322	1.51	203,497.83	
	SCHRODERS PLC	6,901	29.15	201,164.15	
	ST JAMES'S PLACE PLC	32,650	9.26	302,534.90	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	124,315	2.51	312,154.96	
	ADMIRAL GROUP PLC	10,865	22.63	245,874.95	
	AVIVA PLC	199,265	2.76	550,967.72	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,553	2.73	201,461.66	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	329,201	2.25	742,677.45	
	PRUDENTIAL PLC	142,162	11.42	1,623,490.04	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	55,138	4.05	223,639.72	
	AVEVA GROUP PLC	3,440	38.72	133,196.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	57,710	6.50	375,230.42	
	HALMA PLC	24,530	21.85	535,980.50	
	BT GROUP PLC	471,052	1.15	543,122.95	
	VODAFONE GROUP PLC	1,457,328	1.26	1,837,690.60	
	NATIONAL GRID PLC	188,078	9.16	1,723,170.63	
	SEVERN TRENT PLC	11,503	24.06	276,762.18	
	SSE PLC	64,417	12.38	797,804.54	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	37,015	9.02	333,875.30	
英債券小計		16,436,444		82,348,696.30	(11,046,254,121)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	12,660	17.79	225,221.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	460	694.50	319,470.00	
	GIVAUDAN-REG	528	3,394.00	1,792,032.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	26,539	40.25	1,068,194.75	
	SIKA AG-REG	7,250	168.90	1,224,525.00	
	ABB LTD-REG	108,925	19.75	2,151,813.37	
	GEBERIT AG-REG	1,920	452.70	869,184.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,050	214.20	224,910.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,220	215.80	479,076.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	8,977	44.56	400,015.12	
	SGS SA-REG	333	2,215.00	737,595.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,620	140.85	509,877.00	

	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	30,569	60.80	1,858,595.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,670	189.70	316,799.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,150	37.02	116,613.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	175	1,808.00	316,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	68	7,710.00	524,280.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	81,300.00	487,800.00	
	NESTLE SA-REG	167,543	102.80	17,223,420.40	
	ALCON INC	25,204	54.88	1,383,195.52	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,170	198.35	628,769.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	700	740.80	518,560.00	
	LONZA GROUP AG-REG	4,088	465.50	1,902,964.00	
	NOVARTIS AG-REG	121,053	80.26	9,715,713.78	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	39,468	325.65	12,852,754.20	
	VIFOR PHARMA AG	2,520	138.45	348,894.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,500	88.10	132,150.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	128,868	9.45	1,218,060.33	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,750	41.25	484,687.50	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,185	72.00	157,320.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,050	805.20	845,460.00	
	UBS GROUP AG-REG	202,022	10.25	2,071,735.61	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,490	141.40	352,086.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,510	352.50	532,275.00	
	SWISS RE AG	18,029	73.20	1,319,722.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,391	327.00	2,743,857.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,291	89.65	384,688.15	
	TEMENOS AG	3,470	136.95	475,216.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,070	55.16	500,301.20	
	SWISSCOM AG-REG	1,514	487.20	737,620.80	
	スイスフラン小計	970,006		70,151,853.13 (7,906,815,366)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	10,270	221.80	2,277,886.00	
	BOLIDEN AB	14,670	209.40	3,071,898.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	32,900	110.20	3,625,580.00	
	ALFA LAVAL AB	17,850	189.95	3,390,607.50	
	ASSA ABLOY AB-B	58,680	187.50	11,002,500.00	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,375	371.60	13,888,550.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	22,930	323.70	7,422,441.00	
	EPIROC AB-A	38,955	110.65	4,310,370.75	
	EPIROC AB-B	23,530	109.25	2,570,652.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,840	194.55	3,276,222.00	
	SANDVIK AB	66,360	155.70	10,332,252.00	
	SKANSKA AB-B SHS	19,210	183.00	3,515,430.00	
	SKF AB-B SHARES-B	19,909	169.35	3,371,589.15	
	VOLVO AB-B SHS-B	82,510	136.80	11,287,368.00	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	119.40	1,746,702.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,585	153.15	2,080,542.75	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,170	72.76	1,831,369.20	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,910	541.60	3,742,456.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	47,478	143.85	6,829,710.30	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	426.80	1,805,364.00	
	SWEDISH MATCH AB	10,830	626.20	6,781,746.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	34,255	285.50	9,779,802.50	
	NORDEA BANK ABP	171,022	67.67	11,573,058.74	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	102,350	78.28	8,011,958.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	91,910	89.12	8,191,019.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	56,890	123.22	7,009,985.80	
	EQT AB	12,440	151.30	1,882,172.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,060	204.40	2,056,264.00	
	INVESTOR AB-B SHS	25,465	483.00	12,299,595.00	
	KINNEVIK AB - B	12,405	226.10	2,804,770.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,980	411.60	1,638,168.00	
	ERICSSON LM-B SHS	164,655	83.60	13,765,158.00	
	HEXAGON AB-B SHS	15,580	510.80	7,958,264.00	
	TELE2 AB-B SHS	31,215	121.65	3,797,304.75	
	TELIA CO AB	163,930	31.66	5,190,023.80	
	スウェーデンクローナ小計	1,480,978		204,118,782.04 (2,343,283,617)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	62,104	144.05	8,946,081.20	
	NORSK HYDRO A S	62,840	26.92	1,691,652.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,470	349.30	3,307,871.00	



