

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年9月25日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）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】**

全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）  
・愛称として「ワールドクルーズ」という名称を用いることがあります。

**（２）【内国投資信託受益証券の形態等】**

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

**（３）【発行（売出）価額の総額】**

5兆円を上限とします。

**（４）【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

**（５）【申込手数料】**

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

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

**（６）【申込単位】**

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

**（７）【申込期間】**

2018年9月26日から2018年12月20日までとします。

当ファンドは、2018年12月25日をもって信託期間が終了いたします。

**（８）【申込取扱場所】**

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

( 9 ) 【払込期日】

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

( 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

各地域のGDP比率をもとに株式および債券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。

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			ファミリーファンド	あり ( )
一般	年6回 (隔月)	北米		
公債		欧州		
社債				
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))	その他 ( )	アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年12回(毎月)

目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

**1 日本、海外先進国および新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。**

- 日本、海外先進国および新興国への資産配分比率は、各地域のGDP比率に基づいて決定し、年に一度(原則として6月)見直しを行ないます。
  - 各地域の経済成長度合いを反映した資産配分により、世界経済全体の成長ペースにあわせた資産の長期的な成長をめざします。
- ※当ファンドでは海外先進国をIMFの定義する先進国から日本を除いたものと定義し、新興国を日本と海外先進国以外の国と定義しています。

**2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。**

- 分散投資効果を勘案し、「株式」と「債券」の資産配分は50%ずつを基本とします。
  - 各資産への投資は、各資産を主要投資対象とするマザーファンドを通じて行ないます。
- ※各マザーファンドは各市場全体の値動きを表す指数に連動する投資成果をめざす運用(インデックス運用)を行ないます。

**3 毎月安定的な分配を行なうことをめざします。**

- インカム収益などを原資として、毎月の決算時に、安定した分配を行なうことをめざします。
  - 年4回(3月、6月、9月および12月)の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、キャピタル収益などを積極的に分配する場合があります。
- ※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もあります。

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

## 1 日本・海外先進国・新興国の経済規模に応じた資産配分を行ないます。

各地域の資産配分比率は各地域のGDP比率に基づいて決定します。



【各地域のGDP比率】  
 (IMFの2018年予想の値をもとに)  
 日興アセットマネジメントが作成。  
 ※端数処理の関係で合計が100%にならない場合があります。

## 2 資産の安定成長をめざすため、株式と債券に分散投資を行ないます。

分散投資効果を勘案し、「株式」と「債券」の資産配分比率は50%ずつを基本とします。

【株式部分:50%】

【債券部分:50%】



### 【ワールドクルーズの資産配分比率】

- 上記は2018年6月末現在の目標とする資産配分比率であり、将来変更になる場合があります。
- 各マザーファンドへの実際の資産配分比率は時価の影響などにより、必ずしも上記数値とは一致しません。

## 投資対象国・地域

日本および、海外先進国、新興国など計51の国や地域にグローバル分散投資を行ないます。

### 日本

### 海外先進国

- 【欧州】 アイルランド、イギリス、イタリア、オーストリア、オランダ、スイス、スウェーデン、スペイン、デンマーク、ドイツ、ノルウェー、フィンランド、フランス、ベルギー、ポルトガル
- 【中東】 イスラエル
- 【北米】 アメリカ、カナダ
- 【アジア】 シンガポール、香港
- 【オセアニア】 オーストラリア、ニュージーランド
- (22の国と地域)

### 新興国

- 【欧州】 チェコ、ハンガリー、ポーランド、ルーマニア、ギリシャ
- 【中東・ロシア】 トルコ、ロシア、カタール、アラブ首長国連邦
- 【北米・南米】 メキシコ、コロンビア、チリ、ブラジル、ペルー、アルゼンチン、ウルグアイ、ドミニカ共和国
- 【アジア】 インド、インドネシア、タイ、フィリピン、マレーシア、韓国、台湾、中国、パキスタン
- 【アフリカ】 エジプト、南アフリカ
- (28の国と地域)

●上図は2018年6月末現在の当ファンドが連動をめざす各指数をもとに作成した投資対象国・地域であり、将来変更になる可能性があります。

## (参考)グローバル分散投資の意義 ~ワールドクルーズをめざすもの~

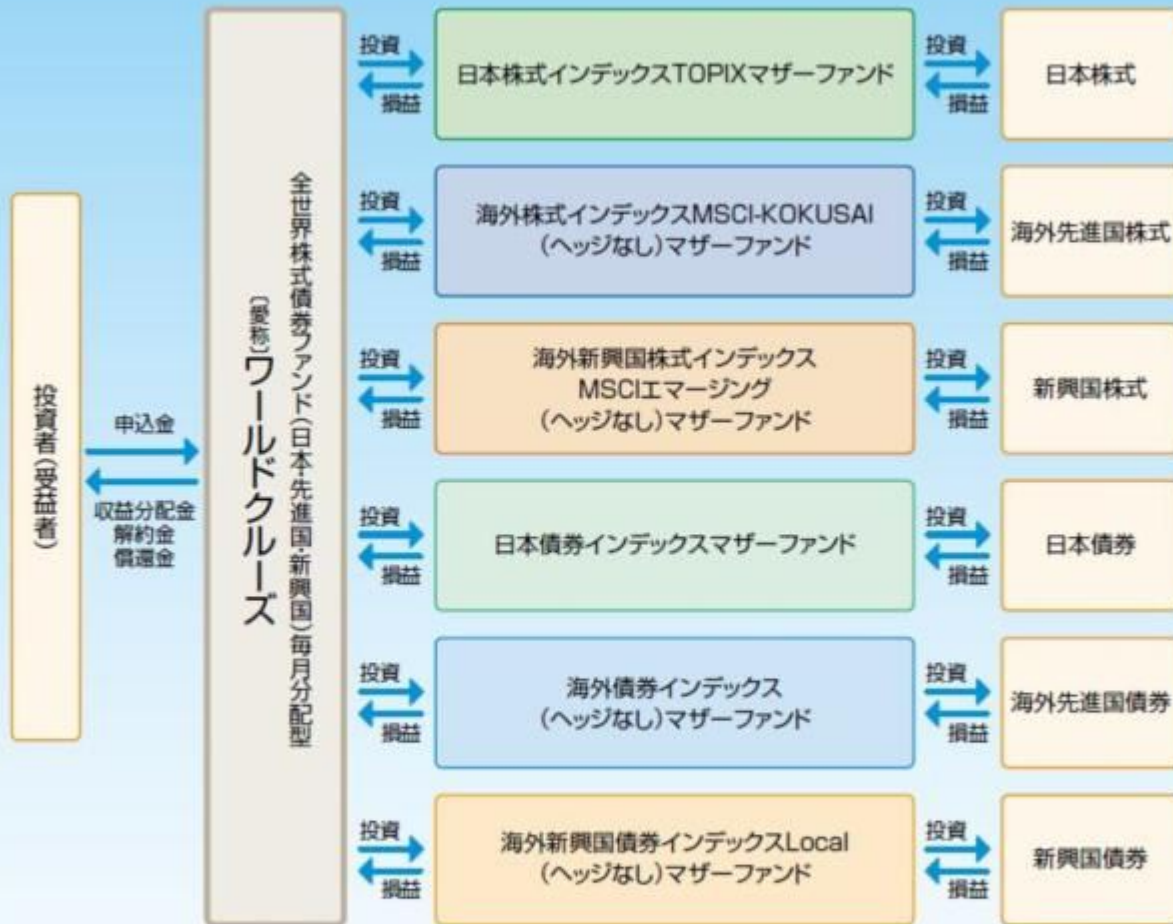
世界の経済成長に伴なう

- ①株価の長期的な上昇が期待できます。
- ②相対的に高い利子収入が期待できます。
- ③通貨価値の上昇による為替差益の獲得が期待できます。



## ファンドの仕組み

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



(主な投資制限) ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。  
・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。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。  
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 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。

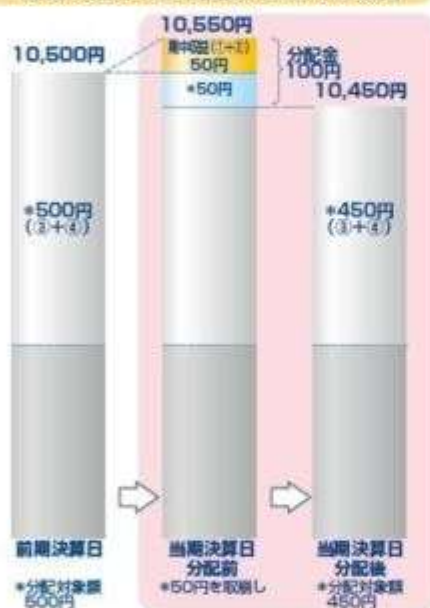
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 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幅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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2008年 3月31日

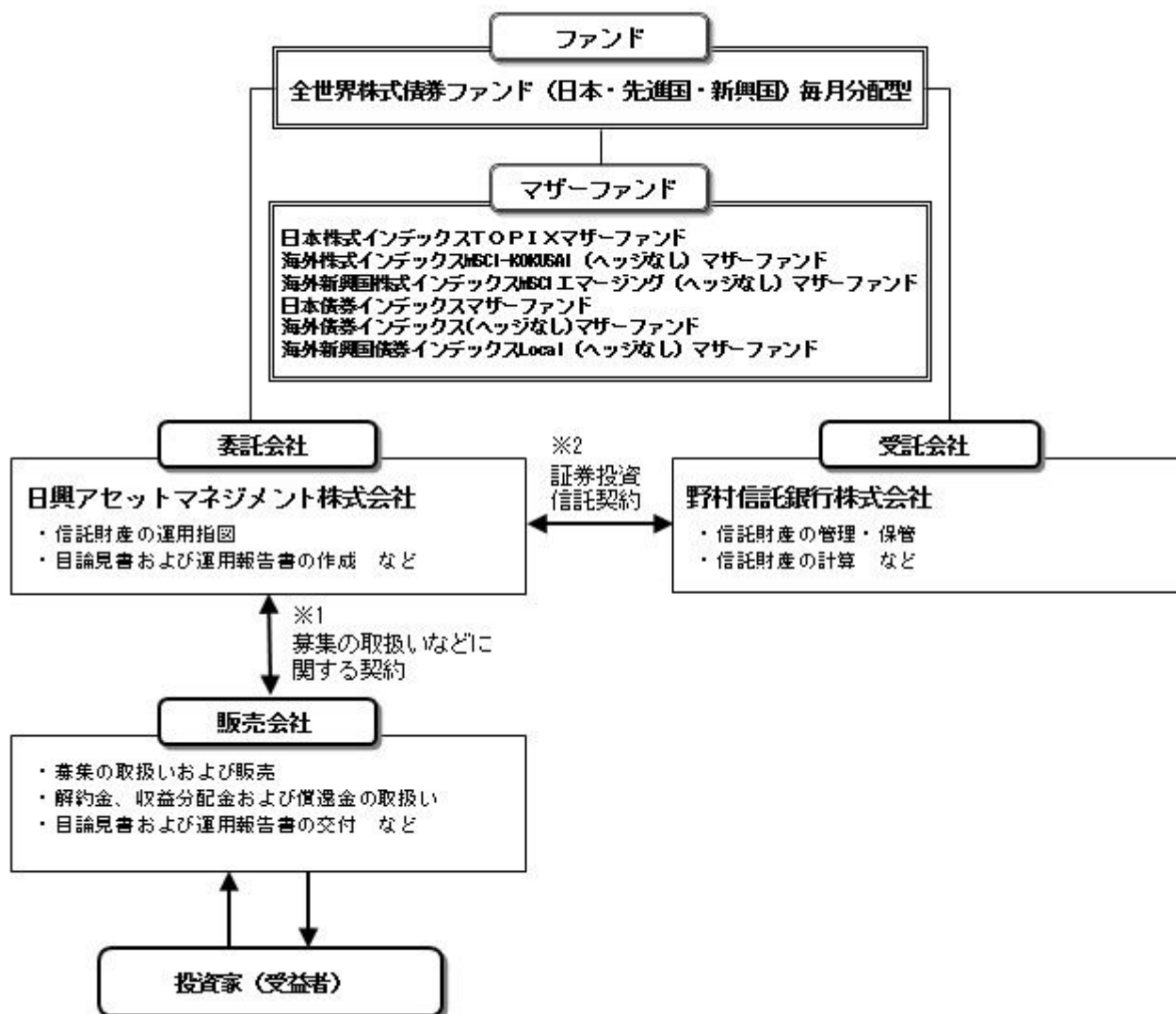
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

2018年12月25日

・信託終了（償還）予定

## （３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 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。
- 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2018年6月末現在）

- 資本金  
17,363百万円
- 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
- 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

## 2【投資方針】

### （１）【投資方針】

- ・主として、「投資対象」に掲げる各マザーファンド受益証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざします。各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。
- ・各マザーファンド受益証券が実質的に保有する株式または債券の信託財産の純資産総額に対する割合は、50%を基本とします。
- ・各マザーファンド受益証券への投資比率は、日本、海外先進国、新興国のGDP比率をもとに決定します。なお、当該投資比率は各地域のGDP比率に基づいて、毎年見直すことを原則とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

### （２）【投資対象】

＜全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型＞

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（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「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1）有価証券

2）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）

3）金銭債権

4）約束手形

5）為替手形

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

1）証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

3）証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」

4）証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

5）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

6）証券投資信託「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」

7）株券または新株引受権証券

8）国債証券

9）地方債証券

10）特別の法律により法人の発行する債券

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

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

13）コマーシャル・ペーパー

14）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

15）外国または外国の者の発行する証券または証書で、7）～14）の証券または証書の性質を有するもの

- 16) 投資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。)
- 17) 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18)に定めるもの以外のもの
- 18) 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
- 19) 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。)
- 20) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 21) 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。)
- 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23) 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。)
- 24) 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
- 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引
    - 4) 金利先渡取引
    - 5) 為替先渡取引
    - 6) 有価証券の貸付
    - 7) 公社債の空売
    - 8) 公社債の借入
    - 9) 外国為替予約取引
    - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券

- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
  - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
  - 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  - 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 有価証券の貸付
      - 6) 公社債の空売
      - 7) 公社債の借入
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド >  
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。))に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
  - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引
    - 4) 金利先渡取引
    - 5) 為替先渡取引
    - 6) 有価証券の貸付
    - 7) 公社債の空売
    - 8) 公社債の借入
    - 9) 外国為替予約取引

< 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド >

新興国の株式(DR(預託証券)およびカンントリーファンドなどを含みます。)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17条、第18条および第19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。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

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



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

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

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

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

#### <海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券

- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)
  - 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 6) コマーシャル・ペーパー
  - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
  - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
  - 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 先物取引等
      - 2) スワップ取引
      - 3) 金利先渡取引
      - 4) 為替先渡取引
      - 5) 有価証券の貸付
      - 6) 公社債の空売
      - 7) 公社債の借入
      - 8) 外国為替予約取引
- < 海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド >  
新興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15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
  - 1) 国債証券
  - 2) 地方債証券
  - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含

みます。)に限ります。)

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

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

### ファンドに係る費用

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

### その他

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

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

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

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

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

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

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

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

#### < 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・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いません。</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、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（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（2006年5月17日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

\* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。  
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

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いません。

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

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

#### < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</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。

#### < 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド >

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	主として新興国の債券に投資し、JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。



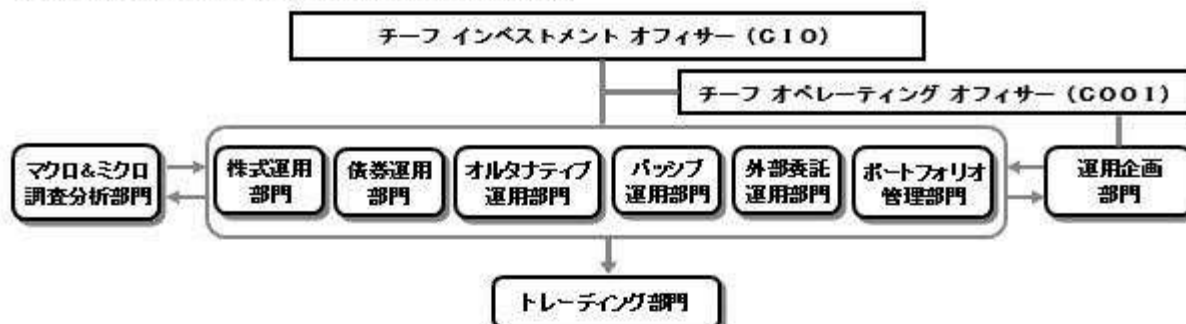
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2008年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

\* J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバースファイドは、J Pモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

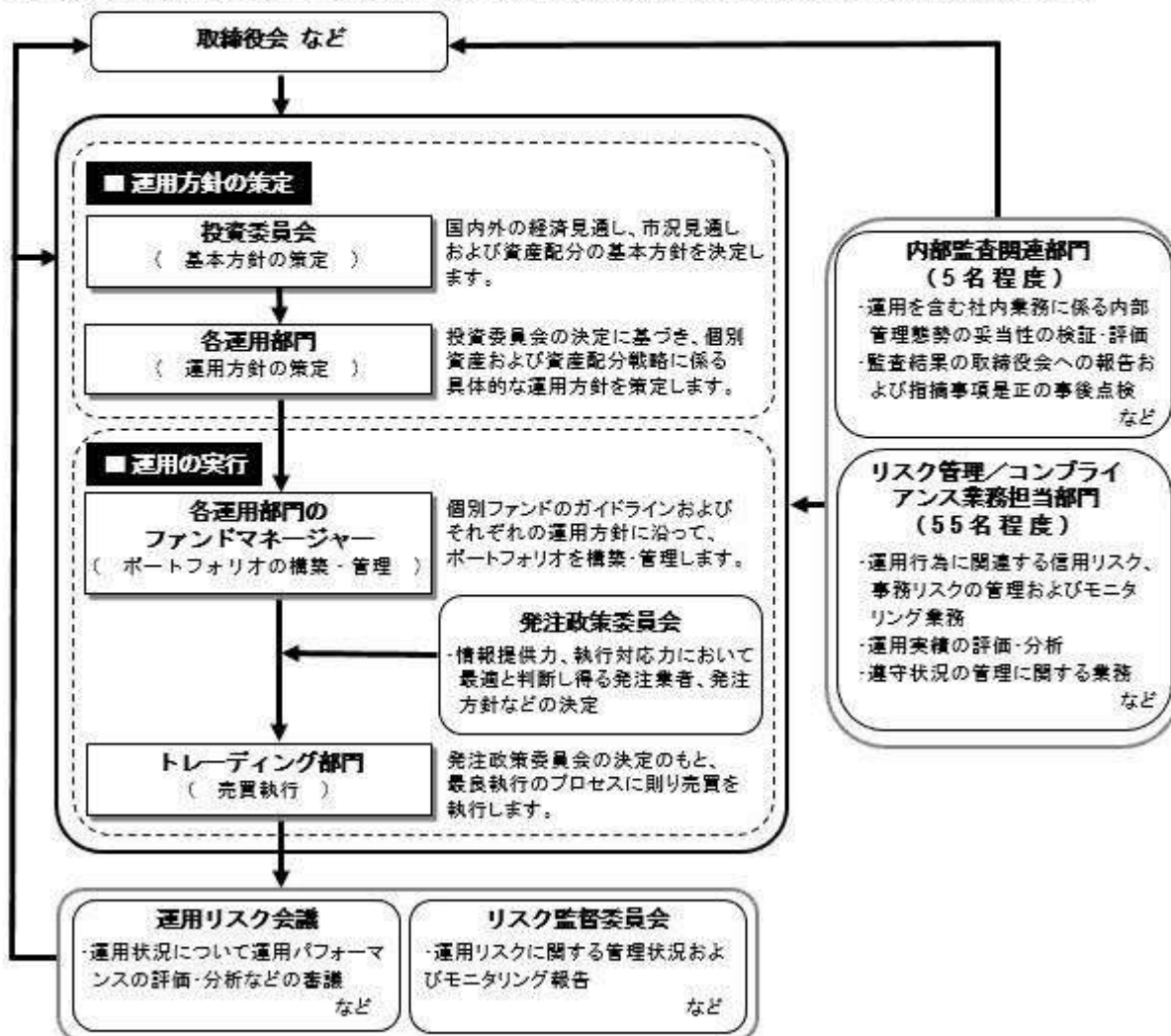
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### （3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行なっております。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なっており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

##### 1) 分配対象額の範囲

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

##### 2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額

を付加して分配を行なう場合があります。

### 3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

#### <分配金再投資コース>

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。

#### <分配金受取りコース>

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

### <全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みません。以下同じ。)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。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができます。
- 3) 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額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を超えないものとします。

- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ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
- 八) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
  - 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
  - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

できます。

- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

#### < 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(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。以下同じ。)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。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所におけ

る通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマ

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

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

#### <海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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



る外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

< 海外新興国債券インデックスLocal (ヘッジなし) マザーファンド >

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 流動性リスク

- ・ 市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・ 一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

#### カントリー・リスク

- ・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

#### <その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

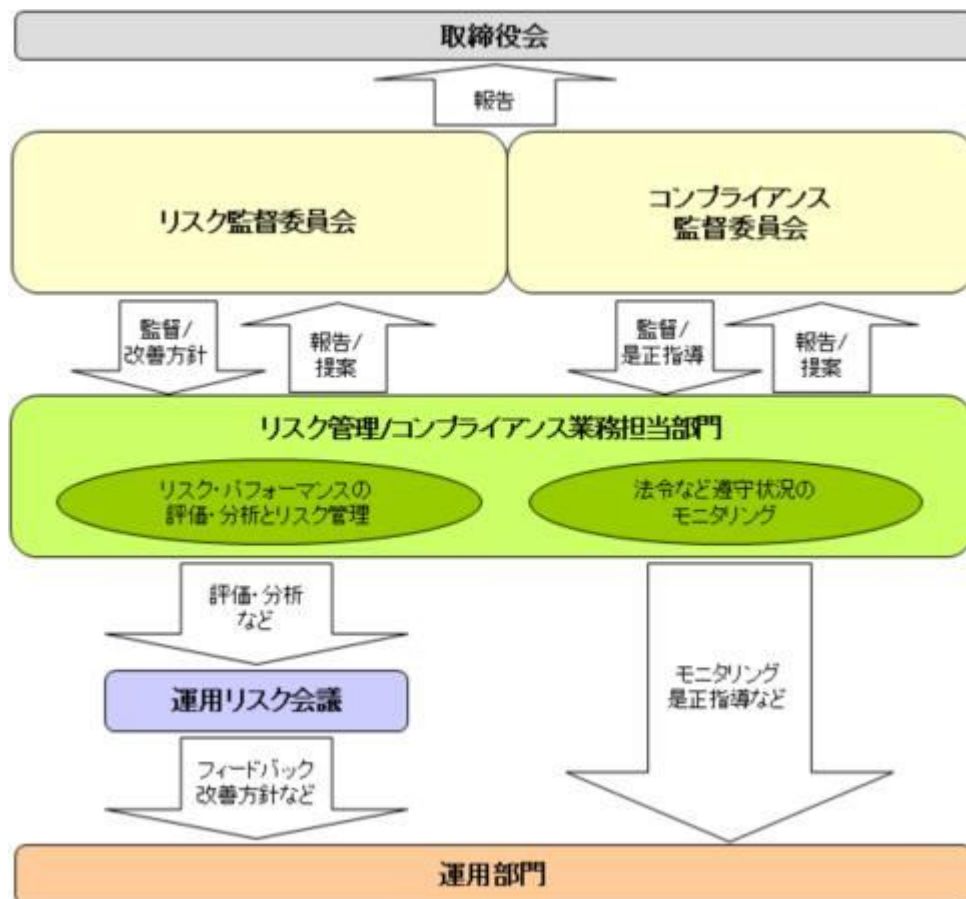
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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かなどのモニタリングを行なっています。