	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,140	235.80	1,212,012.00	
	MOWI ASA	25,740	187.55	4,827,537.00	
	ORKLA ASA	38,170	85.78	3,274,222.60	
	DNB ASA	58,605	134.70	7,894,093.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,470	182.60	2,094,422.00	
	TELENOR ASA	43,115	150.00	6,467,250.00	
ノルウェークローネ小計		316,654		39,715,142.10	(439,646,623)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,650	662.80	4,407,620.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,675	373.90	4,365,282.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	11,590	662.60	7,679,534.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	195	7,010.00	1,366,950.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	338	7,540.00	2,548,520.00	
	DSV PANALPINA A S	12,850	768.80	9,879,080.00	
	PANDORA A/S	6,740	339.40	2,287,556.00	
	CARLSBERG AS-B	5,350	867.00	4,638,450.00	
	AMBU A/S-B	8,710	215.10	1,873,521.00	
	COLOPLAST-B	6,925	1,044.50	7,233,162.50	
	DEMANT A/S	7,410	183.00	1,356,030.00	
	GN STORE NORD A/S	6,950	351.80	2,445,010.00	
	GENMAB A/S	3,790	1,979.00	7,500,410.00	
	H LUNDBECK A/S	4,200	249.70	1,048,740.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	99,215	432.10	42,870,801.50	
	DANSKE BANK A/S	31,805	87.86	2,794,387.30	
TRYG A/S	6,075	193.50	1,175,512.50		
ORSTED A/S	9,960	749.20	7,462,032.00		
デンマーククローネ小計		240,428		112,932,599.30	(1,828,378,782)
豪ドル	AMPOL LTD	14,105	27.83	392,542.15	
	OIL SEARCH LTD	77,602	3.29	255,310.58	
	ORIGIN ENERGY LTD	89,820	5.74	515,566.80	
	SANTOS LTD	94,995	5.40	512,973.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	52,353	21.37	1,118,783.61	
	BHP GROUP LTD	167,346	35.99	6,022,782.54	
	BLUESCOPE STEEL LTD	30,460	11.90	362,474.00	

EVOLUTION MINING LTD	87,400	5.50	480,700.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	91,055	14.81	1,348,524.55
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	23,075	25.89	597,411.75
NEWCREST MINING LTD	41,779	30.09	1,257,130.11
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	40,200	13.70	550,740.00
ORICA LIMITED	20,325	16.95	344,508.75
RIO TINTO LTD	21,508	97.81	2,103,697.48
SOUTH32 LTD	255,347	2.10	536,228.70
CIMIC GROUP LTD	4,887	24.98	122,077.26
BRAMBLES LTD	99,698	10.95	1,091,693.10
AURIZON HOLDINGS LTD	117,770	4.64	546,452.80
QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.49	197,560.00
SYDNEY AIRPORT	66,676	6.46	430,726.96
TRANSURBAN GROUP	160,969	14.19	2,284,150.11
ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,560	25.79	891,302.40
CROWN RESORTS LTD	19,095	9.95	189,995.25
TABCORP HOLDINGS LTD	97,874	3.35	327,877.90
REA GROUP LTD	3,030	102.62	310,938.60
SEEK LTD	17,930	19.49	349,455.70
WESFARMERS LTD	67,285	42.47	2,857,593.95
COLES GROUP LTD	62,585	15.91	995,727.35
WOOLWORTHS GROUP LTD	73,362	36.67	2,690,184.54
COCA-COLA AMATIL LTD	30,530	9.14	279,044.20
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,246	10.86	393,631.56
COCHLEAR LTD	2,917	191.47	558,517.99
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,995	65.58	589,892.10
SONIC HEALTHCARE LTD	26,720	28.07	750,030.40
CSL LTD	25,562	284.32	7,267,787.84
AUST AND NZ BANKING GROUP	156,789	18.92	2,966,447.88
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	99,707	67.32	6,712,275.24
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	185,023	18.59	3,439,577.57
WESTPAC BANKING CORP	201,271	17.89	3,600,738.19
AMP LTD	156,627	1.71	268,615.30
ASX LTD	10,195	85.13	867,900.35
MACQUARIE GROUP LTD	19,194	115.60	2,218,826.40