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	8.5%	18.1%	18.2%	11.7%	2.2%	6.7%	4.0%
最大値	32.7%	65.0%	57.1%	37.2%	9.3%	30.4%	24.1%
最小値	-17.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株 ----- 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

先進国株 --- MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

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

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

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(ルディパーシファイド(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・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

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

### 4【手数料等及び税金】

#### (1)【申込手数料】

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

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

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

#### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

#### (3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.134%（税抜1.05%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.05%	0.50%	0.50%	0.05%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

#### （４）【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかると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。

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

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（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。

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

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

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。

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるもの）に限り、）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.54（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は4：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

##### < 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

- ・ 組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・ 信託事務の処理に要する諸費用
- ・ 信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異

なりますので、表示することができません。

## （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### １）収益分配金に対する課税

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

### ２）解約金および償還金に対する課税

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

<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。

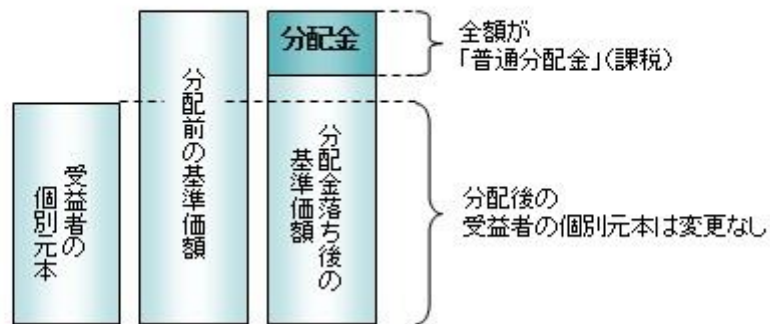
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。



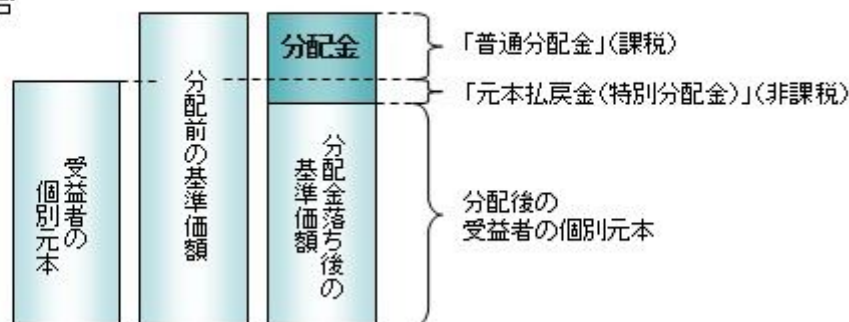
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2018年9月25日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型】

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	216,213,580	98.80
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,632,835	1.20
合計(純資産総額)		218,846,415	100.00

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
------	----	-----	----------	---------	---------	---------	---------	---------

日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	26,556,495	2.2124	58,753,590	2.2253	59,096,168	27.00
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	24,285,897	2.4323	59,070,588	2.4092	58,509,583	26.74
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	34,866,743	1.2468	43,471,856	1.2430	43,339,361	19.80
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド	24,089,743	1.8008	43,380,809	1.7522	42,210,047	19.29
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	4,677,040	1.3968	6,532,890	1.3968	6,532,889	2.99
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	4,206,764	1.5469	6,507,444	1.5512	6,525,532	2.98

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.80
合計	98.80

### 【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2特定期間末 (2008年12月25日)	136	137	0.6665	0.6715
第3特定期間末 (2009年6月25日)	207	208	0.7365	0.7395
第4特定期間末 (2009年12月25日)	245	246	0.7965	0.7995
第5特定期間末 (2010年6月25日)	251	252	0.7402	0.7422
第6特定期間末 (2010年12月27日)	261	261	0.7528	0.7548
第7特定期間末 (2011年6月27日)	268	269	0.7427	0.7447
第8特定期間末 (2011年12月26日)	254	254	0.6637	0.6657
第9特定期間末 (2012年6月25日)	264	265	0.6832	0.6852
第10特定期間末 (2012年12月25日)	277	278	0.7710	0.7730
第11特定期間末 (2013年6月25日)	290	291	0.8368	0.8388
第12特定期間末 (2013年12月25日)	254	255	0.9506	0.9526
第13特定期間末 (2014年6月25日)	243	244	0.9635	0.9655
第14特定期間末 (2014年12月25日)	251	252	1.0636	1.0656

第15特定期間末	(2015年 6月25日)	241	241	1.0808	1.0828
第16特定期間末	(2015年12月25日)	214	214	0.9573	0.9593
第17特定期間末	(2016年 6月27日)	191	192	0.8253	0.8273
第18特定期間末	(2016年12月26日)	218	219	0.9447	0.9467
第19特定期間末	(2017年 6月26日)	229	230	0.9813	0.9833
第20特定期間末	(2017年12月25日)	236	237	1.0478	1.0498
第21特定期間末	(2018年 6月25日)	222	223	0.9825	0.9845
	2017年 6月末日	230		0.9866	
	7月末日	230		0.9942	
	8月末日	232		1.0020	
	9月末日	234		1.0203	
	10月末日	235		1.0297	
	11月末日	235		1.0330	
	12月末日	238		1.0526	
	2018年 1月末日	239		1.0546	
	2月末日	231		1.0192	
	3月末日	227		0.9972	
	4月末日	231		1.0109	
	5月末日	225		0.9847	
	6月末日	218		0.9757	

(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2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	0.0300
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	0.0220
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	0.0180
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	0.0140
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	0.0120
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.0120
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	0.0120
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	0.0120
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	0.0120
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	0.0120
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	0.0120
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	0.0120
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	0.0120
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	0.0120
第16特定期間	2015年 6月26日～2015年12月25日	0.0120
第17特定期間	2015年12月26日～2016年 6月27日	0.0120

第18特定期間	2016年 6月28日～2016年12月26日	0.0120
第19特定期間	2016年12月27日～2017年 6月26日	0.0120
第20特定期間	2017年 6月27日～2017年12月25日	0.0120
第21特定期間	2017年12月26日～2018年 6月25日	0.0120

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	33.52
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	13.80
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	10.59
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	5.31
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	3.32
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	0.25
第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	9.02
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	4.75
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	14.61
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	10.09
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	15.03
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	2.62
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	11.63
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	2.75
第16特定期間	2015年 6月26日～2015年12月25日	10.32
第17特定期間	2015年12月26日～2016年 6月27日	12.54
第18特定期間	2016年 6月28日～2016年12月26日	15.92
第19特定期間	2016年12月27日～2017年 6月26日	5.14
第20特定期間	2017年 6月27日～2017年12月25日	8.00
第21特定期間	2017年12月26日～2018年 6月25日	5.09

(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2特定期間	2008年 6月26日～2008年12月25日	150,398,994	13,045,092
第3特定期間	2008年12月26日～2009年 6月25日	79,936,680	3,811,962
第4特定期間	2009年 6月26日～2009年12月25日	41,895,256	15,332,859
第5特定期間	2009年12月26日～2010年 6月25日	48,450,268	16,434,622
第6特定期間	2010年 6月26日～2010年12月27日	27,295,398	20,486,733
第7特定期間	2010年12月28日～2011年 6月27日	28,082,441	13,729,140

第8特定期間	2011年 6月28日～2011年12月26日	49,606,430	28,118,385
第9特定期間	2011年12月27日～2012年 6月25日	30,543,945	26,331,654
第10特定期間	2012年 6月26日～2012年12月25日	22,027,047	48,957,699
第11特定期間	2012年12月26日～2013年 6月25日	28,054,964	40,966,320
第12特定期間	2013年 6月26日～2013年12月25日	14,911,733	94,240,960
第13特定期間	2013年12月26日～2014年 6月25日	11,094,896	26,074,445
第14特定期間	2014年 6月26日～2014年12月25日	9,306,266	25,282,765
第15特定期間	2014年12月26日～2015年 6月25日	9,511,934	23,402,537
第16特定期間	2015年 6月26日～2015年12月25日	9,228,365	8,691,229
第17特定期間	2015年12月26日～2016年 6月27日	14,202,130	5,304,043
第18特定期間	2016年 6月28日～2016年12月26日	8,626,944	9,691,734
第19特定期間	2016年12月27日～2017年 6月26日	9,351,042	6,719,832
第20特定期間	2017年 6月27日～2017年12月25日	7,906,032	15,927,991
第21特定期間	2017年12月26日～2018年 6月25日	7,195,648	6,351,057

(参考)

#### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	28,793,146,350	99.25
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		216,710,499	0.75
合計(純資産総額)		29,009,856,849	100.00

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	103,830,000	0.36

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	141,600	7,035.17	996,181,202	7,170.00	1,015,272,000	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	804,400	765.54	615,805,680	631.10	507,656,840	1.75
日本	株式	ソニー	電気機器	78,000	4,352.19	339,471,493	5,664.00	441,792,000	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	82,100	5,344.83	438,810,726	5,036.00	413,455,600	1.43
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	51,800	10,014.09	518,730,040	7,973.00	413,001,400	1.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	87,000	4,522.72	393,476,673	4,306.00	374,622,000	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,700	62,073.94	353,821,464	62,560.00	356,592,000	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	104,800	3,517.88	368,674,774	3,253.00	340,914,400	1.18
日本	株式	KDDI	情報・通信業	100,700	3,002.23	302,324,561	3,031.00	305,221,700	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,561,200	204.06	318,588,490	186.50	291,163,800	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	85,900	2,739.88	235,356,542	3,066.00	263,369,400	0.91
日本	株式	任天堂	その他製品	7,200	42,548.53	306,349,480	36,200.00	260,640,000	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	80,500	2,689.36	216,493,770	3,078.00	247,779,000	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	11,100	25,084.55	278,438,520	22,005.00	244,255,500	0.84
日本	株式	花王	化学	28,600	7,193.76	205,741,740	8,450.00	241,670,000	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,400	20,618.48	214,432,234	22,960.00	238,784,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	14,000	14,741.86	206,386,077	16,625.00	232,750,000	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	48,100	4,559.55	219,314,450	4,831.00	232,371,100	0.80
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	82,200	2,706.15	222,445,821	2,822.50	232,009,500	0.80
日本	株式	キヤノン	電気機器	62,700	4,154.71	260,500,512	3,631.00	227,663,700	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,200	17,229.57	210,200,866	18,620.00	227,164,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	43,300	4,883.71	211,465,056	5,193.00	224,856,900	0.78
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	72,300	3,744.85	270,752,954	3,095.00	223,768,500	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	20,900	10,830.68	226,361,388	10,615.00	221,853,500	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	280,000	857.97	240,234,160	781.60	218,848,000	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	15,900	12,522.37	199,105,755	13,270.00	210,993,000	0.73
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	42,900	6,254.44	268,315,567	4,678.00	200,686,200	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	133,100	1,699.81	226,245,514	1,493.50	198,784,850	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	20,100	11,293.76	227,004,576	9,873.00	198,447,300	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	114,500	1,522.88	174,369,760	1,689.00	193,390,500	0.67

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.29
		建設業	3.15
		食料品	4.46
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.36

医薬品	4.71
石油・石炭製品	0.76
ゴム製品	0.81
ガラス・土石製品	0.99
鉄鋼	1.02
非鉄金属	0.84
金属製品	0.62
機械	5.11
電気機器	13.53
輸送用機器	8.55
精密機器	1.72
その他製品	2.07
電気・ガス業	1.75
陸運業	4.35
海運業	0.19
空運業	0.57
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.46
卸売業	4.76
小売業	5.00
銀行業	6.61
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	2.24
その他金融業	1.20
不動産業	2.41
サービス業	4.59
合 計	99.25

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2018年09月	買建	6	日本円	104,053,240	103,830,000	0.36

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

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

以下の運用状況は2018年6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
出資金	アメリカ	8,774,911	0.01
株式	アメリカ	51,977,485,169	61.54
	カナダ	3,137,461,413	3.71
	モーリシャス	3,255,837	0.00
	ドイツ	3,073,416,337	3.64
	イタリア	634,111,766	0.75
	フランス	3,153,871,162	3.73
	オランダ	1,532,635,951	1.81
	スペイン	992,803,741	1.18
	ベルギー	349,659,294	0.41
	オーストリア	77,965,175	0.09
	ルクセンブルク	107,250,989	0.13
	フィンランド	335,034,161	0.40
	アイルランド	1,233,595,887	1.46
	ポルトガル	55,104,090	0.07
	イギリス	5,427,875,664	6.43
	スイス	2,761,162,484	3.27
	スウェーデン	809,335,589	0.96
	ノルウェー	237,553,549	0.28
	デンマーク	535,066,740	0.63
	ケイマン	215,686,080	0.26
	オーストラリア	2,069,907,501	2.45
	バミューダ	223,280,406	0.26
	ニュージーランド	69,666,948	0.08
	香港	882,505,018	1.04
	シンガポール	395,839,198	0.47
	イスラエル	171,043,779	0.20
	ジャージー	399,774,467	0.47
	英ヴァージン諸島	21,983,222	0.03
	アラブ首長国連邦	10,820,537	0.01
	マン島	16,541,096	0.02
	小計	80,911,693,250	95.80
投資証券	アメリカ	1,576,682,144	1.87
	カナダ	15,093,181	0.02
	フランス	117,222,682	0.14
	イギリス	72,599,155	0.09
	オーストラリア	182,822,872	0.22
	香港	46,017,940	0.05



	シンガポール	33,951,367	0.04
	小計	2,044,389,341	2.42
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,494,172,817	1.77
合計（純資産総額）		84,459,030,319	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,803,681,180	2.14
	買建	ドイツ	460,322,508	0.55

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,800,581,500	2.13

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	104,912	17,320.51	1,817,129,618	20,505.16	2,151,238,395	2.55
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	151,184	8,744.05	1,321,961,321	10,902.56	1,648,292,661	1.95
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,505	110,029.86	935,803,993	188,078.28	1,599,605,797	1.89
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	49,560	18,915.32	937,443,326	21,691.26	1,075,019,054	1.27
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	70,940	11,182.22	793,267,140	11,598.96	822,830,378	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,512	108,073.88	703,777,148	123,165.87	802,056,203	0.95
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	87,591	9,175.24	803,669,057	9,060.96	793,658,880	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,170	110,024.76	678,852,826	124,554.26	768,499,792	0.91
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	55,511	15,681.15	870,476,659	13,485.88	748,614,685	0.89
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	201,289	3,058.64	615,670,949	3,169.18	637,921,435	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	96,710	6,113.58	591,245,197	5,928.26	573,322,044	0.68
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	39,541	13,087.17	517,479,936	13,890.45	549,242,537	0.65

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	37,342	12,125.52	452,791,456	14,673.07	547,922,138	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	26,380	20,908.00	551,553,056	20,680.92	545,562,896	0.65
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	64,403	9,019.67	580,893,823	8,460.14	544,858,654	0.65
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	20,020	23,026.37	460,988,127	27,071.24	541,966,345	0.64
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	149,007	3,695.54	550,661,369	3,558.28	530,209,015	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	96,672	4,532.25	438,141,777	5,444.09	526,291,552	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	24,180	18,401.04	444,937,209	21,578.51	521,768,454	0.62
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	123,260	3,996.37	492,592,732	4,019.23	495,410,832	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	85,337	5,372.65	458,486,385	5,622.06	479,770,110	0.57
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	99,420	3,810.31	378,821,398	4,746.58	471,905,739	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	52,049	9,586.66	498,976,160	8,627.64	449,060,399	0.53
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	11,542	28,842.15	332,896,139	36,992.21	426,964,099	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	413,591	1,070.85	442,897,600	1,026.29	424,468,368	0.50
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	19,340	16,219.47	313,684,595	21,787.43	421,368,974	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	83,812	5,080.24	425,785,825	4,805.17	402,731,227	0.48
アメリカ	株式	NETFLIX INC	小売	8,970	21,864.74	196,126,746	43,709.72	392,076,249	0.46
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	53,017	8,140.16	431,567,159	7,392.91	391,950,185	0.46
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	55,743	6,883.48	383,705,881	6,665.56	371,558,423	0.44

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
出資金			0.01
株式	国外	エネルギー	7.14
		素材	4.71
		資本財	7.01
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.38
		耐久消費財・アパレル	1.83
		消費者サービス	1.81
		メディア	1.98
		小売	4.85

	食品・生活必需品小売り	1.47
	食品・飲料・タバコ	4.78
	家庭用品・パーソナル用品	1.84
	ヘルスケア機器・サービス	4.66
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.69
	銀行	8.77
	各種金融	4.35
	保険	3.74
	不動産	0.55
	ソフトウェア・サービス	11.50
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.29
	電気通信サービス	2.33
	公益事業	3.05
	半導体・半導体製造装置	3.05
投資証券		2.42
合計		98.23

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1809	買建	120	米ドル	16,518,850	1,825,993,679	16,317,000	1,803,681,180	2.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1809	買建	120	ユーロ	3,638,570	465,409,489	3,598,800	460,322,508	0.55

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	12,900,000.00	1,416,125,510	1,423,264,500	1.69
	ユーロ	買建	2,950,000.00	381,037,090	377,317,000	0.45

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2018年6月29日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	44,704,034	0.28
	メキシコ	434,338,701	2.68
	ブラジル	883,189,323	5.45
	チリ	171,213,968	1.06
	コロンビア	76,004,204	0.47
	ペルー	62,706,059	0.39
	オランダ	9,069,254	0.06
	ルクセンブルク	8,876,789	0.05
	ギリシャ	46,140,206	0.28
	トルコ	113,017,087	0.70
	チェコ	26,372,813	0.16
	ハンガリー	41,817,893	0.26
	ポーランド	164,789,294	1.02
	ロシア	520,111,828	3.21
	ケイマン	1,628,809,501	10.05
	バミューダ	110,094,750	0.68
	香港	645,909,430	3.98
	シンガポール	3,392,168	0.02
	マレーシア	356,980,836	2.20
	タイ	332,385,003	2.05
	フィリピン	141,879,992	0.88
	インドネシア	285,071,348	1.76
	韓国	2,222,777,809	13.71
	台湾	1,723,815,142	10.63
	中国	2,479,947,122	15.30
	インド	1,316,147,190	8.12
	パキスタン	9,714,003	0.06
	カタール	124,121,634	0.77
	エジプト	20,795,343	0.13
	南アフリカ	919,346,785	5.67
	アラブ首長国連邦	98,555,536	0.61
	小計	15,022,095,045	92.66
投資信託受益証券	香港	54,781,920	0.34
投資証券	メキシコ	13,781,157	0.09
	トルコ	2,859,545	0.02
	南アフリカ	42,775,844	0.26
	小計	59,416,546	0.37
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,075,446,703	6.63
合計（純資産総額）		16,211,740,214	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,120,274,262	6.91

(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		91,814,000	0.57

(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 （％）
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	152,200	5,607.82	853,510,204	5,340.11	812,764,742	5.01
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ソフトウェア・サービス	30,920	21,733.26	671,992,690	20,823.52	643,863,399	3.97
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	128,650	4,860.96	625,362,504	4,623.84	594,857,016	3.67
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	661,355	832.10	550,316,803	765.32	506,148,209	3.12
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	11,785	24,862.00	292,998,670	26,239.99	309,238,358	1.91
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,559,920	115.95	296,846,269	99.75	255,370,451	1.58
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	7,410	30,058.03	222,730,053	26,773.89	198,394,550	1.22
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	165,200	1,043.36	172,363,815	974.32	160,958,242	0.99
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	1,868,575	96.79	180,874,884	80.87	151,123,993	0.93
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	140,500	1,111.70	156,193,990	1,003.91	141,049,706	0.87
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	15,690	8,358.47	131,144,551	8,249.80	129,439,362	0.80
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	438,765	310.65	136,303,456	290.60	127,507,303	0.79
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	40,915	3,125.87	127,895,011	3,042.35	124,478,159	0.77
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	75,772	1,585.89	120,166,739	1,530.81	115,993,217	0.72
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	2,144,000	59.88	128,388,080	53.96	115,700,317	0.71
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	73,510	1,664.73	122,374,479	1,509.97	110,998,365	0.68
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	46,684	1,935.17	90,341,523	2,089.15	97,529,972	0.60

香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	479,000	197.82	94,757,505	189.93	90,978,003	0.56
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	23,500	3,882.84	91,246,740	3,675.36	86,370,960	0.53
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	エネルギー	11,565	7,726.74	89,359,817	7,417.23	85,780,311	0.53
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	19,230	3,983.90	76,610,587	4,303.32	82,752,886	0.51
ブラジル	株式	VALE SA	素材	58,639	1,563.53	91,684,217	1,403.89	82,322,864	0.51
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	70,436	1,349.53	95,055,756	1,134.38	79,901,648	0.49
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	835,800	93.24	77,929,992	92.17	77,040,701	0.48
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	24,920	2,820.74	70,292,940	2,985.17	74,390,536	0.46
ロシア	株式	GAZPROM PAO-SPON ADR	エネルギー	147,240	522.85	76,985,053	478.63	70,474,689	0.43
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	685,300	114.12	78,212,603	98.34	67,398,021	0.42
韓国	株式	POSCO	素材	2,090	36,430.74	76,140,267	31,813.60	66,490,424	0.41
韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,168	26,478.39	57,405,171	29,442.39	63,831,123	0.39
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PRF	銀行	80,449	920.95	74,089,981	755.59	60,786,468	0.37

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.65
		素材	7.00
		資本財	3.18
		商業・専門サービス	0.13
		運輸	1.44
		自動車・自動車部品	2.54
		耐久消費財・アパレル	1.02
		消費者サービス	1.26
		メディア	2.31
		小売	1.93
		食品・生活必需品小売り	1.71
		食品・飲料・タバコ	3.29
		家庭用品・パーソナル用品	1.24
		ヘルスケア機器・サービス	0.56
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.36
		銀行	15.55
		各種金融	2.37
		保険	3.32
		不動産	2.33
ソフトウェア・サービス	13.51		
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.65		
電気通信サービス	4.07		