	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	7,680	55.72	427,929.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	154,275	5.64	870,111.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	142,760	2.93	418,286.80	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	68,340	8.30	567,222.00	
	SUNCORP GROUP LTD	70,376	9.30	654,496.80	
	AFTERPAY LTD	11,530	51.86	597,945.80	
	COMPUTERSHARE LTD	25,050	12.70	318,135.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,500	21.22	180,370.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	231,884	3.16	732,753.44	
	TPG TELECOM LTD	21,450	8.20	175,890.00	
	AGL ENERGY LTD	35,761	17.46	624,387.06	
	APA GROUP	66,218	11.22	742,965.96	
	AUSNET SERVICES	117,310	1.74	204,705.95	
豪ドル小計		3,898,001		66,113,594.37	(4,830,259,204)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	6.48	366,217.20	
	A2 MILK CO LTD	38,820	18.80	729,816.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,340	28.40	890,056.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	19,940	12.85	256,229.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	128,777	4.33	557,604.41	
	MERCURY NZ LTD	34,000	4.65	158,100.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	77,080	4.76	366,900.80	
ニュージーランドドル小計		386,472		3,324,923.41	(228,555,235)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	167,708	52.05	8,729,201.40	
	NWS HOLDINGS LTD	82,500	7.14	589,050.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	76,500	73.95	5,657,175.00	
	MTR CORP	82,000	40.85	3,349,700.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	127,000	54.45	6,915,150.00	
	SANDS CHINA LTD	130,600	32.55	4,251,030.00	
	SJM HOLDINGS LTD	138,000	9.25	1,276,500.00	
	WYNN MACAU LTD	93,800	14.64	1,373,232.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	23.55	1,599,045.00	
	WH GROUP LTD	530,500	6.74	3,575,570.00	
	BANK OF EAST ASIA	76,040	18.44	1,402,177.60	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	207,500	24.10	5,000,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	44,700	129.50	5,788,650.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	65,500	296.20	19,401,100.00	
	AIA GROUP LTD	677,190	71.40	48,351,366.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	150,208	47.00	7,059,776.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	131,000	17.42	2,282,020.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	72,901	29.55	2,154,224.55	
	KERRY PROPERTIES LTD	31,950	20.55	656,572.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	394,666	9.24	3,646,713.84	
	SINO LAND CO	143,050	9.67	1,383,293.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,480	100.30	8,072,144.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,017	44.60	1,338,758.20	
	SWIRE PROPERTIES LTD	66,000	19.48	1,285,680.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	34.45	2,197,910.00	
	WHEELOCK & CO LTD	30,600	60.25	1,843,650.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	214,000	11.48	2,456,720.00	
	PCCW LTD	231,000	4.47	1,032,570.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	42,000	41.15	1,728,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	96,500	78.05	7,531,825.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	159,500	7.76	1,237,720.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	564,434	12.54	7,078,002.36	
	HONG KONG & CHINA GAS(N)	28,221	12.54	353,891.34	
	POWER ASSETS HOLDINGS	81,000	44.30	3,588,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,800	75.60	1,345,680.00	
	香港ドル小計	5,196,565		175,533,448.29	(2,429,382,924)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	89,860	6.04	542,754.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	86,700	3.45	299,115.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	92,000	4.16	382,720.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	352,600	0.77	271,502.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	21.85	131,100.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	120,260	3.96	476,229.60	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	103,915	21.93	2,278,855.95	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	200,640	9.24	1,853,913.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,500	22.28	1,303,380.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,700	8.25	327,525.00	
	CAPITALAND LTD	145,700	3.00	437,100.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	28,900	8.53	246,517.00	
	UOL GROUP LTD	26,150	7.16	187,234.00	
	VENTURE CORP LTD	16,600	15.25	253,150.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	470,580	2.55	1,199,979.00	
シンガポールドル小計		1,838,105		10,191,075.55	(783,286,066)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	36,890	12.25	451,902.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	499.50	599,400.00	
	BANK HAPOALIM BM	60,335	21.80	1,315,303.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	95,805	19.48	1,866,281.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,400	11.70	753,480.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	76.59	628,038.00	
	AZRIELI GROUP LTD	2,740	176.10	482,514.00	
	NICE LTD	3,355	643.70	2,159,613.50	
イスラエルシュケル小計		272,925		8,256,532.40	(254,714,024)
合 計		60,357,265		221,493,732,724	(221,493,732,724)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	31,970	435,111.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,530	1,040,033.10	
		AMERICAN TOWER CORP	24,829	6,407,868.32	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	84,800	591,056.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,295	1,358,306.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,457	816,438.78	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,330	508,002.30	
		CROWN CASTLE INTL CORP	23,260	3,823,246.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,325	2,084,200.00	

		DUKE REALTY CORPORATION	19,465	688,087.75	
		EQUINIX INC	4,778	3,232,985.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,990	634,265.10	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	22,360	1,421,425.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,120	1,028,681.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,100	686,641.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,945	356,904.15	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,055	770,951.40	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	39,369	497,624.16	
		INVITATION HOMES INC	30,340	839,507.80	
		IRON MOUNTAIN INC	17,545	488,101.90	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,900	618,222.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,520	657,321.60	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,590	306,147.60	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	338,036.40	
		PROLOGIS INC	41,278	3,899,119.88	
		PUBLIC STORAGE	9,219	1,811,256.93	
		REALTY INCOME CORP	18,530	1,119,767.90	
		REGENCY CENTERS CORP	11,425	547,143.25	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	6,450	1,918,036.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	17,414	1,323,115.72	
		SUN COMMUNITIES INC	5,690	787,666.70	
		UDR INC	16,160	631,694.40	
		VENTAS INC	20,225	797,067.25	
		VEREIT INC	64,364	419,009.64	
		VICI PROPERTIES INC	29,730	662,681.70	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	275,204.67	
		WELLTOWER INC	23,260	1,284,882.40	
		WEYERHAEUSER CO	46,708	1,016,366.08	
		WP CAREY INC	9,580	662,073.80	
米ドル小計			779,917	46,784,253.05	(5,017,143,297)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	4,700	230,723.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,760	99,304.40	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	158,270.00	

		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	36,622.30	
加ドル小計			22,650	524,919.70	(41,290,183)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	2,655	173,637.00	
		GECINA SA	2,350	274,010.00	
		ICADE	1,965	128,707.50	
		KLEPIERRE	10,512	193,473.36	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,700	441,518.00	
ユーロ小計			25,182	1,211,345.86	(146,185,218)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	49,131	202,861.89	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	211,494.26	
		SEGRO PLC	62,233	542,422.82	
英ポンド小計			145,498	956,778.97	(128,342,331)
豪ドル	投資証券	DEXUS	57,587	555,138.68	
		GOODMAN GROUP	93,372	1,378,170.72	
		GPT GROUP	120,435	514,257.45	
		LENDLEASE GROUP	28,927	354,934.29	
		MIRVAC GROUP	208,775	492,709.00	
		SCENTRE GROUP	341,471	781,968.59	
		STOCKLAND	151,600	547,276.00	
		VICINITY CENTRES	191,002	301,783.16	
豪ドル小計			1,193,169	4,926,237.89	(359,910,940)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	129,200	8,669,320.00	
香港ドル小計			129,200	8,669,320.00	(119,983,388)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	160,312	496,967.20	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	162,540	286,070.40	
		CAPITALAND MALL TRUST	132,400	271,420.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,400	247,656.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	136,800	258,552.00	
		SUNTEC REIT	91,400	134,358.00	
シンガポールドル小計			804,852	1,695,023.60	(130,279,513)

合計		5,943,134,870	
		(5,943,134,870)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 589銘柄	96.9%		68.9%
	投資証券 39銘柄		3.1%	2.2%
加ドル	株式 80銘柄	99.5%		3.4%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 238銘柄	99.4%		10.8%
	投資証券 5銘柄		0.6%	0.1%
英ポンド	株式 86銘柄	98.9%		4.9%
	投資証券 3銘柄		1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%		3.5%
スウェーデンクローナ	株式 35銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 55銘柄	93.1%		2.1%
	投資証券 8銘柄		6.9%	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 35銘柄	95.3%		1.1%
	投資証券 1銘柄		4.7%	0.1%
シンガポールドル	株式 15銘柄	85.7%		0.3%
	投資証券 6銘柄		14.3%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表



「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 6月30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	29,787,019,770円
負債総額	26,860,902円
純資産総額( - )	29,760,158,868円
発行済口数	35,639,860,153口
1口当たり純資産額( / )	0.8350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	126,285,378,094円
負債総額	210,301,497円
純資産総額( - )	126,075,076,597円
発行済口数	62,795,242,076口
1口当たり純資産額( / )	2.0077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	120,249,232,396円
負債総額	108,805,941円
純資産総額( - )	120,140,426,455円
発行済口数	66,984,699,051口
1口当たり純資産額( / )	1.7936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	42,922,334,683円
負債総額	284,674,641円
純資産総額（ - ）	42,637,660,042円
発行済口数	30,198,752,682口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4119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	155,323,421,297円
負債総額	1,959,663,740円
純資産総額（ - ）	153,363,757,557円
発行済口数	62,748,757,868口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4441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	32,326,696,329円
負債総額	9,841,002円
純資産総額（ - ）	32,316,855,327円
発行済口数	22,006,450,784口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4685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	234,853,310,199円
負債総額	152,541,306円
純資産総額（ - ）	234,700,768,893円
発行済口数	90,479,654,005口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5940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