		公益事業	2.20
		半導体・半導体製造装置	5.04
投資信託受益証券			0.34
投資証券			0.37
合 計			93.37

### 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	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE1809	買建	194	米ドル	10,640,510	1,176,201,975	10,134,560	1,120,274,262	6.91

(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	香港ドル	買建	3,500,000.00	49,272,650	49,280,000	0.30
	韓国ウォン	買建	400,000,000.00	39,480,000	39,520,000	0.24
	アラブディルハム	買建	100,000.00	3,004,360	3,014,000	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

### 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	29,658,669,225	78.22
地方債証券	日本	2,596,854,000	6.85
特殊債券	日本	3,319,507,000	8.75
社債券	日本	2,157,867,844	5.69
	オーストラリア	100,328,000	0.26
	小計	2,258,195,844	5.96
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		83,346,574	0.22
合計(純資産総額)		37,916,572,643	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	910,000,000	102.40	931,840,000	102.66	934,224,200	0.300	2025/12/20	2.46
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	100.63	613,903,400	101.01	616,203,700	0.100	2026/12/20	1.63
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	102.94	598,127,880	101.86	591,853,080	1.400	2019/9/20	1.56
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	560,000,000	100.60	563,404,800	100.44	562,480,800	0.100	2020/6/20	1.48
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	103.65	507,929,100	103.62	507,762,500	0.500	2024/9/20	1.34
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	505,000,000	100.56	507,838,100	100.38	506,949,300	0.100	2020/3/20	1.34
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	490,000,000	100.51	492,518,600	100.95	494,699,100	0.100	2027/3/20	1.30
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	490,000,000	100.49	492,412,900	100.80	493,934,700	0.100	2027/12/20	1.30
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	473,000,000	103.10	487,667,730	102.10	482,947,190	1.300	2019/12/20	1.27
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	103.15	433,255,200	103.33	434,007,000	0.400	2025/9/20	1.14
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	340,000,000	120.12	408,428,400	120.48	409,662,600	1.700	2032/9/20	1.08
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	370,000,000	104.79	387,730,400	103.88	384,363,400	1.300	2021/3/20	1.01
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	380,000,000	100.62	382,380,400	100.72	382,758,800	0.100	2028/3/20	1.01
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	103.08	381,431,300	103.25	382,039,800	0.400	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	134.28	370,629,360	136.26	376,091,400	2.400	2038/9/20	0.99
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	119.66	358,983,000	118.70	356,106,000	2.300	2026/6/20	0.94
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	122.85	356,267,900	122.32	354,742,500	2.100	2029/9/20	0.94
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	100.67	332,220,900	100.40	331,326,600	0.200	2019/9/20	0.87
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	325,000,000	100.65	327,119,000	100.50	326,625,000	0.100	2020/9/20	0.86
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	310,000,000	103.10	319,628,600	103.17	319,827,000	0.400	2025/3/20	0.84
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	107.61	317,449,500	106.80	315,071,800	1.400	2022/12/20	0.83
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	300,000,000	100.51	301,545,000	100.33	301,014,000	0.100	2019/12/20	0.79
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	120.12	300,317,500	119.19	297,995,000	2.300	2026/9/20	0.79
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	131.56	273,655,200	132.11	274,788,800	2.400	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	131.73	263,466,000	134.40	268,804,000	2.200	2041/3/20	0.71
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	215,000,000	117.34	252,287,450	118.46	254,699,750	1.500	2034/6/20	0.67



日本	国債証券	第50回利付国債 (20年)	237,000,000	106.82	253,172,880	105.52	250,098,990	1.900	2021/3/22	0.66
日本	国債証券	第145回利付国債 (20年)	205,000,000	120.62	247,291,350	121.00	248,062,300	1.700	2033/6/20	0.65
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	245,000,000	100.70	246,734,400	101.11	247,739,100	0.100	2026/6/20	0.65
日本	国債証券	第43回利付国債 (30年)	195,000,000	121.76	237,447,600	124.99	243,738,300	1.700	2044/6/20	0.64

## ロ.種類別の投資比率

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2018年6月29日現在です。

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

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	65,822,885,763	44.02
	カナダ	3,108,706,087	2.08
	メキシコ	1,196,740,893	0.80
	ドイツ	10,524,526,458	7.04
	イタリア	13,539,611,952	9.06
	フランス	15,014,822,869	10.04
	オランダ	3,206,683,715	2.14
	スペイン	8,732,574,275	5.84
	ベルギー	3,747,554,493	2.51
	オーストリア	2,309,590,450	1.54
	フィンランド	938,250,064	0.63
	アイルランド	1,271,625,833	0.85

	イギリス	10,353,535,760	6.92
	スイス	207,128,612	0.14
	スウェーデン	562,886,139	0.38
	ノルウェー	355,630,306	0.24
	デンマーク	891,134,042	0.60
	ポーランド	927,866,906	0.62
	オーストラリア	3,141,097,118	2.10
	シンガポール	616,091,516	0.41
	マレーシア	723,423,613	0.48
	南アフリカ	840,349,719	0.56
	小計	148,032,716,583	99.01
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,482,843,443	0.99
合計（純資産総額）		149,515,560,026	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	13,682.64	1,265,644,311	12,959.09	1,198,715,878	8.000	2021/11/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,530,000	11,446.50	1,205,317,022	11,190.66	1,178,376,561	3.375	2019/11/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	10,966.77	1,063,776,970	10,704.24	1,038,311,317	1.875	2022/7/31	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	10,892.08	980,287,290	10,852.78	976,750,563	0.750	2019/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,070,000	11,548.19	931,939,028	11,253.27	908,138,926	3.625	2020/2/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,830,000	11,557.04	904,916,657	11,251.11	880,962,299	3.500	2020/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,150,000	10,824.71	882,214,512	10,562.61	860,853,248	1.750	2023/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,450,000	11,085.95	825,903,805	10,962.24	816,686,936	1.750	2019/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,610,000	13,189.88	739,952,663	12,464.24	699,244,269	8.750	2020/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,050,000	11,148.13	674,462,220	10,898.11	659,336,048	2.125	2021/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	10,705.28	653,022,627	10,508.20	641,000,734	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,930,000	11,024.20	653,735,622	10,697.55	634,364,876	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,940,000	10,959.22	650,977,847	10,633.42	631,625,651	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,223.47	650,961,836	10,883.22	631,227,152	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,120,000	12,474.18	638,678,260	12,325.21	631,050,752	3.625	2043/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,957.49	635,534,917	10,865.51	630,200,058	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,991.60	637,512,810	10,712.23	621,309,481	2.000	2023/2/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	16,021.86	629,659,330	15,765.48	619,583,486	4.250	2023/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,138.19	598,121,250	10,932.45	587,072,577	2.000	2020/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,192.17	593,185,275	10,932.66	579,430,993	2.250	2021/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,258.49	596,700,447	10,928.12	579,190,789	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	10,906.32	578,035,470	10,838.96	574,465,227	2.875	2045/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	20,876.19	567,832,398	21,085.23	573,518,376	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,180,000	11,322.97	586,530,070	11,069.33	573,391,392	2.625	2020/8/15	0.38

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	12,740.59	573,326,874	12,575.21	565,884,824	3.750	2043/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,920,000	14,620.44	573,121,467	14,359.73	562,901,785	3.250	2021/10/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,900,000	14,656.42	571,600,640	14,324.07	558,639,096	3.750	2021/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,960,000	14,695.08	581,925,450	14,026.91	555,465,954	6.125	2027/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	10,927.05	557,279,849	10,852.56	553,480,711	1.000	2019/10/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	10,998.50	560,923,955	10,841.77	552,930,487	1.500	2020/5/31	0.37

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.01
合 計	99.01

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アルゼンチン	31,042,377	0.83
	メキシコ	386,846,356	10.33
	ブラジル	369,484,932	9.87
	チリ	98,912,800	2.64
	コロンビア	278,678,035	7.44
	ペルー	103,029,161	2.75
	ウルグアイ	8,466,705	0.23
	トルコ	212,780,120	5.68
	チェコ	162,471,394	4.34
	ハンガリー	162,508,900	4.34
	ポーランド	336,969,394	9.00
	ロシア	276,840,273	7.39
	ルーマニア	96,068,647	2.57
	マレーシア	204,368,653	5.46
	タイ	290,328,670	7.75

	フィリピン	10,313,775	0.28
	インドネシア	321,585,104	8.59
	南アフリカ	295,172,881	7.88
	小計	3,645,868,177	97.35
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		99,323,953	2.65
合計（純資産総額）		3,745,192,130	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		19,929,843	0.53

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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 (%)
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	560,000,000	17.70	99,172,689	17.66	98,912,800	5.500	2020/8/5	2.64
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,510,000	2,431.54	61,031,882	2,416.40	60,651,655		2020/7/1	1.62
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,360,000,000	3.99	54,351,998	3.95	53,796,309	7.500	2026/8/26	1.44
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,335,000,000	3.92	52,341,565	3.89	51,948,878	7.000	2022/5/4	1.39
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,980,000	564.62	50,703,163	563.58	50,610,261	8.000	2020/6/11	1.35
コロンビア	国債証券	TITULOS DE TESORERIA B	1,105,000,000	4.48	49,558,305	4.44	49,136,563	10.000	2024/7/24	1.31
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,700,000	2,925.04	49,725,835	2,796.01	47,532,199	10.000	2023/1/1	1.27
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,400,000	899.65	48,581,574	876.11	47,310,404	10.500	2026/12/21	1.26
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,800,000	542.13	42,286,872	543.13	42,364,773	6.500	2021/6/10	1.13
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,610,000	625.67	41,357,188	630.30	41,662,885	10.000	2024/12/5	1.11
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,620,000	354.58	41,202,655	352.73	40,988,277	3.650	2021/12/17	1.09
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,380,000	2,964.53	40,910,526	2,903.58	40,069,477	10.000	2021/1/1	1.07
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,340,000	749.77	40,038,230	724.56	38,692,034	8.750	2048/2/28	1.03
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,550,000	536.12	35,116,460	538.25	35,255,714	6.500	2022/6/9	0.94
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,680,000	397.01	34,460,618	397.26	34,482,984	4.875	2029/6/22	0.92
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,350,000	2,548.86	34,409,678	2,537.13	34,251,320		2020/1/1	0.91
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	4,250,000,000	0.81	34,718,703	0.77	33,134,063	8.375	2024/3/15	0.88

ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,290,000	2,489.74	32,117,757	2,476.76	31,950,303		2020/4/1	0.85
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,450,000	2,188.54	31,733,920	2,166.34	31,412,063		2021/7/1	0.84
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,080,000	2,789.87	30,130,621	2,804.67	30,290,478	2.500	2026/7/25	0.81
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	3,790,000,000	0.82	31,189,331	0.77	29,504,013	8.375	2026/9/15	0.79
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,370,000	538.78	28,932,545	539.08	28,948,972	5.000	2019/12/11	0.77
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,100,000	2,604.36	28,648,051	2,597.50	28,572,521		2019/10/1	0.76
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,500,000	333.39	28,338,796	332.79	28,287,321	2.000	2022/12/17	0.76
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,030,000	549.92	27,661,169	557.79	28,057,022	7.500	2027/6/3	0.75
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	1,040,000	2,891.57	30,072,385	2,696.16	28,040,094	10.000	2025/1/1	0.75
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,800,000	358.45	27,959,847	357.01	27,846,855	3.625	2023/6/16	0.74
タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,570,000	364.82	27,617,148	364.03	27,557,702	3.850	2025/12/12	0.74
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000	2,759.09	27,315,058	2,773.89	27,461,593	2.500	2027/7/25	0.73
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,760,000	549.31	26,147,613	566.70	26,975,325	7.750	2042/11/13	0.72

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.35
合計	97.35

#### 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	98,000.00	10,828,020	10,829,000	0.29
	チェココルナ	買建	895,100.00	4,390,465	4,412,843	0.12
	ポーランドズロチ	買建	160,000.00	4,680,000	4,688,000	0.13

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 参考情報

## 運用実績

2018年6月29日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,757円

純資産総額……………2.18億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2008年6月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2018年2月	2018年3月	2018年4月	2018年5月	2018年6月	直近1年間累計	設定来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	2,860円

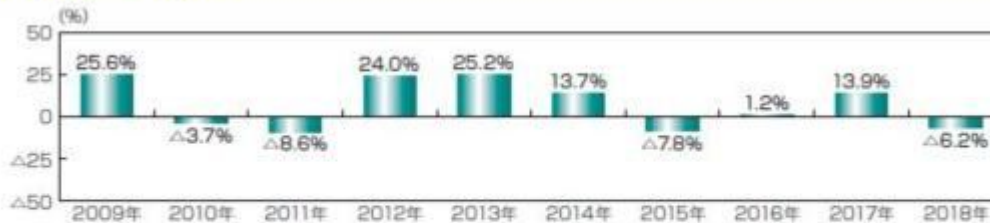
## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率 <sup>※1</sup>	組入上位銘柄	国・地域名	比率 <sup>※2</sup>
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	3.0%	トヨタ自動車	日本	3.5%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	1.7%
			ソニー	日本	1.5%
			日本電信電話	日本	1.4%
			ソフトバンクグループ	日本	1.4%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	海外先進国株式	26.7%	APPLE INC	アメリカ	2.5%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	2.0%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.9%
			FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.3%
			JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
海外新興国株式インデックス MSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド	新興国株式	19.3%	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	5.0%
			ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	ケイマン諸島	4.0%
			SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.7%
			TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	3.1%
			NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.9%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	3.0%	第341回利付国債(10年)	日本	2.5%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第303回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第124回利付国債(5年)	日本	1.5%
			第335回利付国債(10年)	日本	1.3%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外先進国債券	27.0%	US TREASURY N/B(クーポン8%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン3.375%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(クーポン1.875%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(クーポン0.75%)	アメリカ	0.7%
			US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカ	0.6%
海外新興国債券インデックス Local(ヘッジなし) マザーファンド	新興国債券	19.8%	REPUBLIC OF CHILE(クーポン5.5%)	チリ	2.6%
			LETRA TESOURO NACIONAL(クーポンなし)	ブラジル	1.6%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン7.5%)	コロンビア	1.4%
			TITULOS DE TESORERIA B(クーポン7%)	コロンビア	1.4%
			MEX BONOS DESARR FIX RT(クーポン8%)	メキシコ	1.4%
現金その他		1.2%			

※1:当ファンドの純資産総額比率です。上記比率は四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※2:各マザーファンドの純資産総額比率です。

## 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
 ※当ファンドには、ベンチマークはありません。  
 ※2018年は、2018年6月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
 ※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

## (2) コースの選択

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

## ＜分配金再投資コース＞

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

## ＜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。

当ファンドは、2018年12月25日をもって信託期間が終了いたします。

## (4) 取扱時間

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

## (5) 取得申込不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

## (6) 申込金額

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

## (7) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## ＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (8) 申込代金の支払い

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

## (9) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、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。

当ファンドは、2018年12月25日をもって信託期間が終了いたします。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時~午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

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



詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

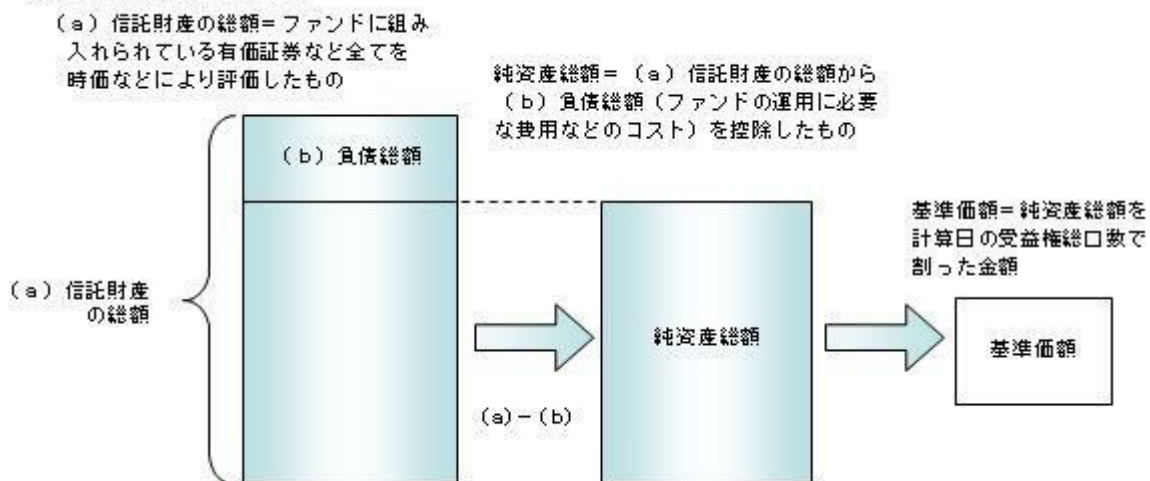
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

## 公社債（国内・外国）

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

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

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <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】

2018年12月25日までとします（2008年3月31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26日から翌月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
  - 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たときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。  
償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

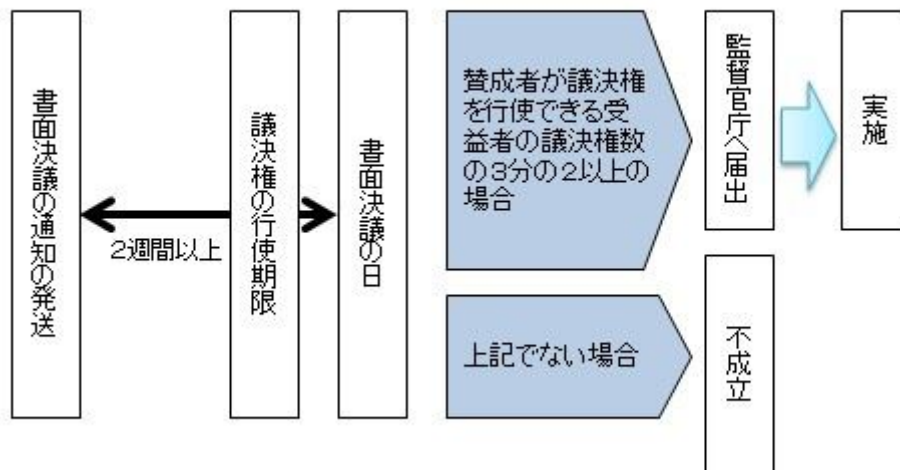
#### 信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

#### 書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を送ります。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

#### <書面決議の主な流れ>



#### 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

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

(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

##### (2) 解約請求権

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

##### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、平成29年12月26日から平成30年6月25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】

## 【全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成29年12月25日現在	当期 平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	2,347,489
コール・ローン	3,194,173	1,018,912
親投資信託受益証券	234,507,148	220,442,007
未収入金	-	103,487
流動資産合計	237,701,321	223,911,895
資産合計	237,701,321	223,911,895
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	452,031	453,720
未払解約金	-	233,180
未払受託者報酬	9,740	10,418
未払委託者報酬	194,996	208,581
未払利息	4	1
その他未払費用	217,258	110,592
流動負債合計	874,029	1,016,492
負債合計	874,029	1,016,492
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	226,015,696	226,860,287
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,811,596	3,964,884
（分配準備積立金）	48,350,148	49,997,909
元本等合計	236,827,292	222,895,403
純資産合計	236,827,292	222,895,403
負債純資産合計	237,701,321	223,911,895

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	平成29年 6月27日 平成29年12月25日	自	平成29年12月26日 平成30年 6月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		19,536,200		10,686,122
営業収益合計		19,536,200		10,686,122
営業費用				
支払利息		710		532
受託者報酬		63,017		62,459
委託者報酬		1,261,525		1,250,367
その他費用		116,672		115,658
営業費用合計		1,441,924		1,429,016
営業利益又は営業損失（ ）		18,094,276		12,115,138
経常利益又は経常損失（ ）		18,094,276		12,115,138
当期純利益又は当期純損失（ ）		18,094,276		12,115,138
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（ ）		115,838		36,136
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,380,518		10,811,596
剰余金増加額又は欠損金減少額		224,756		184,836
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		97,099		11,243
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		127,657		173,593
剰余金減少額又は欠損金増加額		256,463		152,969
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		234,858		142,761
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		21,605		10,208
分配金		2,754,617		2,729,345
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,811,596		3,964,884

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

		前期 平成29年12月25日現在	当期 平成30年 6月25日現在
1.	期首元本額	234,037,655円	226,015,696円
	期中追加設定元本額	7,906,032円	7,195,648円
	期中一部解約元本額	15,927,991円	6,351,057円
2.	受益権の総数	226,015,696口	226,860,287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	- 円	3,964,884円

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

前期 自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日		当期 自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 平成29年 6月27日 至 平成29年 7月25日		自 平成29年12月26日 至 平成30年 1月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	679,546円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 474,611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 3,215,500円
C	信託約款に定める収益調整金	21,576,460円	C 信託約款に定める収益調整金 22,888,864円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	51,134,874円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 48,059,594円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	73,390,880円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D ) 74,638,569円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,154円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,292円
G	分配金額	465,287円	G 分配金額 453,343円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H 分配金額(1万口当たり) 20円
自 平成29年 7月26日 至 平成29年 8月25日		自 平成30年 1月26日 至 平成30年 2月26日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	369,429円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 359,695円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	21,792,356円	C 信託約款に定める収益調整金 23,114,348円



D	信託約款に定める分配準備積立金	50,922,793円	D	信託約款に定める分配準備積立金	51,065,664円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	73,084,578円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	74,539,707円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,150円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,288円
G	分配金額	463,911円	G	分配金額	453,293円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成29年 8月26日			自 平成30年 2月27日	
	至 平成29年 9月25日			至 平成30年 3月26日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	546,806円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	318,520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	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	21,772,633円	C	信託約款に定める収益調整金	23,439,932円
D	信託約款に定める分配準備積立金	49,959,048円	D	信託約款に定める分配準備積立金	50,947,330円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	72,278,487円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	74,705,782円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,155円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,282円
G	分配金額	458,179円	G	分配金額	455,126円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成29年 9月26日			自 平成30年 3月27日	
	至 平成29年10月25日			至 平成30年 4月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	477,504円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	597,627円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	22,312,826円	C	信託約款に定める収益調整金	23,769,962円
D	信託約款に定める分配準備積立金	49,795,331円	D	信託約款に定める分配準備積立金	50,788,445円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	72,585,661円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	75,156,034円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,155円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,289円
G	分配金額	459,988円	G	分配金額	457,005円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成29年10月26日			自 平成30年 4月26日	
	至 平成29年11月27日			至 平成30年 5月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	300,444円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	428,982円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	22,318,609円	C	信託約款に定める収益調整金	23,989,339円
D	信託約款に定める分配準備積立金	49,067,346円	D	信託約款に定める分配準備積立金	50,688,918円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	71,686,399円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	75,107,239円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,149円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,287円
G	分配金額	455,221円	G	分配金額	456,858円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 平成29年11月28日			自 平成30年 5月26日	
	至 平成29年12月25日			至 平成30年 6月25日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	452,450円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	367,609円