2020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（2020年6月末現在）

###### ・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

###### ・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2020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、2020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	836	206,234
株式投資信託	783	176,005
単位型	270	10,907
追加型	513	165,097
公社債投資信託	53	30,228
単位型	40	1,394
追加型	13	28,834

### 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61期事業年度（2019年4月1日から2020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】

	第60期 (2019年3月31日)		第61期 (2020年3月31日)	
(単位：百万円)				
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	20,680		24,591
有価証券		1		19
前払費用		495		603
未収入金		38		14
未収委託者報酬		16,867		16,912
未収収益	3	618	3	1,412
関係会社短期貸付金		2,408		2,371
立替金		791		1,437
その他	2	869	2	1,316
流動資産合計		42,769		48,679
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	136	1	182
器具備品	1	137	1	135
有形固定資産合計		274		318
無形固定資産				
ソフトウェア		107		120
無形固定資産合計		107		120
投資その他の資産				
投資有価証券		16,755		17,826
関係会社株式		25,769		25,769
長期差入保証金		447		484

繰延税金資産	1,913	2,022
投資その他の資産合計	44,886	46,102
固定資産合計	45,268	46,540
資産合計	88,038	95,220

(単位：百万円)

	第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	354	554
未払金	6,112	5,881
未払収益分配金	7	8
未払償還金	71	71
未払手数料	3 5,299	5,202
その他未払金	734	599
未払費用	3 3,897	3 4,289
未払法人税等	2,382	1,439
未払消費税等	4 621	4 746
賞与引当金	2,680	2,718
役員賞与引当金	210	55
その他	3 172	42
流動負債合計	16,431	15,726
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,405	1,395
その他	629	695
固定負債合計	2,035	2,091
負債合計	18,466	17,818
<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	47,142	55,395
利益剰余金合計	47,142	55,395
自己株式	833	905
株主資本合計	68,891	77,073
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	493	60
繰延ヘッジ損益	185	389
評価・換算差額等合計	679	329
純資産合計	69,571	77,402
負債純資産合計	88,038	95,220

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	77,264	74,265
その他営業収益	3,063	2,994
営業収益合計	80,328	77,259
営業費用		
支払手数料	32,834	31,322
広告宣伝費	960	953
公告費	2	2
調査費	18,251	17,275
調査費	890	920
委託調査費	17,333	16,333
図書費	27	21
委託計算費	541	534
営業雑経費	794	1,058
通信費	128	116
印刷費	334	337
協会費	69	52
諸会費	19	10
その他	243	541
営業費用計	53,385	51,148
一般管理費		
給料	9,783	9,857
役員報酬	241	360
役員賞与引当金繰入額	210	55
給料・手当	6,589	6,675
賞与	61	64
賞与引当金繰入額	2,680	2,702
交際費	92	92
寄付金	13	29
旅費交通費	476	420
租税公課	428	440
不動産賃借料	888	901
退職給付費用	378	387
退職金	52	82
固定資産減価償却費	108	118
福利費	1,071	1,014
諸経費	3,106	3,229
一般管理費計	16,401	16,573
営業利益	10,540	9,538

	(単位：百万円)	
	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取利息	37	99



受取配当金	1	1,865	1	4,881
有価証券償還益		1		-
デリバティブ収益	1	142		223
時効成立分配金・償還金		21		1
為替差益		58		5
その他		48		145
営業外収益合計		2,176		5,357
営業外費用				
支払利息	1	286		185
有価証券償還損		-		0
時効成立後支払分配金・償還金		78		1
その他		24		12
営業外費用合計		388		199
経常利益		12,328		14,695
特別利益				
投資有価証券売却益		218		164
特別利益合計		218		164
特別損失				
投資有価証券売却損		176		19
投資有価証券評価損		-		21
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		180		-
特別損失合計		357		41
税引前当期純利益		12,189		14,818
法人税、住民税及び事業税		3,741		3,307
法人税等調整額		375		45
法人税等合計		3,366		3,353
当期純利益		8,823		11,465

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	160	75	75
当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	8,252	8,252	71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				3,212
当期純利益				11,465
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	553	204	349	349
当期変動額合計	553	204	349	7,831
当期末残高	60	389	329	77,402

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式</p> <p>総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>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)</p> <p>時価のないもの</p> <p>総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ</p> <p>時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table data-bbox="528 920 1031 992"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 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>
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>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>

（未適用の会計基準等）

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

（1）概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,281百万円</p> <p>器具備品 655百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,311百万円</p> <p>器具備品 707百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。</p>

<p>3 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 1,347百万円</p> <p>未収収益 127百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 350百万円</p> <p>未払費用 767百万円</p> <p>その他 162百万円</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>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468百万円に対して保証を行っております。</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>未収収益 151百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 623百万円</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>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365百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

## ( 損益計算書関係 )

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020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。</p> <p>受取配当金 1,831百万円</p> <p>デリバティブ収益 54百万円</p> <p>支払利息 75百万円</p>	<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。</p> <p>受取配当金 4,849百万円</p>

## ( 株主資本等変動計算書関係 )

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

## 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	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-

2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

#### 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
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

##### (2) 基準日が当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
2019年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

#### 第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

##### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

##### 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

##### 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	871,200	1,184,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	2,272,000	1,346,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,417,000	2,394,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,417,000	2,939,000	-
合計		15,088,300	-	7,224,600	7,863,700	-

- (注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
- 2 2011年度ストックオプション(1)1,184,700株、2016年度ストックオプション(1)881,000株及び2016年度ストックオプション(2)804,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)465,000株、2016年度ストックオプション(2)1,590,000株及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月12日 取締役会	普通株式	利益剰余金	2,862	14.64	2020年3月31日	2020年7月1日

##### (リース取引関係)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	853百万円	1年内	912百万円
1年超	6,704百万円	1年超	6,148百万円
合計	7,558百万円	合計	7,060百万円

##### (金融商品関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

##### 1 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりませぬ。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金及び借入金に関しては、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

2019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ぬ。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	20,680	20,680	-
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	-
(3) 未収収益	618	618	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,740	16,740	-
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	-
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	-
(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	(31)	(31)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	-
デリバティブ取引計	(158)	(158)	-



- ( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。  
 ( 2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万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、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債

権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシドマネの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	-
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	-
(3) 未収収益	1,412	1,412	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	-
(5) 有価証券及び投資有価証券			

その他有価証券	17,828	17,828	-
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	-
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	-
(8) デリバティブ取引( 2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	-
デリバティブ取引計	142	142	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち15百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、41百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち167百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	-	-	-
未収委託者報酬	16,912	-	-	-
未収収益	1,412	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

(有価証券関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

(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	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

### 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	5,381	4,912	469
	小計	5,381	4,912	469
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	12,447	13,003	556
	小計	12,447	13,003	556
合計		17,828	17,915	86

- (注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,230	164	19
合計	2,230	164	19

(デリバティブ取引関係)

第60期(2019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	2,407	-	3	3
	買建	-	-	-	-
合計		2,407	-	3	3

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

#### 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

##### (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	1,792	-	35	35
合計		1,792	-	35	35

#### (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

#### 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

##### 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル	投資有価証券	975	-	18

	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
合計			6,040	-	127

## (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61期(2020年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,913	-	41	41
	買建	-	-	-	-
合計		1,913	-	41	41

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

## 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,808	-	15	15
合計		1,808	-	15	15

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,427	-	20
	豪ドル		48	-	9
	シンガポールドル		944	-	58
	香港ドル		529	-	2
	人民元		2,017	-	76
	ユーロ		70	-	1
合計			7,038	-	167

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020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 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631

## (退職給付関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

## (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	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405
退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

## (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	0.1%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	31
退職給付の支払額	164
退職給付債務の期末残高	1,363

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

退職給付債務	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31
貸借対照表に計上された負債の額	1,395
退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の費用処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用	154

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

## (ストックオプション等関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日



権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日

権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	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	-	-
--------	---	---

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	-
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（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 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割  
又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開  
日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日

権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,171,500	75,900
付与	0	0
失効	1,171,500	75,900
権利確定	0	0
権利未確定残	-	-
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,055,900	3,618,000
付与	0	0
失効	871,200	2,272,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,184,700	1,346,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-

権利未行使残	-	-
--------	---	---

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

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

#### (税効果会計関係)

第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020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		繰延税金資産	
賞与引当金	820	賞与引当金	822
投資有価証券評価損	96	投資有価証券評価損	102
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	430	退職給付引当金	427
固定資産減価償却費	103	固定資産減価償却費	96
その他	761	その他	744
繰延税金資産小計	3,643	繰延税金資産小計	3,624
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,212	繰延税金資産合計	2,194
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	217	繰延ヘッジ利益	172
繰延ヘッジ利益	81	繰延税金負債合計	172
繰延税金負債合計	299	繰延税金資産の純額	2,022
繰延税金資産の純額	1,913		
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.8%	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参入されない項目	4.4%	受取配当金等永久に益金に参入されない項目	9.6%
その他	0.6%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%