B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	22,388,476円	C	信託約款に定める収益調整金	24,059,864円
D	信託約款に定める分配準備積立金	48,349,729円	D	信託約款に定める分配準備積立金	50,084,020円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	71,190,655円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	74,511,493円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,149円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,284円
G	分配金額	452,031円	G	分配金額	453,720円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	当期 自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	前期 平成29年12月25日現在	当期 平成30年 6月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

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

## （有価証券に関する注記）

前期（平成29年12月25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	4,398,202
合計	4,398,202

当期（平成30年 6月25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	2,907,503
合計	2,907,503

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

前期 平成29年12月25日現在	当期 平成30年 6月25日現在
1口当たり純資産額	1.0478円
	1口当たり純資産額
	0.9825円

(1万口当たり純資産額)	(10,478円)	(1万口当たり純資産額)	(9,825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	24,616,187	59,873,951	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,792,931	6,694,766	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	27,201,486	60,180,567	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,232,325	6,546,983	
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド	24,089,743	43,380,809	
	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし) マザーファンド	35,101,806	43,764,931	
合計		120,034,478	220,442,007	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

### 貸借対照表

	(単位:円)	
	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	121,053,768
コール・ローン	61,850,607	52,542,605
株式	29,203,559,950	28,564,669,030
派生商品評価勘定	1,453,380	-
未収入金	158,582,990	-
未収配当金	1,881,450	127,041,777
前払金	-	3,300,000
流動資産合計	29,427,328,377	28,868,607,180
<b>資産合計</b>	<b>29,427,328,377</b>	<b>28,868,607,180</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	11,080	4,305,400
前受金	1,335,000	-
未払金	-	91,716,300
未払解約金	68,847,572	8,161,570
未払利息	87	57
流動負債合計	70,193,739	104,183,327
<b>負債合計</b>	<b>70,193,739</b>	<b>104,183,327</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	18,114,380,072	18,595,197,208
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	11,242,754,566	10,169,226,645
元本等合計	29,357,134,638	28,764,423,853
<b>純資産合計</b>	<b>29,357,134,638</b>	<b>28,764,423,853</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>29,427,328,377</b>	<b>28,868,607,180</b>

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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</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</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

		平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
1.	期首	平成29年 6月27日	平成29年12月26日
	期首元本額	19,591,921,031円	18,114,380,072円
	期首からの追加設定元本額	733,414,602円	1,443,708,414円
	期首からの一部解約元本額	2,210,955,561円	962,891,278円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	270,804,778円	326,419,668円
	DCインデックスバランス（株式40）	835,808,259円	955,174,887円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,665,819,851円	1,889,677,113円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,823,194,869円	2,047,730,478円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,246,887,965円	1,452,404,909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	3,516,757,728円	3,353,761,573円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	4,408,078円	4,232,325円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	495,308,762円	694,075,198円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	52,197,606円	50,293,739円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	38,924,118円	40,100,481円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	60,938,561円	62,652,109円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	63,449,306円	64,347,580円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,904,560,773円	4,504,348,017円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	9,684,494円	6,150,542円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	29,008,213円	9,919,717円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	243,592,877円	251,584,615円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	718,539,596円	724,963,495円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,062,440,491円	1,077,848,694円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,072,053,747円	1,079,512,068円

	計	18,114,380,072円	18,595,197,208円
2.	受益権の総数	18,114,380,072口	18,595,197,208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	496,680,000円	435,795,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自平成29年6月27日 至平成29年12月25日	自平成29年12月26日 至平成30年6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月25日現在	平成30年6月25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。	(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。	(3)上記以外の金融商品  同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成29年12月25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	1,234,657,126
合計	1,234,657,126

（平成30年 6月25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	419,240,309
合計	419,240,309

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成29年12月25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	90,080,000	-	91,525,000	1,445,000



合計	90,080,000	-	91,525,000	1,445,000
----	------------	---	------------	-----------

(平成30年 6月25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	176,950,000	-	172,650,000	4,300,000
合計		176,950,000	-	172,650,000	4,300,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年12月25日現在		平成30年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.6207円	1口当たり純資産額	1.5469円
(1万口当たり純資産額)	(16,207円)	(1万口当たり純資産額)	(15,469円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	500	3,590.00	1,795,000	
日本水産	14,600	540.00	7,884,000	
マルハニチロ	2,500	4,265.00	10,662,500	
カネコ種苗	500	1,645.00	822,500	
サカタのタネ	1,900	4,045.00	7,685,500	

ホクト	1,300	1,926.00	2,503,800
ホクリヨウ	200	845.00	169,000
住石ホールディングス	3,700	147.00	543,900
日鉄鉱業	400	5,140.00	2,056,000
三井松島産業	700	1,549.00	1,084,300
国際石油開発帝石	63,000	1,129.50	71,158,500
石油資源開発	2,000	2,676.00	5,352,000
K&Oエナジーグループ	800	1,849.00	1,479,200
ヒノキヤグループ	300	2,907.00	872,100
ショーボンドホールディングス	1,200	7,540.00	9,048,000
ミライト・ホールディングス	4,000	1,711.00	6,844,000
サンヨーホームズ	300	1,338.00	401,400
日本アクア	400	352.00	140,800
ファーストコーポレーション	500	1,082.00	541,000
ベステラ	300	1,266.00	379,800
TATERU	1,200	1,970.00	2,364,000
ダイセキ環境ソリューション	300	1,107.00	332,100
第一カッター興業	200	2,743.00	548,600
安藤・間	10,100	972.00	9,817,200
東急建設	5,000	1,030.00	5,150,000
コムシスホールディングス	4,600	2,955.00	13,593,000
ミサワホーム	1,100	931.00	1,024,100
高松コンストラクショングループ	800	3,150.00	2,520,000
東建コーポレーション	500	9,770.00	4,885,000
ソネック	200	890.00	178,000
ヤマウラ	600	894.00	536,400
大成建設	12,900	6,000.00	77,400,000
大林組	38,800	1,133.00	43,960,400
清水建設	39,700	1,106.00	43,908,200
飛島建設	12,300	192.00	2,361,600
長谷工コーポレーション	15,100	1,494.00	22,559,400
松井建設	1,400	931.00	1,303,400
銭高組	200	5,660.00	1,132,000
鹿島建設	57,000	851.00	48,507,000
不動テトラ	10,200	204.00	2,080,800
大末建設	500	1,393.00	696,500
鉄建建設	800	2,950.00	2,360,000
西松建設	3,000	3,125.00	9,375,000
三井住友建設	9,400	765.00	7,191,000
大豊建設	5,000	644.00	3,220,000
前田建設工業	9,200	1,283.00	11,803,600
ナカノフドー建設	1,000	642.00	642,000

奥村組	2,100	3,600.00	7,560,000
東鉄工業	1,600	3,420.00	5,472,000
イチケン	200	2,554.00	510,800
浅沼組	5,000	373.00	1,865,000
戸田建設	15,000	950.00	14,250,000
熊谷組	2,100	3,850.00	8,085,000
青木あすなろ建設	900	972.00	874,800
北野建設	3,000	428.00	1,284,000
植木組	200	2,628.00	525,600
三井ホーム	2,000	691.00	1,382,000
矢作建設工業	1,800	878.00	1,580,400
ピーエス三菱	1,600	583.00	932,800
日本ハウスホールディングス	2,500	541.00	1,352,500
大東建託	4,600	18,095.00	83,237,000
新日本建設	1,600	1,271.00	2,033,600
N I P P O	3,000	1,990.00	5,970,000
東亜道路工業	300	3,790.00	1,137,000
前田道路	4,100	2,089.00	8,564,900
日本道路	400	5,620.00	2,248,000
東亜建設工業	1,100	2,870.00	3,157,000
若築建設	700	1,643.00	1,150,100
東洋建設	4,100	471.00	1,931,100
五洋建設	15,400	718.00	11,057,200
福田組	400	6,670.00	2,668,000
住友林業	8,200	1,627.00	13,341,400
日本基礎技術	1,500	376.00	564,000
日成ビルド工業	1,900	1,125.00	2,137,500
ヤマダ・エスバイエルホーム	7,000	70.00	490,000
巴コーポレーション	1,700	453.00	770,100
大和ハウス工業	38,300	3,694.00	141,480,200
ライト工業	2,500	1,137.00	2,842,500
積水ハウス	42,100	1,911.50	80,474,150
日特建設	1,200	663.00	795,600
北陸電気工事	700	1,169.00	818,300
ユアテック	1,800	917.00	1,650,600
西部電気工業	200	3,815.00	763,000
四電工	200	2,661.00	532,200
中電工	1,700	2,784.00	4,732,800
関電工	5,200	1,197.00	6,224,400
きんでん	8,600	1,773.00	15,247,800
東京エネシス	1,500	1,246.00	1,869,000
トーエネック	400	3,285.00	1,314,000

住友電設	1,000	2,010.00	2,010,000
日本電設工業	2,000	2,426.00	4,852,000
協和エクシオ	4,700	2,999.00	14,095,300
新日本空調	1,000	1,713.00	1,713,000
N D S	200	6,030.00	1,206,000
九電工	2,600	5,370.00	13,962,000
三機工業	2,800	1,054.00	2,951,200
日揮	11,100	2,172.00	24,109,200
中外炉工業	400	2,632.00	1,052,800
ヤマト	1,100	688.00	756,800
太平電業	900	2,778.00	2,500,200
高砂熱学工業	3,600	2,080.00	7,488,000
三晃金属工業	200	3,455.00	691,000
朝日工業社	300	3,430.00	1,029,000
明星工業	2,400	815.00	1,956,000
大気社	1,700	3,390.00	5,763,000
ダイダン	900	2,448.00	2,203,200
日比谷総合設備	1,500	2,188.00	3,282,000
東芝プラントシステム	2,800	2,539.00	7,109,200
O S J Bホールディングス	5,800	272.00	1,577,600
東洋エンジニアリング	1,500	755.00	1,132,500
千代田化工建設	8,400	945.00	7,938,000
新興プランテック	2,500	1,036.00	2,590,000
日本製粉	3,800	1,918.00	7,288,400
日清製粉グループ本社	14,200	2,342.00	33,256,400
日東富士製粉	100	5,060.00	506,000
昭和産業	1,100	2,925.00	3,217,500
鳥越製粉	1,000	995.00	995,000
中部飼料	1,400	2,004.00	2,805,600
フィード・ワン	7,800	213.00	1,661,400
東洋精糖	200	1,224.00	244,800
日本甜菜製糖	700	2,286.00	1,600,200
三井製糖	900	3,410.00	3,069,000
塩水港精糖	1,600	260.00	416,000
日新製糖	500	2,154.00	1,077,000
森永製菓	2,700	5,260.00	14,202,000
中村屋	300	4,785.00	1,435,500
江崎グリコ	3,200	5,260.00	16,832,000
名糖産業	600	1,773.00	1,063,800
井村屋グループ	500	3,330.00	1,665,000
不二家	700	2,493.00	1,745,100
山崎製パン	9,500	2,774.00	26,353,000

第一屋製パン	200	1,167.00	233,400
モロゾフ	200	6,730.00	1,346,000
亀田製菓	700	6,020.00	4,214,000
寿スピリッツ	1,100	5,740.00	6,314,000
カルビー	5,300	4,110.00	21,783,000
森永乳業	2,300	4,075.00	9,372,500
六甲バター	800	2,314.00	1,851,200
ヤクルト本社	6,800	7,230.00	49,164,000
明治ホールディングス	7,700	9,310.00	71,687,000
雪印メグミルク	2,800	2,900.00	8,120,000
プリマハム	8,000	618.00	4,944,000
日本ハム	5,000	4,395.00	21,975,000
林兼産業	500	787.00	393,500
丸大食品	6,000	495.00	2,970,000
S Foods	800	4,300.00	3,440,000
伊藤ハム米久ホールディングス	7,400	937.00	6,933,800
サッポロホールディングス	4,200	2,771.00	11,638,200
アサヒグループホールディングス	24,300	5,546.00	134,767,800
キリンホールディングス	55,800	2,938.50	163,968,300
宝ホールディングス	8,700	1,470.00	12,789,000
オエノンホールディングス	3,300	410.00	1,353,000
養命酒製造	400	2,470.00	988,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	8,100	4,230.00	34,263,000
サントリー食品インターナショナル	8,900	4,685.00	41,696,500
ダイドーグループホールディングス	600	6,370.00	3,822,000
伊藤園	3,900	5,190.00	20,241,000
キーコーヒー	1,100	2,184.00	2,402,400
ユニカフェ	400	1,195.00	478,000
ジャパンフーズ	200	1,471.00	294,200
日清オイリオグループ	1,400	3,140.00	4,396,000
不二製油グループ本社	3,100	3,820.00	11,842,000
かどや製油	100	6,100.00	610,000
J - オイルミルズ	600	3,945.00	2,367,000
キッコーマン	9,100	5,660.00	51,506,000
味の素	26,700	2,062.50	55,068,750
キュービー	6,500	2,805.00	18,232,500
ハウス食品グループ本社	4,400	3,810.00	16,764,000
カゴメ	4,700	3,705.00	17,413,500
焼津水産化学工業	600	1,246.00	747,600
アリアケジャパン	1,100	9,310.00	10,241,000
ピエトロ	200	1,646.00	329,200
エバラ食品工業	300	2,220.00	666,000

ニチレイ	5,500	2,786.00	15,323,000
東洋水産	6,400	3,875.00	24,800,000
イトアンド	400	2,092.00	836,800
大冷	100	1,994.00	199,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	1,192.00	238,400
日清食品ホールディングス	5,000	8,130.00	40,650,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,496.00	1,496,000
一正蒲鉾	500	1,331.00	665,500
フジッコ	1,300	2,882.00	3,746,600
ロック・フィールド	1,300	1,917.00	2,492,100
日本たばこ産業	71,800	3,211.00	230,549,800
ケンコーマヨネーズ	800	4,090.00	3,272,000
わらべや日洋ホールディングス	800	2,510.00	2,008,000
なとり	700	1,888.00	1,321,600
イフジ産業	200	779.00	155,800
ピクルスコーポレーション	200	2,210.00	442,000
北の達人コーポレーション	3,600	790.00	2,844,000
ユーグレナ	4,700	848.00	3,985,600
ミヨシ油脂	500	1,370.00	685,000
理研ビタミン	400	4,505.00	1,802,000
片倉工業	1,400	1,295.00	1,813,000
ゲンゼ	900	6,810.00	6,129,000
東洋紡	4,500	1,813.00	8,158,500
ユニチカ	3,500	620.00	2,170,000
富士紡ホールディングス	700	3,545.00	2,481,500
倉敷紡績	12,000	356.00	4,272,000
シキボウ	600	1,273.00	763,800
日本毛織	3,400	1,021.00	3,471,400
ダイトウボウ	2,600	98.00	254,800
トーア紡コーポレーション	500	561.00	280,500
ダイドーリミテッド	1,400	447.00	625,800
帝国繊維	1,300	2,296.00	2,984,800
帝人	9,900	1,998.00	19,780,200
東レ	87,800	861.20	75,613,360
サカイオーベックス	300	2,245.00	673,500
住江織物	300	2,703.00	810,900
日本フェルト	600	516.00	309,600
イチカワ	1,000	351.00	351,000
日東製網	100	1,820.00	182,000
アツギ	800	1,169.00	935,200
ダイニック	500	1,019.00	509,500
セーレン	2,800	1,722.00	4,821,600

ソトー	400	1,028.00	411,200
東海染工	200	1,429.00	285,800
小松精練	1,900	950.00	1,805,000
ワコールホールディングス	3,300	3,145.00	10,378,500
ホギメディカル	1,500	4,765.00	7,147,500
レナウン	3,400	147.00	499,800
クラウディアホールディングス	300	591.00	177,300
T S Iホールディングス	4,200	784.00	3,292,800
マツオカコーポレーション	300	3,755.00	1,126,500
三陽商会	600	2,266.00	1,359,600
ナイガイ	500	551.00	275,500
オンワードホールディングス	7,000	830.00	5,810,000
ルックホールディングス	2,000	283.00	566,000
キムラタン	6,400	38.00	243,200
ゴールドウイン	700	9,750.00	6,825,000
デサント	2,800	1,952.00	5,465,600
キング	600	516.00	309,600
ヤマトインターナショナル	800	609.00	487,200
特種東海製紙	700	4,380.00	3,066,000
王子ホールディングス	51,000	662.00	33,762,000
日本製紙	5,400	1,760.00	9,504,000
三菱製紙	1,800	630.00	1,134,000
北越紀州製紙	6,700	557.00	3,731,900
中越パルプ工業	500	1,657.00	828,500
巴川製紙所	2,000	253.00	506,000
大王製紙	4,800	1,559.00	7,483,200
阿波製紙	300	641.00	192,300
レンゴー	11,700	953.00	11,150,100
トーモク	700	2,061.00	1,442,700
ザ・パック	900	3,595.00	3,235,500
クラレ	20,300	1,539.00	31,241,700
旭化成	75,500	1,396.50	105,435,750
共和レザー	700	1,009.00	706,300
昭和電工	8,100	4,730.00	38,313,000
住友化学	89,000	616.00	54,824,000
住友精化	500	5,590.00	2,795,000
日産化学工業	7,000	5,220.00	36,540,000
ラサ工業	500	2,837.00	1,418,500
クレハ	1,100	7,620.00	8,382,000
多木化学	200	4,915.00	983,000
テイカ	900	2,219.00	1,997,100
石原産業	2,200	1,002.00	2,204,400

片倉コープアグリ	300	1,201.00	360,300
日東エフシー	700	748.00	523,600
日本曹達	8,000	592.00	4,736,000
東ソー	17,500	1,690.00	29,575,000
トクヤマ	3,500	3,415.00	11,952,500
セントラル硝子	2,400	2,267.00	5,440,800
東亜合成	7,100	1,323.00	9,393,300
大阪ソーダ	1,200	3,150.00	3,780,000
関東電化工業	2,900	953.00	2,763,700
デンカ	4,500	3,660.00	16,470,000
信越化学工業	20,200	9,800.00	197,960,000
日本カーバイド工業	400	1,890.00	756,000
堺化学工業	800	2,909.00	2,327,200
エア・ウォーター	10,000	1,967.00	19,670,000
大陽日酸	9,300	1,591.00	14,796,300
日本化学工業	500	4,735.00	2,367,500
東邦アセチレン	200	1,513.00	302,600
日本パーカライズニング	6,200	1,572.00	9,746,400
高压ガス工業	1,800	1,009.00	1,816,200
四国化成工業	1,700	1,525.00	2,592,500
戸田工業	200	2,771.00	554,200
ステラ ケミファ	600	3,730.00	2,238,000
保土谷化学工業	400	3,315.00	1,326,000
日本触媒	1,900	7,860.00	14,934,000
大日精化工業	900	3,375.00	3,037,500
カネカ	16,000	1,001.00	16,016,000
三菱瓦斯化学	10,000	2,468.00	24,680,000
三井化学	11,000	2,877.00	31,647,000
J S R	12,200	1,831.00	22,338,200
東京応化工業	2,100	4,130.00	8,673,000
大阪有機化学工業	1,100	1,497.00	1,646,700
三菱ケミカルホールディングス	81,100	904.20	73,330,620
K Hネオケム	1,900	3,365.00	6,393,500
ダイセル	16,300	1,179.00	19,217,700
住友ベークライト	10,000	1,028.00	10,280,000
積水化学工業	25,200	1,798.00	45,309,600
日本ゼオン	10,200	1,288.00	13,137,600
アイカ工業	3,400	3,840.00	13,056,000
宇部興産	6,100	2,840.00	17,324,000
積水樹脂	1,900	2,333.00	4,432,700
タキロンシーアイ	2,500	597.00	1,492,500
旭有機材	700	2,292.00	1,604,400



日立化成	6,000	2,162.00	12,972,000
ニチバン	600	3,050.00	1,830,000
リケンテクノス	2,600	550.00	1,430,000
大倉工業	3,000	522.00	1,566,000
積水化成成品工業	1,500	1,142.00	1,713,000
群栄化学工業	300	3,505.00	1,051,500
タイガースポリマー	600	770.00	462,000
ミライアル	400	1,245.00	498,000
ダイキアクシス	400	1,323.00	529,200
ダイキョーニシカワ	2,400	1,643.00	3,943,200
竹本容器	200	3,000.00	600,000
森六ホールディングス	600	3,060.00	1,836,000
日本化薬	7,800	1,212.00	9,453,600
カーリットホールディングス	1,100	971.00	1,068,100
日本精化	1,000	1,244.00	1,244,000
扶桑化学工業	1,100	2,819.00	3,100,900
トリケミカル研究所	300	4,340.00	1,302,000
A D E K A	5,200	1,776.00	9,235,200
日油	4,700	3,610.00	16,967,000
新日本理化	2,000	243.00	486,000
ハリマ化成グループ	900	865.00	778,500
花王	28,400	8,514.00	241,797,600
第一工業製薬	2,000	730.00	1,460,000
石原ケミカル	300	2,181.00	654,300
日華化学	400	1,178.00	471,200
ニイタカ	200	1,721.00	344,200
三洋化成工業	800	4,795.00	3,836,000
有機合成薬品工業	800	277.00	221,600
大日本塗料	1,400	1,453.00	2,034,200
日本ペイントホールディングス	9,300	4,575.00	42,547,500
関西ペイント	12,700	2,253.00	28,613,100
神東塗料	900	227.00	204,300
中国塗料	3,500	1,065.00	3,727,500
日本特殊塗料	800	2,400.00	1,920,000
藤倉化成	1,500	640.00	960,000
太陽ホールディングス	900	4,490.00	4,041,000
D I C	4,800	3,455.00	16,584,000
サカタインクス	2,500	1,450.00	3,625,000
東洋インキ S C ホールディングス	12,000	574.00	6,888,000
T & K T O K A	800	1,187.00	949,600
富士フイルムホールディングス	24,000	4,222.00	101,328,000
資生堂	21,500	8,774.00	188,641,000

ライオン	16,100	1,998.00	32,167,800
高砂香料工業	700	3,565.00	2,495,500
マンダム	2,200	3,255.00	7,161,000
ミルボン	1,600	4,920.00	7,872,000
ファンケル	2,800	5,390.00	15,092,000
コーセー	2,000	24,660.00	49,320,000
コタ	600	1,501.00	900,600
シーズ・ホールディングス	1,400	5,100.00	7,140,000
シーボン	100	3,000.00	300,000
ポーラ・オルビスホールディングス	4,900	4,870.00	23,863,000
ノエビアホールディングス	700	7,780.00	5,446,000
アジュバンコスメジャパン	300	1,050.00	315,000
エステー	800	3,135.00	2,508,000
アグロ カネショウ	500	2,743.00	1,371,500
コニシ	1,900	1,819.00	3,456,100
長谷川香料	1,400	2,188.00	3,063,200
星光PMC	700	1,033.00	723,100
小林製薬	3,200	9,520.00	30,464,000
荒川化学工業	1,000	1,818.00	1,818,000
メック	800	2,057.00	1,645,600
日本高純度化学	300	2,439.00	731,700
タカラバイオ	3,000	2,330.00	6,990,000
JCU	1,400	2,686.00	3,760,400
新田ゼラチン	800	815.00	652,000
OATアグリオ	200	3,295.00	659,000
デクセリアルズ	3,000	1,047.00	3,141,000
アース製薬	900	5,730.00	5,157,000
北興化学工業	1,200	617.00	740,400
大成ラミック	400	3,130.00	1,252,000
クミアイ化学工業	5,300	813.00	4,308,900
日本農薬	2,800	648.00	1,814,400
アキレス	900	2,196.00	1,976,400
有沢製作所	2,000	1,120.00	2,240,000
日東電工	8,700	8,221.00	71,522,700
レック	700	4,575.00	3,202,500
きもと	2,100	299.00	627,900
藤森工業	1,000	3,570.00	3,570,000
前澤化成工業	800	1,210.00	968,000
ウェーブロックホールディングス	200	1,077.00	215,400
JSP	700	3,340.00	2,338,000
エフピコ	900	6,040.00	5,436,000
天馬	900	1,939.00	1,745,100

信越ポリマー	2,400	1,037.00	2,488,800	
東リ	2,800	338.00	946,400	
ニフコ	4,200	3,485.00	14,637,000	
日本バルカー工業	900	3,125.00	2,812,500	
ユニ・チャーム	24,500	3,303.00	80,923,500	
協和発酵キリン	14,500	2,274.00	32,973,000	
武田薬品工業	42,600	4,526.00	192,807,600	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	118,800	1,740.00	206,712,000	
大日本住友製薬	8,600	2,313.00	19,891,800	
塩野義製薬	16,300	5,610.00	91,443,000	
田辺三菱製薬	14,100	1,898.00	26,761,800	
わかもと製薬	1,500	294.00	441,000	
あすか製薬	1,300	1,386.00	1,801,800	
日本新薬	3,000	6,360.00	19,080,000	
バイオフェルミン製薬	200	2,869.00	573,800	
中外製薬	12,100	5,900.00	71,390,000	
科研製薬	2,100	5,810.00	12,201,000	
エーザイ	13,900	7,856.00	109,198,400	
ロート製薬	6,300	3,440.00	21,672,000	
小野薬品工業	27,300	2,688.00	73,382,400	
久光製薬	3,400	9,800.00	33,320,000	
持田製薬	800	8,050.00	6,440,000	
参天製薬	21,900	1,930.00	42,267,000	
扶桑薬品工業	400	2,934.00	1,173,600	
日本ケミファ	200	4,765.00	953,000	
ツムラ	4,100	3,665.00	15,026,500	
日医工	3,000	1,679.00	5,037,000	
キッセイ薬品工業	2,000	3,020.00	6,040,000	
生化学工業	2,300	1,490.00	3,427,000	
栄研化学	1,900	2,480.00	4,712,000	
日水製薬	500	1,386.00	693,000	
鳥居薬品	700	2,716.00	1,901,200	
JCRファーマ	800	7,040.00	5,632,000	
東和薬品	600	5,900.00	3,540,000	
富士製薬工業	400	4,015.00	1,606,000	
沢井製薬	2,300	4,980.00	11,454,000	
ゼリア新薬工業	2,500	2,330.00	5,825,000	
第一三共	33,100	4,270.00	141,337,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,339.00	7,484,800	
大幸薬品	600	2,046.00	1,227,600	
ダイト	700	3,455.00	2,418,500	
大塚ホールディングス	24,000	5,527.00	132,648,000	

大正製薬ホールディングス	2,600	12,950.00	33,670,000
ペプチドリーム	5,300	4,665.00	24,724,500
日本コークス工業	9,800	119.00	1,166,200
昭和シェル石油	10,800	1,633.00	17,636,400
ニチレキ	1,500	1,276.00	1,914,000
ユシロ化学工業	600	1,726.00	1,035,600
ビーピー・カストロール	500	1,618.00	809,000
富士石油	2,800	378.00	1,058,400
MORESCO	400	1,749.00	699,600
出光興産	9,700	3,565.00	34,580,500
JXTGホールディングス	184,500	748.30	138,061,350
コスモエネルギーホールディングス	3,300	3,680.00	12,144,000
横浜ゴム	6,700	2,343.00	15,698,100
東洋ゴム工業	6,800	1,643.00	11,172,400
ブリヂストン	38,300	4,377.00	167,639,100
住友ゴム工業	11,900	1,790.00	21,301,000
藤倉ゴム工業	1,000	624.00	624,000
オカモト	4,000	1,285.00	5,140,000
フコク	500	968.00	484,000
ニッタ	1,200	4,370.00	5,244,000
住友理工	2,200	1,127.00	2,479,400
三ツ星ベルト	3,000	1,350.00	4,050,000
バンドー化学	2,200	1,241.00	2,730,200
日東紡績	1,700	2,617.00	4,448,900
旭硝子	11,700	4,295.00	50,251,500
日本板硝子	5,800	1,081.00	6,269,800
石塚硝子	200	2,383.00	476,600
日本山村硝子	5,000	183.00	915,000
日本電気硝子	5,000	2,994.00	14,970,000
オハラ	500	3,085.00	1,542,500
住友大阪セメント	23,000	509.00	11,707,000
太平洋セメント	7,300	3,755.00	27,411,500
日本ヒューム	1,200	895.00	1,074,000
日本コンクリート工業	2,700	331.00	893,700
三谷セキサン	600	2,614.00	1,568,400
アジアパイルホールディングス	1,500	708.00	1,062,000
東海カーボン	10,500	1,924.00	20,202,000
日本カーボン	600	6,130.00	3,678,000
東洋炭素	800	3,175.00	2,540,000
ノリタケカンパニーリミテド	600	6,010.00	3,606,000
TOTO	8,900	5,320.00	47,348,000
日本碍子	14,100	1,949.00	27,480,900

日本特殊陶業	9,900	3,060.00	30,294,000
ダントーホールディングス	1,100	134.00	147,400
MARUWA	400	8,560.00	3,424,000
品川リフラクトリーズ	300	3,520.00	1,056,000
黒崎播磨	200	6,230.00	1,246,000
ヨータイ	1,000	675.00	675,000
イソライト工業	600	640.00	384,000
東京窯業	1,500	372.00	558,000
ニッカトー	500	1,299.00	649,500
フジミインコーポレーテッド	1,000	2,440.00	2,440,000
クニミネ工業	400	1,074.00	429,600
エーアンドエーマテリアル	300	1,204.00	361,200
ニチアス	6,000	1,410.00	8,460,000
ニチハ	1,700	4,085.00	6,944,500
新日鐵住金	51,200	2,174.50	111,334,400
神戸製鋼所	20,900	1,026.00	21,443,400
合同製鐵	600	2,173.00	1,303,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	30,900	2,118.00	65,446,200
日新製鋼	3,200	1,528.00	4,889,600
東京製鐵	6,200	998.00	6,187,600
共英製鋼	1,300	2,132.00	2,771,600
大和工業	2,400	3,325.00	7,980,000
東京鐵鋼	500	1,611.00	805,500
大阪製鐵	800	2,031.00	1,624,800
淀川製鋼所	1,700	2,780.00	4,726,000
東洋鋼鈑	2,900	717.00	2,079,300
丸一鋼管	4,100	3,760.00	15,416,000
モリ工業	400	3,030.00	1,212,000
大同特殊鋼	2,000	5,210.00	10,420,000
日本高周波鋼業	500	824.00	412,000
日本冶金工業	9,600	319.00	3,062,400
山陽特殊製鋼	1,300	2,608.00	3,390,400
愛知製鋼	700	4,265.00	2,985,500
日立金属	12,300	1,122.00	13,800,600
日本金属	300	1,883.00	564,900
大平洋金属	700	3,895.00	2,726,500
新日本電工	6,900	317.00	2,187,300
栗本鐵工所	600	1,968.00	1,180,800
虹技	200	1,899.00	379,800
日本鑄鉄管	1,000	164.00	164,000
三菱製鋼	900	2,155.00	1,939,500
日亜鋼業	1,800	346.00	622,800

日本精線	200	4,245.00	849,000
シンニッタン	1,800	450.00	810,000
新家工業	300	2,080.00	624,000
大紀アルミニウム工業所	1,900	699.00	1,328,100
日本軽金属ホールディングス	33,300	245.00	8,158,500
三井金属鉱業	3,100	4,625.00	14,337,500
東邦亜鉛	600	4,080.00	2,448,000
三菱マテリアル	7,500	3,040.00	22,800,000
住友金属鉱山	14,600	4,238.00	61,874,800
DOWAホールディングス	2,900	3,430.00	9,947,000
古河機械金属	1,900	1,574.00	2,990,600
エス・サイエンス	5,600	72.00	403,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	1,595.00	1,914,000
東邦チタニウム	2,100	958.00	2,011,800
UACJ	1,700	2,407.00	4,091,900
CKサンエツ	200	3,585.00	717,000
古河電気工業	3,800	3,800.00	14,440,000
住友電気工業	42,700	1,626.00	69,430,200
フジクラ	13,800	688.00	9,494,400
昭和電線ホールディングス	1,500	720.00	1,080,000
タツタ電線	2,300	558.00	1,283,400
カナレ電気	200	2,378.00	475,600
平河ヒューテック	600	1,450.00	870,000
リョービ	1,400	3,555.00	4,977,000
アーレスティ	1,400	1,018.00	1,425,200
アサヒホールディングス	2,000	2,164.00	4,328,000
稲葉製作所	700	1,447.00	1,012,900
宮地エンジニアリンググループ	300	1,992.00	597,600
トーカロ	3,200	1,182.00	3,782,400
アルファC o	400	1,558.00	623,200
SUMCO	10,500	2,160.00	22,680,000
川田テクノロジーズ	200	7,520.00	1,504,000
RS Technologies	200	5,440.00	1,088,000
東洋製罐グループホールディングス	7,800	1,875.00	14,625,000
ホッカンホールディングス	3,000	372.00	1,116,000
コロナ	600	1,208.00	724,800
横河ブリッジホールディングス	2,100	2,583.00	5,424,300
駒井ハルテック	300	2,258.00	677,400
高田機工	100	3,140.00	314,000
三和ホールディングス	10,900	1,170.00	12,753,000
文化シャッター	3,400	937.00	3,185,800
三協立山	1,600	1,487.00	2,379,200

アルインコ	800	1,070.00	856,000
東洋シャッター	400	667.00	266,800
LIXILグループ	16,800	2,150.00	36,120,000
日本フィルコン	900	613.00	551,700
ノーリツ	2,500	1,809.00	4,522,500
長府製作所	1,300	2,383.00	3,097,900
リンナイ	2,000	9,900.00	19,800,000
ダイニチ工業	700	793.00	555,100
日東精工	1,600	712.00	1,139,200
三洋工業	200	2,166.00	433,200
岡部	2,300	1,004.00	2,309,200
ジーテクト	1,300	1,931.00	2,510,300
中国工業	200	664.00	132,800
東プレ	2,100	2,705.00	5,680,500
高周波熱錬	2,200	956.00	2,103,200
東京製網	800	1,867.00	1,493,600
サンコール	700	715.00	500,500
モリテック スチール	900	587.00	528,300
パイオラックス	1,700	2,558.00	4,348,600
エイチワン	1,100	1,197.00	1,316,700
日本発條	11,400	1,071.00	12,209,400
中央発條	100	3,735.00	373,500
アドバネクス	200	2,062.00	412,400
立川ブラインド工業	500	1,450.00	725,000
三益半導体工業	900	1,770.00	1,593,000
日本ドライケミカル	200	2,333.00	466,600
日本製鋼所	3,700	2,791.00	10,326,700
三浦工業	5,000	2,705.00	13,525,000
タクマ	3,900	1,402.00	5,467,800
ツガミ	3,000	986.00	2,958,000
オークマ	1,300	5,750.00	7,475,000
東芝機械	6,000	523.00	3,138,000
アマダホールディングス	17,600	1,079.00	18,990,400
アイダエンジニアリング	2,900	1,061.00	3,076,900
滝澤鉄工所	400	1,768.00	707,200
F U J I	3,400	1,924.00	6,541,600
牧野フライス製作所	6,000	859.00	5,154,000
オーエスジー	5,300	2,239.00	11,866,700
ダイジェット工業	200	1,742.00	348,400
旭ダイヤモンド工業	3,400	787.00	2,675,800
D M G 森精機	6,300	1,561.00	9,834,300
ソディック	2,500	1,006.00	2,515,000

ディスコ	1,600	18,780.00	30,048,000
日東工器	700	2,615.00	1,830,500
日進工具	300	2,556.00	766,800
パンチ工業	1,000	1,015.00	1,015,000
富士ダイス	600	859.00	515,400
豊和工業	600	968.00	580,800
OKK	500	1,156.00	578,000
東洋機械金属	900	683.00	614,700
津田駒工業	300	1,833.00	549,900
島精機製作所	1,400	5,280.00	7,392,000
オプトラン	1,100	4,010.00	4,411,000
NCホールディングス	400	764.00	305,600
フリュー	800	985.00	788,000
ヤマシンフィルタ	1,800	1,026.00	1,846,800
日阪製作所	1,600	1,017.00	1,627,200
やまびこ	2,200	1,283.00	2,822,600
平田機工	400	7,790.00	3,116,000
ペガサスミシン製造	1,100	1,032.00	1,135,200
ナブテスコ	6,300	3,400.00	21,420,000
三井海洋開発	1,200	2,902.00	3,482,400
レオン自動機	1,000	2,019.00	2,019,000
SMC	3,600	41,960.00	151,056,000
新川	900	906.00	815,400
ホソカワミクロン	400	6,930.00	2,772,000
ユニオンツール	500	3,540.00	1,770,000
オイレス工業	1,500	2,118.00	3,177,000
日精エー・エス・ビー機械	300	5,730.00	1,719,000
サトーホールディングス	1,500	3,205.00	4,807,500
技研製作所	800	2,532.00	2,025,600
日本エアータック	500	844.00	422,000
カワタ	300	1,595.00	478,500
日精樹脂工業	1,000	1,195.00	1,195,000
オカダアイヨン	400	1,684.00	673,600
ワイエイシイホールディングス	400	874.00	349,600
小松製作所	55,800	3,101.00	173,035,800
住友重機械工業	6,600	3,685.00	24,321,000
日立建機	5,400	3,535.00	19,089,000
日工	300	2,513.00	753,900
巴工業	500	2,296.00	1,148,000
井関農機	1,200	1,948.00	2,337,600
TOWA	900	1,124.00	1,011,600
丸山製作所	300	1,823.00	546,900



北川鉄工所	600	2,627.00	1,576,200
ローツェ	600	2,088.00	1,252,800
タカキタ	400	771.00	308,400
クボタ	62,000	1,806.00	111,972,000
荏原実業	300	2,279.00	683,700
三菱化工機	400	2,021.00	808,400
月島機械	2,300	1,628.00	3,744,400
帝国電機製作所	800	1,345.00	1,076,000
新東工業	2,700	973.00	2,627,100
澁谷工業	1,000	3,315.00	3,315,000
アイチ コーポレーション	2,000	654.00	1,308,000
小森コーポレーション	2,900	1,275.00	3,697,500
鶴見製作所	1,000	1,818.00	1,818,000
住友精密工業	2,000	361.00	722,000
酒井重工業	200	3,550.00	710,000
荏原製作所	4,800	3,300.00	15,840,000
石井鐵工所	200	1,991.00	398,200
西島製作所	1,200	1,038.00	1,245,600
北越工業	1,300	1,075.00	1,397,500
ダイキン工業	15,800	13,435.00	212,273,000
オルガノ	400	3,095.00	1,238,000
トーヨーカネツ	500	3,945.00	1,972,500
栗田工業	6,200	3,010.00	18,662,000
椿本チエイン	7,000	861.00	6,027,000
大同工業	500	1,451.00	725,500
木村化工機	1,000	419.00	419,000
アネスト岩田	1,900	1,161.00	2,205,900
ダイフク	5,900	4,940.00	29,146,000
サムコ	400	1,175.00	470,000
加藤製作所	600	2,745.00	1,647,000
油研工業	200	2,620.00	524,000
タダノ	5,600	1,379.00	7,722,400
フジテック	3,700	1,347.00	4,983,900
C K D	3,200	1,806.00	5,779,200
キトー	900	2,200.00	1,980,000
平和	3,600	2,622.00	9,439,200
理想科学工業	1,200	2,221.00	2,665,200
S A N K Y O	2,900	4,385.00	12,716,500
日本金銭機械	1,100	1,224.00	1,346,400
マースエンジニアリング	700	2,611.00	1,827,700
福島工業	700	5,020.00	3,514,000
オーイズミ	500	566.00	283,000

ダイコク電機	500	1,874.00	937,000
竹内製作所	1,900	2,274.00	4,320,600
アマノ	3,600	2,525.00	9,090,000
J U K I	1,800	1,083.00	1,949,400
サンデンホールディングス	1,400	1,456.00	2,038,400
蛇の目ミシン工業	1,100	698.00	767,800
マックス	1,800	1,384.00	2,491,200
グローリー	3,400	3,085.00	10,489,000
新晃工業	1,200	1,909.00	2,290,800
大和冷機工業	1,900	1,290.00	2,451,000
セガサミーホールディングス	11,500	1,930.00	22,195,000
日本ピストンリング	400	2,287.00	914,800
リケン	500	5,680.00	2,840,000
T P R	1,300	2,593.00	3,370,900
ツバキ・ナカシマ	1,200	2,671.00	3,205,200
ホシザキ	3,700	11,590.00	42,883,000
大豊工業	900	1,245.00	1,120,500
日本精工	23,700	1,145.00	27,136,500
N T N	26,700	446.00	11,908,200
ジェイテクト	12,300	1,509.00	18,560,700
不二越	1,100	4,995.00	5,494,500
日本トムソン	3,700	860.00	3,182,000
T H K	7,200	3,270.00	23,544,000
ユーシン精機	1,000	1,304.00	1,304,000
前澤給装工業	400	1,958.00	783,200
イーグル工業	1,400	1,754.00	2,455,600
前澤工業	900	454.00	408,600
日本ピラー工業	1,200	1,503.00	1,803,600
キッツ	4,700	899.00	4,225,300
マキタ	15,100	4,870.00	73,537,000
日立造船	9,100	507.00	4,613,700
三菱重工業	19,400	3,955.00	76,727,000
I H I	8,900	3,900.00	34,710,000
スター精密	1,800	1,701.00	3,061,800
日清紡ホールディングス	7,000	1,169.00	8,183,000
イビデン	7,100	1,756.00	12,467,600
コニカミノルタ	27,000	1,037.00	27,999,000
ブラザー工業	14,100	2,167.00	30,554,700
ミネベアミツミ	21,300	1,875.00	39,937,500
日立製作所	277,000	781.60	216,503,200
三菱電機	115,600	1,451.00	167,735,600
富士電機	35,000	849.00	29,715,000

東洋電機製造	500	1,828.00	914,000
安川電機	13,300	3,995.00	53,133,500
シンフォニアテクノロジー	7,000	376.00	2,632,000
明電舎	10,000	398.00	3,980,000
オリジン電気	300	2,139.00	641,700
山洋電気	500	7,650.00	3,825,000
デンヨー	1,100	1,741.00	1,915,100
東芝テック	8,000	663.00	5,304,000
芝浦メカトロニクス	1,000	361.00	361,000
マブチモーター	3,200	5,300.00	16,960,000
日本電産	13,900	16,605.00	230,809,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	400	2,483.00	993,200
トレックス・セミコンダクター	300	1,403.00	420,900
東光高岳	600	1,941.00	1,164,600
ダブル・スコープ	1,700	1,715.00	2,915,500
ダイヘン	6,000	655.00	3,930,000
ヤーマン	1,700	1,927.00	3,275,900
JVCケンウッド	8,600	303.00	2,605,800
ミマキエンジニアリング	1,000	881.00	881,000
第一精工	500	1,802.00	901,000
日新電機	2,700	1,003.00	2,708,100
大崎電気工業	2,500	832.00	2,080,000
オムロン	12,300	5,240.00	64,452,000
日東工業	1,900	2,144.00	4,073,600
I D E C	1,400	2,572.00	3,600,800
不二電機工業	100	1,426.00	142,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	21,000	493.00	10,353,000
サクサホールディングス	300	2,356.00	706,800
メルコホールディングス	600	4,095.00	2,457,000
テクノメディカ	300	2,012.00	603,600
日本電気	15,000	3,080.00	46,200,000
富士通	119,000	671.80	79,944,200
沖電気工業	4,700	1,209.00	5,682,300
岩崎通信機	500	819.00	409,500
電気興業	700	3,325.00	2,327,500
サンケン電気	7,000	563.00	3,941,000
ナカヨ	200	1,819.00	363,800
アイホン	700	1,725.00	1,207,500
ルネサスエレクトロニクス	6,000	1,085.00	6,510,000
セイコーエプソン	17,200	1,907.00	32,800,400
ワコム	9,000	617.00	5,553,000
アルバック	2,600	4,300.00	11,180,000

アクセル	500	827.00	413,500
E I Z O	1,100	4,420.00	4,862,000
ジャパンディスプレイ	23,900	148.00	3,537,200
日本信号	3,200	1,048.00	3,353,600
京三製作所	2,700	738.00	1,992,600
能美防災	1,500	2,396.00	3,594,000
ホーチキ	800	2,175.00	1,740,000
星和電機	400	533.00	213,200
エレコム	1,000	2,504.00	2,504,000
パナソニック	132,100	1,487.00	196,432,700
シャープ	10,700	2,492.00	26,664,400
アンリツ	8,400	1,534.00	12,885,600
富士通ゼネラル	3,500	1,596.00	5,586,000
ソニー	77,400	5,491.00	425,003,400
T D K	6,000	11,410.00	68,460,000
帝国通信工業	500	1,254.00	627,000
タムラ製作所	4,500	648.00	2,916,000
アルプス電気	10,000	2,715.00	27,150,000
池上通信機	4,000	149.00	596,000
パイオニア	19,400	155.00	3,007,000
日本電波工業	1,100	555.00	610,500
鈴木	600	952.00	571,200
日本トリム	300	4,740.00	1,422,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,408.00	1,444,800
フォスター電機	1,400	1,546.00	2,164,400
クラリオン	6,000	288.00	1,728,000
S M K	3,000	361.00	1,083,000
ヨコオ	800	1,857.00	1,485,600
ホシデン	2,900	937.00	2,717,300
ヒロセ電機	2,000	13,650.00	27,300,000
日本航空電子工業	3,000	1,709.00	5,127,000
T O A	1,200	1,173.00	1,407,600
マクセルホールディングス	2,300	1,804.00	4,149,200
古野電気	1,400	877.00	1,227,800
ユニデンホールディングス	3,000	319.00	957,000
アルパイン	2,700	2,035.00	5,494,500
スミダコーポレーション	1,200	1,192.00	1,430,400
アイコム	600	2,610.00	1,566,000
リオン	500	2,312.00	1,156,000
本多通信工業	900	946.00	851,400
船井電機	1,200	641.00	769,200
横河電機	11,600	1,911.00	22,167,600