## ( 関連当事者情報 )

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
							資金の貸付の返済(シンガポールドル貨建)(注1)	554 (SGD 6,800千) (注2)	-	-

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	貸付金利息 (シンガポールドル 貸建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期 貸付金	1,830 (USD 16,500 千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注3)	17 (USD 209 千)	未収収益	17 (USD 209 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
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000 千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD 千) (注 5)	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 (米国ドル 貸建) (注6)	5,364 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貸建) (注6)	5,526 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貸建) (注6)	65 (USD 593 千)	-	-

## (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。
- 取引金額554百万円 (SGD6,800千) の内訳は、貸付の返済554百万円 (SGD6,800千) であります。
- 融資枠5,000百万円 (若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 取引金額1,807百万円 (USD16,500千) の内訳は、貸付1,807百万円 (USD16,500千) であります。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 借入枠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。
- 取引金額5,364百万円 (USD50,000千) 及び5,526百万円 (USD50,000千) の内訳は、借入5,364百万円 (USD50,000千) 及び借入の返済5,526百万円 (USD50,000千) 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2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	26,768百万円
負債合計	5,586百万円
純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International 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(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	1,793 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122千)
							資金の貸付(円貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注2)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	1,526 (USD 14,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	2,700	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円

営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

## 関連情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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場合、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場合、記載しておりません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## ( 2 ) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	355円59銭	395円50銭
1株当たり当期純利益金額	45円08銭	58円61銭

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

## 2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	8,823	11,465
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)	8,823	11,465
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,677	195,599

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	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株
--	--	---

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	69,571	77,402
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)	69,571	77,402
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)	195,647	195,558

#### (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、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 (2020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 (2020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。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
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	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村證券株式会社 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	10,007百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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	26,490百万豪ドル (2019年9月末現在)	
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	
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	56,967百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	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。
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	
農林中央金庫	4,040,198百万円	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、余裕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。

名 称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	139,440百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
東京都信用農業協同組合連合会	78,204百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	194,885百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	54,858百万円	
新潟県信用農業協同組合連合会	56,296百万円	
石川県信用農業協同組合連合会	17,468百万円	
岐阜県信用農業協同組合連合会	70,118百万円	
静岡県信用農業協同組合連合会	111,302百万円	
愛知県信用農業協同組合連合会	198,402百万円	
三重県信用農業協同組合連合会	39,124百万円	
滋賀県信用農業協同組合連合会	34,697百万円	
大阪府信用農業協同組合連合会	140,690百万円	
兵庫県信用農業協同組合連合会	170,546百万円	
和歌山県信用農業協同組合連合会	51,799百万円	
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円	
徳島県信用農業協同組合連合会	32,546百万円	
高知県信用農業協同組合連合会	19,870百万円	
福岡県信用農業協同組合連合会	32,382百万円	
きたそらち農業協同組合	3,396百万円	
仙台農業協同組合	3,434百万円	
みやぎ亘理農業協同組合	1,554百万円	
みやぎ登米農業協同組合	6,459百万円	
新みやぎ農業協同組合	2,941百万円	
いしのまき農業協同組合	4,497百万円	

みやぎ仙南農業協同組合	4,041百万円
秋田しんせい農業協同組合	5,632百万円
山形農業協同組合	4,080百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,757百万円
山形おきたま農業協同組合	4,965百万円
鶴岡市農業協同組合	1,488百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,381百万円
ふくしま未来農業協同組合	15,932百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,215百万円
北つくば農業協同組合	3,382百万円
はが野農業協同組合	3,648百万円
那須南農業協同組合	1,157百万円
高崎市農業協同組合	2,001百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,545百万円
さいたま農業協同組合	8,181百万円
あさか野農業協同組合	871百万円
いるま野農業協同組合	5,963百万円
埼玉中央農業協同組合	2,335百万円
くまがや農業協同組合	2,768百万円
ほくさい農業協同組合	3,181百万円
越谷市農業協同組合	1,568百万円
南彩農業協同組合	2,847百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,437百万円
さいかつ農業協同組合	1,864百万円
ふかや農業協同組合	1,613百万円
横浜農業協同組合	12,402百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,516百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,454百万円
さがみ農業協同組合	5,363百万円
湘南農業協同組合	1,998百万円
秦野市農業協同組合	1,775百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,531百万円
厚木市農業協同組合	2,589百万円
相模原市農業協同組合	881百万円
神奈川つくい農業協同組合	850百万円
佐久浅間農業協同組合	6,627百万円
信州うえだ農業協同組合	4,273百万円
信州諏訪農業協同組合	6,454百万円
上伊那農業協同組合	8,124百万円
みなみ信州農業協同組合	4,519百万円
松本ハイランド農業協同組合	6,213百万円
塩尻市農業協同組合	1,568百万円
大北農業協同組合	3,263百万円