新電元工業	400	5,270.00	2,108,000
アズビル	3,500	4,920.00	17,220,000
東亜ディーケーケー	600	1,196.00	717,600
日本光電工業	4,800	3,075.00	14,760,000
チノー	400	1,602.00	640,800
共和電業	1,300	421.00	547,300
日本電子材料	500	699.00	349,500
堀場製作所	2,300	7,650.00	17,595,000
アドバンテスト	6,400	2,228.00	14,259,200
小野測器	500	860.00	430,000
エスペック	1,000	2,074.00	2,074,000
キーエンス	5,700	64,460.00	367,422,000
日置電機	600	4,385.00	2,631,000
シスメックス	9,000	10,860.00	97,740,000
日本マイクロニクス	1,900	955.00	1,814,500
メガチップス	900	2,935.00	2,641,500
O B A R A G R O U P	700	6,240.00	4,368,000
澤藤電機	100	2,270.00	227,000
コーセル	1,600	1,364.00	2,182,400
イリソ電子工業	1,000	6,420.00	6,420,000
新日本無線	700	750.00	525,000
オブテックスグループ	1,900	3,035.00	5,766,500
千代田インテグレ	500	2,364.00	1,182,000
アイ・オー・データ機器	500	1,201.00	600,500
レーザーテック	2,400	3,290.00	7,896,000
スタンレー電気	8,800	3,830.00	33,704,000
岩崎電気	500	1,597.00	798,500
ウシオ電機	7,000	1,366.00	9,562,000
岡谷電機産業	900	518.00	466,200
ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	687.00	687,000
日本セラミック	1,200	2,947.00	3,536,400
遠藤照明	600	880.00	528,000
古河電池	800	855.00	684,000
双信電機	500	555.00	277,500
山一電機	800	1,512.00	1,209,600
図研	800	1,806.00	1,444,800
日本電子	4,000	1,079.00	4,316,000
カシオ計算機	9,300	1,800.00	16,740,000
ファナック	11,000	22,180.00	243,980,000
日本シイエムケイ	2,000	691.00	1,382,000
エンブラス	500	3,070.00	1,535,000
大真空	400	1,312.00	524,800

ローム	5,200	9,180.00	47,736,000	
浜松ホトニクス	8,300	4,640.00	38,512,000	
三井ハイテック	1,500	1,317.00	1,975,500	
新光電気工業	4,400	943.00	4,149,200	
京セラ	19,000	6,158.00	117,002,000	
太陽誘電	5,200	2,876.00	14,955,200	
村田製作所	12,100	18,125.00	219,312,500	
ユーシン	1,800	711.00	1,279,800	
双葉電子工業	1,900	1,911.00	3,630,900	
北陸電気工業	500	1,231.00	615,500	
ニチコン	3,600	1,348.00	4,852,800	
日本ケミコン	900	4,125.00	3,712,500	
K O A	1,600	2,638.00	4,220,800	
市光工業	1,700	1,321.00	2,245,700	
小糸製作所	6,900	7,570.00	52,233,000	
ミツバ	2,200	966.00	2,125,200	
S C R E E Nホールディングス	2,200	8,230.00	18,106,000	
キャノン電子	1,100	2,233.00	2,456,300	
キャノン	62,200	3,712.00	230,886,400	代用有価証券 10,000株
リコー	34,800	1,017.00	35,391,600	
象印マホービン	2,200	1,582.00	3,480,400	
M U T O Hホールディングス	200	2,375.00	475,000	
東京エレクトロン	7,700	18,635.00	143,489,500	
トヨタ紡織	3,400	2,071.00	7,041,400	
芦森工業	300	2,402.00	720,600	
ユニプレス	2,200	2,238.00	4,923,600	
豊田自動織機	9,400	6,010.00	56,494,000	
モリタホールディングス	1,900	2,281.00	4,333,900	
三櫻工業	1,500	714.00	1,071,000	
デンソー	25,700	5,406.00	138,934,200	
東海理化電機製作所	3,000	2,040.00	6,120,000	
三井E & Sホールディングス	4,200	1,388.00	5,829,600	
川崎重工業	9,000	3,225.00	29,025,000	
名村造船所	3,500	431.00	1,508,500	
サノヤホールディングス	1,400	224.00	313,600	
日本車輛製造	4,000	277.00	1,108,000	
三菱ロジスネクスト	1,400	1,315.00	1,841,000	
近畿車輛	200	2,370.00	474,000	
日産自動車	136,300	1,067.50	145,500,250	
いすゞ自動車	33,500	1,464.00	49,044,000	
トヨタ自動車	140,500	7,091.00	996,285,500	代用有価証券 35,000株

日野自動車	16,500	1,164.00	19,206,000
三菱自動車工業	42,900	865.00	37,108,500
エフテック	700	1,426.00	998,200
レシップホールディングス	500	883.00	441,500
G M B	200	1,445.00	289,000
ファルテック	200	1,196.00	239,200
武蔵精密工業	1,200	3,750.00	4,500,000
日産車体	4,500	975.00	4,387,500
新明和工業	5,000	1,319.00	6,595,000
極東開発工業	2,100	1,657.00	3,479,700
日信工業	2,400	1,960.00	4,704,000
トピー工業	1,000	2,982.00	2,982,000
ティラド	400	3,570.00	1,428,000
曙ブレーキ工業	5,500	286.00	1,573,000
タチエス	1,900	1,841.00	3,497,900
N O K	6,200	2,139.00	13,261,800
フタバ産業	3,500	711.00	2,488,500
K Y B	1,200	5,050.00	6,060,000
大同メタル工業	1,500	1,091.00	1,636,500
プレス工業	6,100	636.00	3,879,600
ミクニ	1,500	557.00	835,500
太平洋工業	2,400	1,657.00	3,976,800
ケーヒン	2,700	2,210.00	5,967,000
河西工業	1,400	1,384.00	1,937,600
アイシン精機	9,500	5,030.00	47,785,000
マツダ	36,300	1,353.50	49,132,050
今仙電機製作所	1,100	1,187.00	1,305,700
本田技研工業	104,000	3,310.00	344,240,000
スズキ	22,900	6,173.00	141,361,700
S U B A R U	35,900	3,184.00	114,305,600
安永	600	1,954.00	1,172,400
ヤマハ発動機	16,300	2,795.00	45,558,500
ショーワ	3,000	1,911.00	5,733,000
T B K	1,400	502.00	702,800
エクセディ	1,400	3,500.00	4,900,000
豊田合成	4,200	2,778.00	11,667,600
愛三工業	2,000	931.00	1,862,000
盟和産業	200	1,270.00	254,000
日本プラスト	600	981.00	588,600
ヨロズ	1,200	1,643.00	1,971,600
エフ・シー・シー	1,900	3,115.00	5,918,500
シマノ	4,700	16,140.00	75,858,000

テイ・エス テック	2,700	4,590.00	12,393,000
ジャムコ	600	2,471.00	1,482,600
テルモ	17,700	6,560.00	116,112,000
クリエートメディック	400	1,413.00	565,200
日機装	4,000	1,125.00	4,500,000
島津製作所	13,800	3,240.00	44,712,000
JMS	1,000	647.00	647,000
長野計器	900	1,254.00	1,128,600
ブイ・テクノロジー	300	20,890.00	6,267,000
東京計器	700	1,221.00	854,700
愛知時計電機	100	4,125.00	412,500
インターアクション	600	1,464.00	878,400
オーバル	1,200	313.00	375,600
東京精密	2,100	3,690.00	7,749,000
マニー	1,400	5,120.00	7,168,000
ニコン	20,200	1,736.00	35,067,200
トプコン	6,200	1,816.00	11,259,200
オリンパス	17,200	4,135.00	71,122,000
理研計器	1,100	2,509.00	2,759,900
タムロン	1,000	2,011.00	2,011,000
H O Y A	23,300	6,358.00	148,141,400
シード	200	6,600.00	1,320,000
ノーリツ鋼機	1,200	1,874.00	2,248,800
エー・アンド・デイ	1,100	1,032.00	1,135,200
シチズン時計	13,800	723.00	9,977,400
リズム時計工業	400	2,110.00	844,000
大研医器	1,100	763.00	839,300
メニコン	1,600	2,904.00	4,646,400
シンシア	100	626.00	62,600
松風	500	1,439.00	719,500
セイコーホールディングス	1,800	2,384.00	4,291,200
ニプロ	8,000	1,300.00	10,400,000
中本パックス	300	1,750.00	525,000
スノーピーク	400	1,486.00	594,400
パラマウントベッドホールディングス	1,200	4,660.00	5,592,000
トランザクション	600	995.00	597,000
S H O - B I	400	438.00	175,200
ニホンフラッシュ	600	2,755.00	1,653,000
前田工織	1,300	1,879.00	2,442,700
永大産業	1,400	540.00	756,000
アートネイチャー	1,200	675.00	810,000
バンダイナムコホールディングス	12,000	4,645.00	55,740,000



アイフィスジャパン	300	740.00	222,000
共立印刷	1,800	374.00	673,200
S H O E I	600	3,770.00	2,262,000
フランスベッドホールディングス	1,400	948.00	1,327,200
パイロットコーポレーション	2,000	6,300.00	12,600,000
萩原工業	700	1,788.00	1,251,600
トッパン・フォームズ	2,400	1,116.00	2,678,400
フジシールインターナショナル	2,600	3,820.00	9,932,000
タカラトミー	4,900	874.00	4,282,600
廣濟堂	1,100	505.00	555,500
A s - m e エステール	400	780.00	312,000
アーク	6,100	121.00	738,100
タカノ	500	1,014.00	507,000
プロネクサス	1,100	1,287.00	1,415,700
ホクシン	1,000	174.00	174,000
ウッドワン	400	1,389.00	555,600
大建工業	900	2,493.00	2,243,700
凸版印刷	32,000	858.00	27,456,000
大日本印刷	15,100	2,471.00	37,312,100
図書印刷	800	985.00	788,000
共同印刷	300	2,818.00	845,400
N I S S H A	2,400	2,230.00	5,352,000
光村印刷	100	2,243.00	224,300
宝印刷	600	1,793.00	1,075,800
アシックス	11,500	1,815.00	20,872,500
ツツミ	400	1,823.00	729,200
小松ウオール工業	400	2,008.00	803,200
ヤマハ	7,800	5,730.00	44,694,000
河合楽器製作所	400	5,650.00	2,260,000
クリナップ	1,100	815.00	896,500
ビジョン	7,000	5,430.00	38,010,000
兼松サステック	100	1,949.00	194,900
キングジム	1,000	1,062.00	1,062,000
リンテック	2,800	3,220.00	9,016,000
イトーキ	2,500	635.00	1,587,500
任天堂	7,100	36,110.00	256,381,000
三菱鉛筆	1,900	2,274.00	4,320,600
タカラスタンダード	2,400	1,812.00	4,348,800
コクヨ	5,600	1,962.00	10,987,200
ナカバヤシ	1,200	686.00	823,200
オカムラ	4,000	1,596.00	6,384,000
美津濃	1,200	4,000.00	4,800,000

東京電力ホールディングス	92,400	509.00	47,031,600
中部電力	35,400	1,647.50	58,321,500
関西電力	47,200	1,564.50	73,844,400
中国電力	16,000	1,409.00	22,544,000
北陸電力	11,400	1,095.00	12,483,000
東北電力	27,100	1,333.00	36,124,300
四国電力	10,400	1,487.00	15,464,800
九州電力	25,500	1,200.00	30,600,000
北海道電力	11,600	730.00	8,468,000
沖縄電力	2,300	2,171.00	4,993,300
電源開発	9,200	2,750.00	25,300,000
エフオン	600	1,633.00	979,800
イーレックス	1,900	1,118.00	2,124,200
東京瓦斯	24,700	2,848.50	70,357,950
大阪瓦斯	22,500	2,204.00	49,590,000
東邦瓦斯	5,700	3,790.00	21,603,000
北海道瓦斯	3,000	308.00	924,000
広島ガス	2,400	379.00	909,600
西部瓦斯	1,400	3,000.00	4,200,000
静岡ガス	3,300	1,022.00	3,372,600
メタウォーター	700	3,125.00	2,187,500
SBSホールディングス	1,100	1,204.00	1,324,400
東武鉄道	12,200	3,420.00	41,724,000
相鉄ホールディングス	3,700	3,400.00	12,580,000
東京急行電鉄	31,400	1,922.00	60,350,800
京浜急行電鉄	15,900	1,818.00	28,906,200
小田急電鉄	17,200	2,357.00	40,540,400
京王電鉄	6,500	5,350.00	34,775,000
京成電鉄	8,100	3,780.00	30,618,000
富士急行	1,600	3,385.00	5,416,000
東日本旅客鉄道	20,800	10,505.00	218,504,000
西日本旅客鉄道	10,400	8,043.00	83,647,200
東海旅客鉄道	10,300	23,590.00	242,977,000
西武ホールディングス	14,700	1,866.00	27,430,200
鴻池運輸	1,600	1,686.00	2,697,600
西日本鉄道	3,200	3,025.00	9,680,000
ハマキョウレックス	800	3,340.00	2,672,000
サカイ引越センター	600	5,660.00	3,396,000
近鉄グループホールディングス	11,000	4,485.00	49,335,000
阪急阪神ホールディングス	14,600	4,430.00	64,678,000
南海電気鉄道	5,200	3,100.00	16,120,000
京阪ホールディングス	4,900	3,910.00	19,159,000

神戸電鉄	300	3,990.00	1,197,000
名古屋鉄道	8,700	2,888.00	25,125,600
山陽電気鉄道	800	2,700.00	2,160,000
日本通運	4,300	8,180.00	35,174,000
ヤマトホールディングス	19,200	3,373.00	64,761,600
山九	2,800	5,970.00	16,716,000
丸運	600	352.00	211,200
丸全昭和運輸	4,000	505.00	2,020,000
センコーグループホールディングス	6,600	898.00	5,926,800
トナミホールディングス	300	6,440.00	1,932,000
ニッコンホールディングス	4,100	2,956.00	12,119,600
日本石油輸送	100	3,235.00	323,500
福山通運	1,600	5,800.00	9,280,000
セイノーホールディングス	8,200	1,983.00	16,260,600
エスライン	300	1,173.00	351,900
神奈川中央交通	300	3,705.00	1,111,500
日立物流	2,400	2,900.00	6,960,000
丸和運輸機関	600	4,005.00	2,403,000
C & F ロジホールディングス	1,200	1,323.00	1,587,600
九州旅客鉄道	9,200	3,455.00	31,786,000
S Gホールディングス	10,300	2,338.00	24,081,400
日本郵船	9,200	2,189.00	20,138,800
商船三井	6,900	2,642.00	18,229,800
川崎汽船	5,100	2,082.00	10,618,200
N S ユナイテッド海運	500	2,087.00	1,043,500
明治海運	1,200	393.00	471,600
飯野海運	5,600	485.00	2,716,000
共栄タンカー	100	1,864.00	186,400
乾汽船	900	1,132.00	1,018,800
日本航空	20,300	4,059.00	82,397,700
A N A ホールディングス	21,300	4,140.00	88,182,000
パスコ	1,000	314.00	314,000
トランコム	300	7,690.00	2,307,000
日新	900	2,591.00	2,331,900
三菱倉庫	3,800	2,378.00	9,036,400
三井倉庫ホールディングス	6,000	340.00	2,040,000
住友倉庫	8,000	682.00	5,456,000
澁澤倉庫	600	1,680.00	1,008,000
東陽倉庫	2,000	361.00	722,000
日本トランスシティ	2,600	537.00	1,396,200
ケイヒン	200	1,605.00	321,000
中央倉庫	600	1,253.00	751,800

川西倉庫	200	1,963.00	392,600
安田倉庫	1,000	909.00	909,000
東洋埠頭	300	1,707.00	512,100
宇徳	900	522.00	469,800
上組	6,700	2,317.00	15,523,900
サンリツ	300	800.00	240,000
キムラユニティー	300	1,136.00	340,800
キューソー流通システム	300	2,767.00	830,100
近鉄エクスプレス	2,100	2,313.00	4,857,300
東海運	600	370.00	222,000
エーアイティー	800	1,161.00	928,800
内外トランスライン	400	1,572.00	628,800
日本コンセプト	200	1,445.00	289,000
NEC ネットエスアイ	1,300	2,450.00	3,185,000
システナ	3,600	1,199.00	4,316,400
デジタルアーツ	600	5,630.00	3,378,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,700	2,854.00	4,851,800
キューブシステム	700	968.00	677,600
エイジア	300	1,553.00	465,900
コア	500	1,392.00	696,000
ソリトンシステムズ	500	996.00	498,000
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,699.00	1,019,400
T I S	3,800	4,955.00	18,829,000
ネオス	500	438.00	219,000
電算システム	400	2,091.00	836,400
グリー	6,100	597.00	3,641,700
コーエーテクモホールディングス	1,900	2,220.00	4,218,000
三菱総合研究所	400	4,775.00	1,910,000
ボルテージ	300	837.00	251,100
電算	100	2,228.00	222,800
A G S	700	881.00	616,700
ファインデックス	900	839.00	755,100
ヒト・コミュニケーションズ	300	2,076.00	622,800
ブレインパッド	300	3,875.00	1,162,500
K L a b	2,200	1,461.00	3,214,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	800	2,340.00	1,872,000
イーブクイニシアティブジャパン	200	1,182.00	236,400
ネクソン	25,500	1,597.00	40,723,500
アイスタイル	2,900	1,131.00	3,279,900
エムアップ	400	1,619.00	647,600
エイチーム	700	2,373.00	1,661,100
テクノスジャパン	1,000	985.00	985,000

コロプラ	3,300	732.00	2,415,600
モバイルクリエイト	1,000	315.00	315,000
オルトプラス	700	687.00	480,900
ブロードリーフ	5,600	606.00	3,393,600
クロス・マーケティンググループ	300	666.00	199,800
ハーツユナイテッドグループ	600	1,612.00	967,200
メディアドゥホールディングス	400	2,347.00	938,800
ブイキューブ	700	559.00	391,300
サイバーリンクス	200	1,101.00	220,200
ディー・エル・イー	800	574.00	459,200
フィックスターズ	1,100	1,553.00	1,708,300
VOYAGE GROUP	600	1,158.00	694,800
オブティム	200	2,587.00	517,400
セレス	400	1,624.00	649,600
ペリサーブ	200	3,505.00	701,000
ティーガイア	1,100	2,995.00	3,294,500
セック	100	3,115.00	311,500
日本アジアグループ	1,200	483.00	579,600
豆蔵ホールディングス	800	967.00	773,600
テクマトリックス	600	2,224.00	1,334,400
プロシップ	200	2,588.00	517,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,900	282.00	8,713,800
GMOペイメントゲートウェイ	900	13,490.00	12,141,000
ザッパラス	600	372.00	223,200
システムリサーチ	100	3,230.00	323,000
インターネットイニシアティブ	1,900	2,260.00	4,294,000
さくらインターネット	1,400	832.00	1,164,800
ヴィンクス	300	1,039.00	311,700
GMOクラウド	200	3,070.00	614,000
SRAホールディングス	600	2,890.00	1,734,000
Minor iソリューションズ	200	1,620.00	324,000
システムインテグレータ	200	1,019.00	203,800
朝日ネット	1,000	517.00	517,000
eBASE	300	1,670.00	501,000
アバント	300	944.00	283,200
アドソル日進	400	1,658.00	663,200
フリービット	800	1,366.00	1,092,800
コムチュア	600	2,779.00	1,667,400
サイバーコム	200	1,881.00	376,200
インフォテリア	600	1,023.00	613,800
メディカル・データ・ビジョン	900	1,549.00	1,394,100
gumi	1,300	749.00	973,700

ショーケース・ティービー	200	1,320.00	264,000
モバイルファクトリー	300	1,690.00	507,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,115.00	557,500
P C Iホールディングス	200	3,060.00	612,000
パイブドHD	200	1,054.00	210,800
アイビーシー	200	2,108.00	421,600
ネオジャパン	300	1,771.00	531,300
オープンドア	500	2,098.00	1,049,000
マイネット	300	1,291.00	387,300
アカツキ	300	4,045.00	1,213,500
ベネフィットジャパン	100	1,293.00	129,300
U b i c o mホールディングス	200	1,046.00	209,200
L I N E	3,400	4,575.00	15,555,000
シンクロ・フード	400	990.00	396,000
オークネット	500	1,491.00	745,500
A O I T Y O H o l d i n g s	900	1,376.00	1,238,400
マクロミル	1,400	2,666.00	3,732,400
ビーグリー	300	1,603.00	480,900
オロ	100	3,060.00	306,000
ソルクシーズ	400	1,325.00	530,000
フェイス	400	1,368.00	547,200
ハイマックス	200	1,801.00	360,200
野村総合研究所	7,200	5,480.00	39,456,000
サイバネットシステム	900	883.00	794,700
C Eホールディングス	300	790.00	237,000
日本システム技術	200	1,517.00	303,400
インテージホールディングス	1,300	1,203.00	1,563,900
東邦システムサイエンス	400	873.00	349,200
ソースネクスト	1,600	803.00	1,284,800
フォーカスシステムズ	700	809.00	566,300
クレスコ	300	3,205.00	961,500
フジ・メディア・ホールディングス	11,900	1,849.00	22,003,100
オービック	3,600	9,230.00	33,228,000
ジャストシステム	1,900	2,224.00	4,225,600
T D Cソフト	500	1,648.00	824,000
ヤフー	81,700	370.00	30,229,000
トレンドマイクロ	5,500	6,140.00	33,770,000
インフォメーション・ディベロプメント	300	1,340.00	402,000
日本オラクル	1,800	8,500.00	15,300,000
アルファシステムズ	400	2,318.00	927,200
フューチャー	1,500	1,377.00	2,065,500
C A C H o l d i n g s	800	1,067.00	853,600

ソフトバンク・テクノロジー	500	1,565.00	782,500
トーセ	300	1,062.00	318,600
オービックビジネスコンサルタント	600	7,810.00	4,686,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,100	1,909.00	9,735,900
アイティフォー	1,400	1,241.00	1,737,400
東計電算	200	3,050.00	610,000
エクスネット	200	900.00	180,000
大塚商会	6,800	4,500.00	30,600,000
サイボウズ	1,500	541.00	811,500
ソフトブレーン	900	649.00	584,100
電通国際情報サービス	700	3,265.00	2,285,500
デジタルガレージ	2,000	4,350.00	8,700,000
E Mシステムズ	800	1,138.00	910,400
ウェザーニューズ	400	3,315.00	1,326,000
C I J	900	690.00	621,000
東洋ビジネスエンジニアリング	100	2,026.00	202,600
日本エンタープライズ	1,300	217.00	282,100
WOWOW	600	3,490.00	2,094,000
スカラ	900	1,012.00	910,800
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,000	898.00	898,000
ネットワンシステムズ	4,600	1,884.00	8,666,400
システムソフト	2,800	138.00	386,400
アルゴグラフィックス	500	3,540.00	1,770,000
マーベラス	1,900	901.00	1,711,900
エイベックス	2,100	1,483.00	3,114,300
日本ユニシス	3,200	2,660.00	8,512,000
兼松エレクトロニクス	700	3,950.00	2,765,000
東京放送ホールディングス	6,300	2,491.00	15,693,300
日本テレビホールディングス	10,400	1,862.00	19,364,800
朝日放送グループホールディングス	1,100	838.00	921,800
テレビ朝日ホールディングス	3,100	2,383.00	7,387,300
スカパーJ S A Tホールディングス	8,600	509.00	4,377,400
テレビ東京ホールディングス	900	3,400.00	3,060,000
日本BS放送	400	1,346.00	538,400
ビジョン	300	3,650.00	1,095,000
USEN-NEXT HOLDINGS	400	1,197.00	478,800
ワイヤレスゲート	600	1,292.00	775,200
コネクシオ	900	1,851.00	1,665,900
クロップス	300	867.00	260,100
日本電信電話	81,500	5,137.00	418,665,500
KDDI	102,200	3,016.00	308,235,200
光通信	1,400	20,120.00	28,168,000

NTTドコモ	81,600	2,807.50	229,092,000
エムティーアイ	1,300	605.00	786,500
GMOインターネット	4,100	2,703.00	11,082,300
アйдママーケティングコミュニケーション	300	917.00	275,100
カドカワ	3,300	1,216.00	4,012,800
学研ホールディングス	400	5,110.00	2,044,000
ゼンリン	2,000	2,578.00	5,156,000
昭文社	600	767.00	460,200
インプレスホールディングス	1,100	167.00	183,700
アイネット	600	1,767.00	1,060,200
松竹	800	16,310.00	13,048,000
東宝	7,400	3,820.00	28,268,000
東映	400	11,410.00	4,564,000
エヌ・ティ・ティ・データ	35,200	1,266.00	44,563,200
ピー・シー・エー	200	1,802.00	360,400
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,273.00	454,600
D T S	1,200	4,205.00	5,046,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,300	5,630.00	29,839,000
シーイーシー	700	4,065.00	2,845,500
カブコン	4,900	2,678.00	13,122,200
アイ・エス・ビー	200	1,902.00	380,400
ジャステック	600	1,152.00	691,200
S C S K	2,600	5,210.00	13,546,000
日本システムウエア	400	2,201.00	880,400
アイネス	1,400	1,101.00	1,541,400
T K C	1,000	4,030.00	4,030,000
富士ソフト	1,600	4,635.00	7,416,000
N S D	1,800	2,517.00	4,530,600
コナミホールディングス	4,600	5,750.00	26,450,000
福井コンピュータホールディングス	300	1,889.00	566,700
J B C Cホールディングス	900	1,162.00	1,045,800
ミロク情報サービス	1,000	2,807.00	2,807,000
ソフトバンクグループ	51,400	8,198.00	421,377,200
ハウスイ	100	1,127.00	112,700
高千穂交易	500	1,158.00	579,000
伊藤忠食品	300	6,120.00	1,836,000
エレマテック	500	2,690.00	1,345,000
J A L U X	300	2,999.00	899,700
あらた	600	6,540.00	3,924,000
トーメンデバイス	200	2,876.00	575,200
東京エレクトロン デバイス	400	1,959.00	783,600
フィールズ	900	976.00	878,400



双日	67,400	405.00	27,297,000
アルフレッサ ホールディングス	12,600	2,630.00	33,138,000
横浜冷凍	2,900	1,008.00	2,923,200
神栄	200	1,420.00	284,000
ラサ商事	500	956.00	478,000
ラクーン	800	561.00	448,800
アルコニックス	1,200	1,644.00	1,972,800
神戸物産	700	5,010.00	3,507,000
ペッパーフードサービス	800	4,755.00	3,804,000
あい ホールディングス	1,800	2,416.00	4,348,800
ディーブイエックス	400	1,385.00	554,000
ダイワボウホールディングス	1,000	5,960.00	5,960,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,200	1,721.00	3,786,200
ラクト・ジャパン	200	6,060.00	1,212,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,100	1,124.00	2,360,400
八洲電機	900	954.00	858,600
メディアスホールディングス	600	1,035.00	621,000
U K Cホールディングス	700	2,314.00	1,619,800
ジューテックホールディングス	300	1,155.00	346,500
大光	300	778.00	233,400
O C H Iホールディングス	300	1,437.00	431,100
T O K A Iホールディングス	6,000	1,078.00	6,468,000
C o m i n i x	200	914.00	182,800
三洋貿易	600	2,148.00	1,288,800
ビューティガレージ	200	2,218.00	443,600
ウイン・パートナーズ	800	1,470.00	1,176,000
ミタチ産業	300	950.00	285,000
シップヘルスケアホールディングス	2,400	4,080.00	9,792,000
明治電機工業	400	1,950.00	780,000
デリカフーズホールディングス	300	1,600.00	480,000
スターティアホールディングス	300	667.00	200,100
コメダホールディングス	2,100	2,154.00	4,523,400
富士興産	400	625.00	250,000
協栄産業	100	2,076.00	207,600
小野建	1,000	1,897.00	1,897,000
佐島電機	800	1,052.00	841,600
エコートレーディング	200	711.00	142,200
伯東	700	1,641.00	1,148,700
コンドーテック	900	1,019.00	917,100
中山福	700	746.00	522,200
ナガイレーベン	1,600	2,812.00	4,499,200
三菱食品	1,200	2,927.00	3,512,400

松田産業	800	1,646.00	1,316,800
第一興商	1,700	5,270.00	8,959,000
メディパルホールディングス	11,400	2,250.00	25,650,000
S P K	200	2,813.00	562,600
萩原電気ホールディングス	400	3,200.00	1,280,000
アズワン	900	7,770.00	6,993,000
スズデン	400	1,608.00	643,200
シモジマ	700	1,123.00	786,100
ドウシシャ	1,200	2,501.00	3,001,200
小津産業	300	2,085.00	625,500
高速	700	1,342.00	939,400
たけびし	400	1,665.00	666,000
リックス	300	1,937.00	581,100
丸文	1,000	852.00	852,000
ハピネット	800	1,363.00	1,090,400
橋本総業ホールディングス	300	1,783.00	534,900
日本ライフライン	3,200	2,715.00	8,688,000
エクセル	500	2,554.00	1,277,000
マルカキカイ	400	1,945.00	778,000
I D O M	3,500	627.00	2,194,500
日本エム・ディ・エム	800	1,052.00	841,600
進和	700	2,415.00	1,690,500
エスケイジャパン	300	445.00	133,500
ダイトロン	500	2,260.00	1,130,000
シークス	1,400	2,320.00	3,248,000
田中商事	400	705.00	282,000
オーハシテクニカ	700	1,802.00	1,261,400
白銅	400	2,316.00	926,400
伊藤忠商事	83,500	2,005.00	167,417,500
丸紅	93,500	827.90	77,408,650
高島	200	2,137.00	427,400
長瀬産業	6,800	1,741.00	11,838,800
蝶理	700	1,937.00	1,355,900
豊田通商	12,700	3,735.00	47,434,500
三共生興	1,900	463.00	879,700
兼松	4,900	1,645.00	8,060,500
ツカモトコーポレーション	200	1,212.00	242,400
三井物産	93,800	1,808.50	169,637,300
日本紙パルプ商事	600	5,100.00	3,060,000
日立ハイテクノロジーズ	3,900	4,390.00	17,121,000
カメイ	1,500	1,682.00	2,523,000
東都水産	200	1,888.00	377,600

OUGホールディングス	200	2,787.00	557,400
スターゼン	500	5,990.00	2,995,000
山善	4,400	1,080.00	4,752,000
椿本興業	300	3,875.00	1,162,500
住友商事	71,800	1,814.00	130,245,200
内田洋行	500	3,650.00	1,825,000
三菱商事	79,900	3,083.00	246,331,700
第一実業	500	3,360.00	1,680,000
キャノンマーケティングジャパン	3,200	2,260.00	7,232,000
西華産業	700	2,448.00	1,713,600
佐藤商事	1,000	1,272.00	1,272,000
菱洋エレクトロ	1,100	1,730.00	1,903,000
東京産業	1,200	619.00	742,800
ユアサ商事	1,100	3,570.00	3,927,000
神鋼商事	300	2,983.00	894,900
小林産業	800	342.00	273,600
阪和興業	2,100	4,275.00	8,977,500
正栄食品工業	600	3,795.00	2,277,000
カナデン	1,100	1,406.00	1,546,600
菱電商事	800	1,840.00	1,472,000
フルサト工業	600	1,819.00	1,091,400
岩谷産業	2,500	3,820.00	9,550,000
すてきナイスグループ	500	1,335.00	667,500
昭光通商	5,000	101.00	505,000
ニチモウ	200	1,681.00	336,200
極東貿易	1,000	421.00	421,000
イワキ	1,600	434.00	694,400
三愛石油	3,100	1,339.00	4,150,900
稲畑産業	2,700	1,532.00	4,136,400
G S Iクレオス	300	1,506.00	451,800
明和産業	1,100	497.00	546,700
ワキタ	2,400	1,143.00	2,743,200
東邦ホールディングス	3,300	2,650.00	8,745,000
サンゲツ	3,800	2,251.00	8,553,800
ミツウロコグループホールディングス	1,600	848.00	1,356,800
シナネンホールディングス	500	2,722.00	1,361,000
伊藤忠エネクス	2,500	1,043.00	2,607,500
サンリオ	3,200	2,055.00	6,576,000
サンワテクノス	700	1,574.00	1,101,800
リョーサン	1,400	3,840.00	5,376,000
新光商事	1,300	1,754.00	2,280,200
トーヨー	500	2,597.00	1,298,500

三信電気	1,100	1,900.00	2,090,000
東陽テクニカ	1,300	892.00	1,159,600
モスフードサービス	1,500	3,255.00	4,882,500
加賀電子	1,000	2,561.00	2,561,000
ソーダニッカ	1,200	731.00	877,200
立花エレテック	800	2,089.00	1,671,200
フォーバル	500	884.00	442,000
PALTAC	1,600	6,030.00	9,648,000
三谷産業	1,300	344.00	447,200
太平洋興発	500	967.00	483,500
西本Wismettacホールディングス	300	5,720.00	1,716,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,502.00	150,200
ヤマタネ	600	2,288.00	1,372,800
丸紅建材リース	1,000	242.00	242,000
日鉄住金物産	900	5,500.00	4,950,000
泉州電業	400	3,330.00	1,332,000
トラスコ中山	2,400	2,789.00	6,693,600
オートバックスセブン	4,500	1,955.00	8,797,500
モリト	900	1,009.00	908,100
加藤産業	1,800	3,780.00	6,804,000
イノテック	1,000	1,367.00	1,367,000
イエローハット	1,100	3,190.00	3,509,000
JKホールディングス	1,100	879.00	966,900
日伝	900	2,096.00	1,886,400
北沢産業	1,000	260.00	260,000
杉本商事	600	1,890.00	1,134,000
因幡電機産業	1,500	4,550.00	6,825,000
バイテックホールディングス	500	2,243.00	1,121,500
東テク	400	2,638.00	1,055,200
ミスミグループ本社	13,200	3,165.00	41,778,000
アルテック	1,000	308.00	308,000
タキヒヨー	400	2,407.00	962,800
蔵王産業	200	1,672.00	334,400
スズケン	5,200	4,690.00	24,388,000
ジェコス	800	1,078.00	862,400
ルネサスイーストン	1,000	568.00	568,000
ローソン	2,900	6,960.00	20,184,000
サンエー	900	5,470.00	4,923,000
カワチ薬品	900	2,264.00	2,037,600
エービーシー・マート	2,100	6,220.00	13,062,000
ハードオフコーポレーション	500	968.00	484,000
アスクル	1,000	3,435.00	3,435,000

ゲオホールディングス	2,100	1,465.00	3,076,500
アダストリア	1,700	1,442.00	2,451,400
ジーフット	700	770.00	539,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	785.00	157,000
くらコーポレーション	700	7,170.00	5,019,000
キャンドウ	500	1,771.00	885,500
パルグループホールディングス	600	2,723.00	1,633,800
エディオン	4,400	1,084.00	4,769,600
サーラコーポレーション	2,000	696.00	1,392,000
ワッツ	400	1,120.00	448,000
ハローズ	400	2,640.00	1,056,000
あみやき亭	300	4,665.00	1,399,500
ひらまつ	1,700	506.00	860,200
大黒天物産	300	5,110.00	1,533,000
ハニーズホールディングス	1,100	962.00	1,058,200
ファーマライズホールディングス	300	670.00	201,000
アルペン	900	2,417.00	2,175,300
ハブ	300	1,150.00	345,000
クオール	1,200	2,086.00	2,503,200
ジーンズ	800	6,600.00	5,280,000
ビックカメラ	6,100	1,666.00	10,162,600
D C Mホールディングス	6,100	1,060.00	6,466,000
MonotaRO	4,100	5,060.00	20,746,000
東京一番フーズ	300	680.00	204,000
DDホールディングス	300	2,749.00	824,700
きちり	400	1,021.00	408,400
アークランドサービスホールディングス	900	2,499.00	2,249,100
J.フロント リテイリング	13,600	1,695.00	23,052,000
ドトール・日レスホールディングス	2,000	2,158.00	4,316,000
マツモトキヨシホールディングス	4,700	5,040.00	23,688,000
ブロンコビリー	600	4,725.00	2,835,000
スタートトゥデイ	11,200	4,400.00	49,280,000
トレジャー・ファクトリー	300	724.00	217,200
物語コーポレーション	300	10,930.00	3,279,000
ココカラファイン	1,200	6,870.00	8,244,000
三越伊勢丹ホールディングス	21,300	1,368.00	29,138,400
Hamee	300	1,522.00	456,600
ウエルシアホールディングス	3,000	5,810.00	17,430,000
クリエイティブSDホールディングス	1,700	3,205.00	5,448,500
丸善CHIホールディングス	1,200	382.00	458,400
ミサワ	300	463.00	138,900
ティーライフ	200	1,367.00	273,400

エー・ピーカンパニー	200	696.00	139,200
チムニー	300	2,910.00	873,000
シュッピン	700	1,620.00	1,134,000
ネクステージ	1,200	1,309.00	1,570,800
ジョイフル本田	3,200	1,704.00	5,452,800
鳥貴族	400	2,549.00	1,019,600
キリン堂ホールディングス	400	2,682.00	1,072,800
ホットランド	700	1,391.00	973,700
すかいらーく	7,100	1,663.00	11,807,300
綿半ホールディングス	400	3,260.00	1,304,000
ヨシックス	200	3,305.00	661,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,800	1,423.00	5,407,400
ブックオフコーポレーション	700	785.00	549,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	1,099.00	549,500
B E E N O S	300	1,647.00	494,100
あさひ	900	1,430.00	1,287,000
日本調剤	400	2,854.00	1,141,600
コスモス薬品	600	22,440.00	13,464,000
トーエル	600	927.00	556,200
一六堂	300	409.00	122,700
オンリー	200	921.00	184,200
セブン&アイ・ホールディングス	47,700	4,780.00	228,006,000
薬王堂	500	3,705.00	1,852,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,000	1,655.00	4,965,000
ツルハホールディングス	2,500	14,190.00	35,475,000
サンマルクホールディングス	800	2,768.00	2,214,400
フェリシモ	300	1,374.00	412,200
トリドールホールディングス	1,400	2,678.00	3,749,200
T O K Y O B A S E	1,000	900.00	900,000
サツドラホールディングス	200	2,186.00	437,200
ダイユー・リックホールディングス	500	1,131.00	565,500
パロックジャパンリミテッド	900	968.00	871,200
クスリのアオキホールディングス	900	7,520.00	6,768,000
力の源ホールディングス	300	1,447.00	434,100
スシローグローバルホールディングス	1,300	6,510.00	8,463,000
L I X I L ビバ	1,500	1,717.00	2,575,500
メディカルシステムネットワーク	1,300	487.00	633,100
総合メディカル	1,000	2,308.00	2,308,000
はるやまホールディングス	500	1,023.00	511,500
ノジマ	2,000	2,524.00	5,048,000
カップ・クリエイト	1,500	1,453.00	2,179,500

ライトオン	1,000	1,019.00	1,019,000
ジーンズメイト	400	701.00	280,400
良品計画	1,500	39,000.00	58,500,000
三城ホールディングス	1,400	493.00	690,200
アドヴァン	1,100	952.00	1,047,200
アルビス	400	3,225.00	1,290,000
コナカ	1,400	509.00	712,600
ハウス オブ ローゼ	200	1,753.00	350,600
G - 7ホールディングス	300	3,000.00	900,000
イオン北海道	1,100	802.00	882,200
コジマ	1,700	538.00	914,600
ヒマラヤ	400	1,161.00	464,400
コーナン商事	1,600	2,619.00	4,190,400
エコス	500	1,669.00	834,500
ワタミ	1,400	1,456.00	2,038,400
マルシェ	400	815.00	326,000
ドンキホーテホールディングス	7,400	5,360.00	39,664,000
西松屋チェーン	2,500	1,296.00	3,240,000
ゼンショーホールディングス	5,900	2,810.00	16,579,000
幸楽苑ホールディングス	700	1,715.00	1,200,500
ハークスレイ	200	1,100.00	220,000
サイゼリヤ	1,900	2,517.00	4,782,300
V Tホールディングス	3,900	559.00	2,180,100
魚力	300	1,491.00	447,300
ポブラ	300	878.00	263,400
フジ・コーポレーション	200	2,651.00	530,200
ユナイテッドアローズ	1,400	4,140.00	5,796,000
ハイデイ日高	1,500	2,695.00	4,042,500
京都きもの友禅	800	646.00	516,800
コロワイド	3,800	2,961.00	11,251,800
ピーシーデポコーポレーション	1,700	555.00	943,500
壱番屋	800	4,995.00	3,996,000
トップカルチャー	500	408.00	204,000
P L A N T	300	1,306.00	391,800
スギホールディングス	2,500	6,640.00	16,600,000
ヴィア・ホールディングス	1,400	720.00	1,008,000
スクロール	1,800	556.00	1,000,800
ヨンドシーホールディングス	1,200	2,626.00	3,151,200
ユニー・ファミリーマートホールディングス	3,700	12,270.00	45,399,000
木曽路	1,400	2,805.00	3,927,000
S R Sホールディングス	1,400	1,017.00	1,423,800
千趣会	2,100	541.00	1,136,100

タカキュー	900	215.00	193,500
ケーヨー	2,100	562.00	1,180,200
上新電機	1,300	3,550.00	4,615,000
日本瓦斯	2,100	6,310.00	13,251,000
ロイヤルホールディングス	2,000	2,979.00	5,958,000
東天紅	100	1,709.00	170,900
いなげや	1,300	1,797.00	2,336,100
島忠	2,600	3,475.00	9,035,000
チヨダ	1,300	2,526.00	3,283,800
ライフコーポレーション	800	2,735.00	2,188,000
リンガーハット	1,400	2,590.00	3,626,000
さが美グループホールディングス	1,000	149.00	149,000
MrMaxHD	1,400	687.00	961,800
テンアライド	1,200	472.00	566,400
AOKIホールディングス	2,300	1,590.00	3,657,000
オークワ	2,000	1,135.00	2,270,000
コメリ	1,800	2,814.00	5,065,200
青山商事	2,200	3,815.00	8,393,000
しまむら	1,300	11,160.00	14,508,000
はせがわ	600	496.00	297,600
高島屋	18,000	926.00	16,668,000
松屋	2,300	1,701.00	3,912,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,400	1,689.00	9,120,600
近鉄百貨店	400	4,040.00	1,616,000
パルコ	1,100	1,259.00	1,384,900
丸井グループ	10,900	2,339.00	25,495,100
アクシアル リテイリング	900	4,115.00	3,703,500
イオン	43,800	2,372.50	103,915,500
イズミ	2,100	6,980.00	14,658,000
東武ストア	100	3,090.00	309,000
平和堂	2,300	2,598.00	5,975,400
フジ	1,300	2,292.00	2,979,600
ヤオコー	1,300	6,070.00	7,891,000
ゼビオホールディングス	1,500	1,752.00	2,628,000
ケーズホールディングス	10,000	1,135.00	11,350,000
Olympicグループ	700	939.00	657,300
日産東京販売ホールディングス	1,700	357.00	606,900
Genky DrugStores	500	4,290.00	2,145,000
アインホールディングス	1,500	8,330.00	12,495,000
元気寿司	300	3,460.00	1,038,000
ヤマダ電機	38,100	537.00	20,459,700
アーランドサカモト	1,900	1,618.00	3,074,200