グリーン長野農業協同組合	3,699百万円
中野市農業協同組合	2,504百万円
ながの農業協同組合	12,921百万円
北越後農業協同組合	3,088百万円
新潟みらい農業協同組合	4,830百万円
越後中央農業協同組合	5,313百万円
にいがた南蒲農業協同組合	4,950百万円
越後ながおか農業協同組合	5,506百万円
十日町農業協同組合	2,815百万円
ひすい農業協同組合	1,264百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,498百万円
佐渡農業協同組合	2,505百万円
加賀農業協同組合	1,966百万円
小松市農業協同組合	1,744百万円
能美農業協同組合	1,249百万円
金沢中央農業協同組合	1,058百万円
金沢市農業協同組合	3,158百万円
はくい農業協同組合	1,340百万円
能登わかば農業協同組合	2,667百万円
おおぞら農業協同組合	1,217百万円
ぎふ農業協同組合	7,218百万円
西美濃農業協同組合	4,658百万円
いび川農業協同組合	2,073百万円
めぐみの農業協同組合	4,704百万円
陶都信用農業協同組合	1,607百万円
東美濃農業協同組合	2,624百万円
飛騨農業協同組合	6,368百万円
伊豆太陽農業協同組合	1,818百万円
三島函南農業協同組合	1,049百万円
伊豆の国農業協同組合	913百万円
あいら伊豆農業協同組合	915百万円
南駿農業協同組合	3,158百万円
御殿場農業協同組合	1,234百万円
富士市農業協同組合	1,492百万円
富士宮農業協同組合	945百万円
清水農業協同組合	2,981百万円
静岡市農業協同組合	1,902百万円
大井川農業協同組合	3,433百万円
ハイナン農業協同組合	857百万円
掛川市農業協同組合	746百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,579百万円
遠州中央農業協同組合	3,301百万円
とぴあ浜松農業協同組合	3,715百万円



三ヶ日町農業協同組合	297百万円
なごや農業協同組合	2,454百万円
尾張中央農業協同組合	2,118百万円
西春日井農業協同組合	157百万円
あいち尾東農業協同組合	1,192百万円
愛知北農業協同組合	747百万円
愛知西農業協同組合	1,617百万円
あいち知多農業協同組合	7,183百万円
あいち中央農業協同組合	3,468百万円
西三河農業協同組合	1,301百万円
あいち三河農業協同組合	1,114百万円
あいち豊田農業協同組合	1,809百万円
愛知東農業協同組合	971百万円
豊橋農業協同組合	2,515百万円
鈴鹿農業協同組合	1,628百万円
津安芸農業協同組合	2,189百万円
伊勢農業協同組合	4,367百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	2,846百万円
甲賀農業協同組合	2,478百万円
北大阪農業協同組合	1,887百万円
茨木市農業協同組合	1,237百万円
大阪泉州農業協同組合	2,009百万円
いずみの農業協同組合	2,884百万円
堺市農業協同組合	1,187百万円
大阪南農業協同組合	3,822百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,507百万円
大阪中河内農業協同組合	4,263百万円
北河内農業協同組合	2,635百万円
大阪市農業協同組合	1,919百万円
兵庫南農業協同組合	3,763百万円
みのり農業協同組合	4,439百万円
兵庫西農業協同組合	12,416百万円
たじま農業協同組合	4,526百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,286百万円
淡路日の出農業協同組合	1,879百万円
奈良県農業協同組合	9,389百万円
わかやま農業協同組合	4,466百万円
ながみね農業協同組合	2,006百万円
紀の里農業協同組合	3,586百万円
紀北川上農業協同組合	4,269百万円
ありだ農業協同組合	2,098百万円
紀州農業協同組合	3,667百万円
紀南農業協同組合	4,717百万円

みくまの農業協同組合	1,002百万円
鳥取いなば農業協同組合	6,061百万円
鳥取中央農業協同組合	3,875百万円
鳥取西部農業協同組合	5,133百万円
島根県農業協同組合	22,681百万円
広島市農業協同組合	6,724百万円
広島中央農業協同組合	3,067百万円
山口県農業協同組合	2,362百万円
徳島市農業協同組合	3,026百万円
香川県農業協同組合	26,469百万円
越智今治農業協同組合	6,417百万円
高知市農業協同組合	4,109百万円
高知県農業協同組合	1,565百万円
福岡八女農業協同組合	3,556百万円
宮崎中央農業協同組合	5,828百万円
延岡農業協同組合	1,469百万円
沖縄県農業協同組合	22,037百万円

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

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

2020年6月8日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 貞 廣 篤 典指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記は、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

2020年7月22日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2019年12月17日から2020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。

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2020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。

### 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。