ニトリホールディングス	4,500	18,305.00	82,372,500	
愛眼	900	435.00	391,500	
ケーユーホールディングス	600	953.00	571,800	
吉野家ホールディングス	3,700	2,195.00	8,121,500	
松屋フーズ	600	3,725.00	2,235,000	
サガミチェーン	1,500	1,403.00	2,104,500	
関西スーパーマーケット	900	1,214.00	1,092,600	
王将フードサービス	800	6,290.00	5,032,000	
プレナス	1,300	1,821.00	2,367,300	
ミニストップ	800	2,219.00	1,775,200	
アークス	2,100	2,928.00	6,148,800	
パローホールディングス	2,600	2,451.00	6,372,600	
藤久	100	1,497.00	149,700	
ベルク	500	5,850.00	2,925,000	
大庄	600	1,766.00	1,059,600	
ファーストリテイリング	1,500	51,640.00	77,460,000	
サンドラッグ	4,800	4,500.00	21,600,000	
サックスパー ホールディングス	1,100	985.00	1,083,500	
ヤマザワ	200	1,865.00	373,000	
やまや	200	3,270.00	654,000	
ベルーナ	2,800	1,383.00	3,872,400	
島根銀行	300	1,247.00	374,100	
じもとホールディングス	7,800	164.00	1,279,200	
めぶきフィナンシャルグループ	59,300	363.00	21,525,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,500	2,498.00	3,747,000	
九州フィナンシャルグループ	18,800	522.00	9,813,600	
ゆうちょ銀行	32,200	1,275.00	41,055,000	
富山第一銀行	2,800	472.00	1,321,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68,100	568.00	38,680,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,300	1,211.00	8,840,300	
関西みらいフィナンシャルグループ	5,000	791.00	3,955,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,000	2,011.00	2,011,000	
新生銀行	9,900	1,697.00	16,800,300	
あおぞら銀行	6,800	4,300.00	29,240,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	798,400	625.00	499,000,000	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	125,200	586.40	73,417,280	
三井住友トラスト・ホールディングス	22,200	4,375.00	97,125,000	
三井住友フィナンシャルグループ	86,300	4,273.00	368,759,900	代用有価証券 10,000株
第四銀行	1,400	4,390.00	6,146,000	
北越銀行	1,100	2,198.00	2,417,800	
千葉銀行	40,400	779.00	31,471,600	

群馬銀行	23,200	586.00	13,595,200
武蔵野銀行	1,800	3,300.00	5,940,000
千葉興業銀行	3,300	470.00	1,551,000
筑波銀行	4,800	262.00	1,257,600
七十七銀行	3,600	2,392.00	8,611,200
青森銀行	900	3,215.00	2,893,500
秋田銀行	700	2,993.00	2,095,100
山形銀行	1,300	2,349.00	3,053,700
岩手銀行	800	4,205.00	3,364,000
東邦銀行	10,200	401.00	4,090,200
東北銀行	600	1,353.00	811,800
みちのく銀行	700	1,756.00	1,229,200
ふくおかフィナンシャルグループ	46,000	546.00	25,116,000
静岡銀行	30,000	1,011.00	30,330,000
十六銀行	1,500	2,895.00	4,342,500
スルガ銀行	11,700	959.00	11,220,300
八十二銀行	20,600	478.00	9,846,800
山梨中央銀行	7,000	418.00	2,926,000
大垣共立銀行	1,800	2,802.00	5,043,600
福井銀行	1,000	2,348.00	2,348,000
北國銀行	1,300	4,440.00	5,772,000
清水銀行	400	2,139.00	855,600
富山銀行	200	4,275.00	855,000
滋賀銀行	11,000	562.00	6,182,000
南都銀行	1,300	2,850.00	3,705,000
百五銀行	10,900	440.00	4,796,000
京都銀行	4,300	5,110.00	21,973,000
紀陽銀行	4,300	1,797.00	7,727,100
ほくほくフィナンシャルグループ	7,600	1,484.00	11,278,400
広島銀行	16,800	740.00	12,432,000
山陰合同銀行	6,700	985.00	6,599,500
中国銀行	7,900	1,145.00	9,045,500
鳥取銀行	400	1,695.00	678,000
伊予銀行	16,200	737.00	11,939,400
百十四銀行	12,000	358.00	4,296,000
四国銀行	1,700	1,331.00	2,262,700
阿波銀行	9,000	682.00	6,138,000
大分銀行	600	3,755.00	2,253,000
宮崎銀行	800	3,335.00	2,668,000
佐賀銀行	700	2,430.00	1,701,000
十八銀行	7,000	283.00	1,981,000
沖縄銀行	1,100	4,025.00	4,427,500

琉球銀行	2,200	1,643.00	3,614,600
セブン銀行	42,800	339.00	14,509,200
みずほフィナンシャルグループ	1,549,300	186.10	288,324,730
高知銀行	400	1,184.00	473,600
山口フィナンシャルグループ	14,000	1,255.00	17,570,000
長野銀行	400	1,827.00	730,800
名古屋銀行	900	3,860.00	3,474,000
北洋銀行	17,200	360.00	6,192,000
愛知銀行	400	4,790.00	1,916,000
中京銀行	500	2,256.00	1,128,000
大光銀行	400	2,162.00	864,800
愛媛銀行	1,600	1,247.00	1,995,200
トマト銀行	400	1,508.00	603,200
京葉銀行	10,000	467.00	4,670,000
栃木銀行	5,900	382.00	2,253,800
北日本銀行	400	2,592.00	1,036,800
東和銀行	2,000	1,111.00	2,222,000
福島銀行	1,100	689.00	757,900
大東銀行	500	1,206.00	603,000
トモニホールディングス	9,400	457.00	4,295,800
フィデアホールディングス	11,000	169.00	1,859,000
池田泉州ホールディングス	12,100	372.00	4,501,200
F P G	3,700	1,467.00	5,427,900
マーキュリアインベストメント	300	1,041.00	312,300
S B Iホールディングス	12,900	2,965.00	38,248,500
ジャフコ	1,600	4,585.00	7,336,000
大和証券グループ本社	97,600	634.40	61,917,440
野村ホールディングス	196,100	540.20	105,933,220
岡三証券グループ	10,000	532.00	5,320,000
丸三証券	3,700	1,017.00	3,762,900
東洋証券	4,000	256.00	1,024,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12,700	715.00	9,080,500
光世証券	300	1,289.00	386,700
水戸証券	3,300	397.00	1,310,100
いちよし証券	2,400	1,207.00	2,896,800
松井証券	5,600	1,047.00	5,863,200
だいこう証券ビジネス	600	600.00	360,000
マネックスグループ	11,700	643.00	7,523,100
カブドットコム証券	7,200	360.00	2,592,000
極東証券	1,500	1,426.00	2,139,000
岩井コスモホールディングス	1,200	1,427.00	1,712,400
藍澤証券	2,200	778.00	1,711,600

マナーパートナーズグループ	1,500	397.00	595,500
かんぽ生命保険	4,300	2,325.00	9,997,500
S O M P Oホールディングス	22,400	4,548.00	101,875,200
アニコム ホールディングス	800	4,305.00	3,444,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	29,800	3,415.00	101,767,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	9,400	2,144.00	20,153,600
第一生命ホールディングス	64,500	1,966.00	126,807,000
東京海上ホールディングス	42,900	5,313.00	227,927,700
アドバンテッジリスクマネジメント	400	1,234.00	493,600
T & Dホールディングス	35,300	1,676.00	59,162,800
アドバンスクリエイト	300	2,245.00	673,500
全国保証	3,200	5,100.00	16,320,000
ジェイリース	200	765.00	153,000
イントラスト	200	759.00	151,800
アルヒ	1,300	2,259.00	2,936,700
クレディセゾン	8,700	1,703.00	14,816,100
芙蓉総合リース	1,300	7,480.00	9,724,000
興銀リース	2,100	2,834.00	5,951,400
東京センチュリー	2,300	6,280.00	14,444,000
日本証券金融	4,700	605.00	2,843,500
アイフル	19,400	344.00	6,673,600
リコーリース	900	3,625.00	3,262,500
イオンフィナンシャルサービス	8,100	2,333.00	18,897,300
アコム	23,000	427.00	9,821,000
ジャックス	1,400	2,360.00	3,304,000
オリエントコーポレーション	25,400	149.00	3,784,600
日立キャピタル	3,100	2,862.00	8,872,200
アプラスフィナンシャル	6,200	111.00	688,200
オリックス	76,000	1,774.50	134,862,000
三菱U F Jリース	28,900	674.00	19,478,600
九州リースサービス	500	770.00	385,000
日本取引所グループ	32,700	2,086.00	68,212,200
イー・ギャランティ	600	2,081.00	1,248,600
アサックス	200	1,945.00	389,000
N E Cキャピタルソリューション	500	1,931.00	965,500
いちご	16,400	523.00	8,577,200
日本駐車場開発	13,900	187.00	2,599,300
ヒューリック	23,800	1,180.00	28,084,000
三栄建築設計	500	1,853.00	926,500
スター・マイカ	600	2,452.00	1,471,200
野村不動産ホールディングス	7,600	2,466.00	18,741,600
三重交通グループホールディングス	2,400	514.00	1,233,600

サムティ	1,000	2,089.00	2,089,000	
ディア・ライフ	1,300	508.00	660,400	
コーセーアールイー	300	821.00	246,300	
エー・ディー・ワークス	16,200	40.00	648,000	
日本商業開発	700	1,821.00	1,274,700	
プレサンスコーポレーション	1,600	1,770.00	2,832,000	
ユニゾホールディングス	1,600	2,069.00	3,310,400	
THEグローバル社	600	852.00	511,200	
日本管理センター	800	1,294.00	1,035,200	
サンセイランディック	400	1,164.00	465,600	
エストラスト	200	917.00	183,400	
フージャースホールディングス	2,800	778.00	2,178,400	
オープンハウス	1,800	6,370.00	11,466,000	
東急不動産ホールディングス	27,600	778.00	21,472,800	
飯田グループホールディングス	9,500	2,117.00	20,111,500	
イーランド	200	1,187.00	237,400	
ムゲンエステート	700	1,088.00	761,600	
ファーストブラザーズ	300	1,401.00	420,300	
ハウズドゥ	200	5,080.00	1,016,000	
シーアールイー	200	2,113.00	422,600	
ケアイスター不動産	400	2,560.00	1,024,000	
パーク24	6,600	2,982.00	19,681,200	
パラカ	300	2,601.00	780,300	
三井不動産	57,000	2,682.00	152,874,000	
三菱地所	84,900	1,957.00	166,149,300	
平和不動産	2,000	2,130.00	4,260,000	
東京建物	12,500	1,538.00	19,225,000	
ダイビル	2,900	1,136.00	3,294,400	
京阪神ビルディング	1,900	924.00	1,755,600	
住友不動産	27,000	4,154.00	112,158,000	
大京	1,800	2,475.00	4,455,000	
テーオーシー	3,900	817.00	3,186,300	
東京楽天地	200	5,760.00	1,152,000	
レオパレス21	13,600	613.00	8,336,800	
スターツコーポレーション	1,600	2,650.00	4,240,000	
フジ住宅	1,500	964.00	1,446,000	
空港施設	1,100	612.00	673,200	
明和地所	700	658.00	460,600	
ゴールドクレスト	900	1,767.00	1,590,300	
日本エスリード	500	1,897.00	948,500	
日神不動産	1,500	692.00	1,038,000	
日本エスコン	2,100	643.00	1,350,300	

タカラレーベン	5,400	402.00	2,170,800
サンヨーハウジング名古屋	700	1,194.00	835,800
イオンモール	7,400	1,996.00	14,770,400
ファースト住建	400	1,439.00	575,600
カチタス	1,500	4,435.00	6,652,500
トーセイ	1,400	1,218.00	1,705,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,100	1,194.00	8,477,400
サンフロンティア不動産	1,400	1,283.00	1,796,200
エフ・ジェー・ネクスト	900	1,050.00	945,000
インテリックス	400	963.00	385,200
ランドビジネス	700	332.00	232,400
グランディハウス	1,100	497.00	546,700
日本空港ビルデング	3,400	5,540.00	18,836,000
日本工営	700	2,887.00	2,020,900
L I F U L L	3,800	712.00	2,705,600
ジェイエシーリクルートメント	900	2,344.00	2,109,600
日本M&Aセンター	7,600	3,390.00	25,764,000
メンバーズ	400	1,409.00	563,600
中広	200	800.00	160,000
タケエイ	1,200	1,212.00	1,454,400
トラスト・テック	500	4,125.00	2,062,500
コシダカホールディングス	3,000	1,652.00	4,956,000
パソナグループ	1,100	1,744.00	1,918,400
C D S	300	1,327.00	398,100
リンクアンドモチベーション	2,000	1,372.00	2,744,000
G C A	1,300	883.00	1,147,900
エス・エム・エス	2,200	4,200.00	9,240,000
パーソルホールディングス	10,200	2,502.00	25,520,400
リニカル	700	2,365.00	1,655,500
クックパッド	3,500	528.00	1,848,000
エスクリ	400	795.00	318,000
アイ・ケイ・ケイ	700	828.00	579,600
学情	500	1,672.00	836,000
スタジオアリス	600	2,624.00	1,574,400
シミックホールディングス	600	2,206.00	1,323,600
N J S	300	1,748.00	524,400
総合警備保障	4,400	5,250.00	23,100,000
カカクコム	8,300	2,492.00	20,683,600
アイロムグループ	400	2,040.00	816,000
セントケア・ホールディング	500	713.00	356,500
サイネックス	200	833.00	166,600
ルネサンス	600	2,521.00	1,512,600

ディップ	1,600	2,791.00	4,465,600
オプトホールディング	800	2,389.00	1,911,200
新日本科学	1,400	497.00	695,800
ツクイ	2,600	952.00	2,475,200
キャリアデザインセンター	300	1,971.00	591,300
エムスリー	11,600	4,515.00	52,374,000
ツカダ・グローバルホールディング	900	638.00	574,200
プラス	100	836.00	83,600
アウトソーシング	3,300	2,037.00	6,722,100
ウェルネット	1,100	1,202.00	1,322,200
ワールドホールディングス	400	3,400.00	1,360,000
ディー・エヌ・エー	6,000	2,067.00	12,402,000
博報堂D Yホールディングス	15,300	1,808.00	27,662,400
ぐるなび	1,800	894.00	1,609,200
エスアールジータカミヤ	1,300	718.00	933,400
ジャパンベストレスキューシステム	900	923.00	830,700
ファンコミュニケーションズ	3,100	716.00	2,219,600
ライク	400	1,810.00	724,000
ビジネス・ブレークスルー	500	439.00	219,500
WDBホールディングス	500	3,180.00	1,590,000
ティア	500	1,057.00	528,500
C D G	100	1,688.00	168,800
バリューコマース	1,000	1,466.00	1,466,000
インフォマート	5,600	1,467.00	8,215,200
J Pホールディングス	3,500	375.00	1,312,500
エコナックホールディングス	2,300	127.00	292,100
E P Sホールディングス	1,700	2,398.00	4,076,600
レグス	300	1,061.00	318,300
プレステージ・インターナショナル	2,300	1,494.00	3,436,200
アミューズ	700	3,080.00	2,156,000
ドリームインキュベータ	400	2,170.00	868,000
クイック	700	1,725.00	1,207,500
T A C	800	329.00	263,200
ケネディクス	14,700	665.00	9,775,500
電通	13,500	5,290.00	71,415,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,742.00	871,000
ぴあ	400	6,420.00	2,568,000
イオンファンタジー	400	6,380.00	2,552,000
シーティーエス	1,100	1,176.00	1,293,600
みらかホールディングス	3,300	3,195.00	10,543,500
アルプス技研	1,000	2,427.00	2,427,000
ダイオーズ	200	1,326.00	265,200

日本空調サービス	1,100	812.00	893,200
オリエンタルランド	13,000	11,725.00	152,425,000
ダスキン	3,000	2,703.00	8,109,000
明光ネットワークジャパン	1,400	1,206.00	1,688,400
ファルコホールディングス	600	1,902.00	1,141,200
秀英予備校	200	487.00	97,400
田谷	200	688.00	137,600
ラウンドワン	3,400	1,718.00	5,841,200
リゾートトラスト	4,700	1,974.00	9,277,800
ビー・エム・エル	1,400	2,817.00	3,943,800
ワタベウェディング	200	502.00	100,400
りらいあコミュニケーションズ	1,700	1,611.00	2,738,700
リソー教育	1,900	801.00	1,521,900
早稲田アカデミー	200	2,416.00	483,200
ユー・エス・エス	13,500	2,106.00	28,431,000
東京個別指導学院	400	914.00	365,600
サイバーエージェント	6,800	6,570.00	44,676,000
楽天	56,700	708.40	40,166,280
クリーク・アンド・リバー社	600	1,107.00	664,200
テー・オー・ダブリュー	1,100	841.00	925,100
セントラルスポーツ	400	4,105.00	1,642,000
フルキャストホールディングス	1,000	2,741.00	2,741,000
リソルホールディングス	100	4,350.00	435,000
テクノプロ・ホールディングス	2,100	6,840.00	14,364,000
アトラ	200	670.00	134,000
インターワークス	300	1,000.00	300,000
Keeper 技研	400	1,320.00	528,000
ファーストロジック	200	678.00	135,600
三機サービス	200	1,919.00	383,800
Gunosy	700	1,385.00	969,500
デザインワン・ジャパン	200	1,252.00	250,400
イー・ガーディアン	500	3,100.00	1,550,000
リブセンス	800	565.00	452,000
ジャパンマテリアル	3,000	1,753.00	5,259,000
ベクトル	1,300	2,321.00	3,017,300
ウチヤマホールディングス	600	542.00	325,200
ライクキッズネクスト	300	1,380.00	414,000
キャリアリンク	400	543.00	217,200
I B J	900	655.00	589,500
アサンテ	400	2,069.00	827,600
N・フィールド	600	1,692.00	1,015,200
バリューHR	300	2,053.00	615,900



M & Aキャピタルパートナーズ	300	10,100.00	3,030,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,827.00	913,500
E R Iホールディングス	400	1,065.00	426,000
アビスト	200	4,790.00	958,000
シグマクシス	600	1,284.00	770,400
ウィルグループ	500	1,042.00	521,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,500	436.00	654,000
日本ビューホテル	300	1,388.00	416,400
リクルートホールディングス	85,200	3,146.00	268,039,200
エラン	300	2,631.00	789,300
土木管理総合試験所	400	584.00	233,600
日本郵政	62,600	1,202.00	75,245,200
ベルシステム24ホールディングス	1,900	1,842.00	3,499,800
鎌倉新書	200	3,365.00	673,000
一蔵	100	788.00	78,800
L I T A L I C O	200	1,994.00	398,800
グローバルグループ	100	1,904.00	190,400
エボラブルアジア	300	2,444.00	733,200
ストライク	300	4,480.00	1,344,000
ソラスト	700	3,885.00	2,719,500
セラク	200	890.00	178,000
インソース	400	2,214.00	885,600
キャリアインデックス	100	3,145.00	314,500
M S - J a p a n	100	7,460.00	746,000
船場	200	1,163.00	232,600
フルテック	100	1,157.00	115,700
グリーンズ	300	1,570.00	471,000
日総工産	200	5,540.00	1,108,000
キュービーネットホールディングス	500	2,077.00	1,038,500
リログループ	6,000	2,917.00	17,502,000
東祥	700	4,280.00	2,996,000
エイチ・アイ・エス	1,700	3,255.00	5,533,500
ラックランド	200	2,683.00	536,600
共立メンテナンス	2,000	6,050.00	12,100,000
イチネンホールディングス	1,200	1,410.00	1,692,000
建設技術研究所	800	1,492.00	1,193,600
スペース	700	1,456.00	1,019,200
長大	400	849.00	339,600
燦ホールディングス	300	2,490.00	747,000
スバル興業	100	6,400.00	640,000
東京テアトル	500	1,433.00	716,500
タナベ経営	200	2,056.00	411,200

ナガワ	200	4,715.00	943,000	
よみうりランド	200	4,670.00	934,000	
東京都競馬	800	4,695.00	3,756,000	
常磐興産	500	1,843.00	921,500	
カナモト	1,700	3,570.00	6,069,000	
東京ドーム	4,500	960.00	4,320,000	
西尾レントオール	1,100	3,550.00	3,905,000	
トランス・コスモス	1,200	2,634.00	3,160,800	
乃村工藝社	2,600	2,451.00	6,372,600	
藤田観光	400	3,435.00	1,374,000	
KNT-CTホールディングス	700	1,557.00	1,089,900	
日本管財	1,200	2,226.00	2,671,200	
トーカイ	1,100	2,450.00	2,695,000	
白洋舎	100	3,440.00	344,000	
セコム	11,700	8,355.00	97,753,500	
セントラル警備保障	500	5,110.00	2,555,000	
丹青社	2,300	1,433.00	3,295,900	
メイテック	1,300	5,070.00	6,591,000	
応用地質	1,200	1,448.00	1,737,600	
船井総研ホールディングス	2,300	2,482.00	5,708,600	
進学会ホールディングス	500	607.00	303,500	
オオバ	900	619.00	557,100	
いであ	200	1,085.00	217,000	
学究社	400	1,822.00	728,800	
ベネッセホールディングス	4,000	3,995.00	15,980,000	
イオンディライト	1,300	3,810.00	4,953,000	
ナック	800	944.00	755,200	
ニチイ学館	2,100	1,294.00	2,717,400	
ダイセキ	1,900	3,180.00	6,042,000	
ステップ	400	1,693.00	677,200	
合計	14,010,700		28,564,669,030	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	169,207,641	102,455,276
金銭信託	-	448,956,712
コール・ローン	393,984,840	194,866,758
出資金	5,042,493	9,119,816
株式	82,346,012,968	81,748,907,309
投資証券	2,119,172,660	2,024,713,386
派生商品評価勘定	8,231,315	5,034,207
未収入金	1,149,305	187,374,759
未収配当金	72,071,102	118,657,997
差入委託証拠金	167,307,747	248,958,573
流動資産合計	85,282,180,071	85,089,044,793
資産合計		
	85,282,180,071	85,089,044,793
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	608,008	13,307,363
未払金	57,150	12,263,988
未払解約金	121,019,396	57,853,550
未払利息	556	213
流動負債合計	121,685,110	83,425,114
負債合計		
	121,685,110	83,425,114
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	34,684,805,033	34,948,261,288
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	50,475,689,928	50,057,358,391
元本等合計	85,160,494,961	85,005,619,679
純資産合計		
	85,160,494,961	85,005,619,679
負債純資産合計		
	85,282,180,071	85,089,044,793

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

		平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
1.	期首	平成29年 6月27日	平成29年12月26日
	期首元本額	35,886,980,317円	34,684,805,033円
	期首からの追加設定元本額	1,240,871,799円	1,798,769,665円
	期首からの一部解約元本額	2,443,047,083円	1,535,313,410円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	15,349,375,400円	16,245,987,659円
	DCインデックスバランス（株式20）	59,342,687円	69,575,089円
	DCインデックスバランス（株式40）	183,185,288円	206,253,545円
	DCインデックスバランス（株式60）	365,880,171円	404,966,233円
	DCインデックスバランス（株式80）	400,091,666円	438,542,994円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,318,001,134円	2,179,598,522円
	日興五大陸株式ファンド	5,732,335,467円	5,594,718,371円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	25,992,446円	24,616,187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）	171,893,417円	115,826,530円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	114,014,686円	155,261,740円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,747,708円	5,478,360円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,269,536円	4,409,027円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,666,068円	6,829,402円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	6,956,482円	6,876,497円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,371,077,017円	4,873,673,542円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	26,732,169円	26,936,017円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	79,239,573円	78,777,973円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	117,293,559円	117,547,490円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	117,786,185円	115,434,401円

	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,228,924,374円	4,276,951,709円
	計	34,684,805,033円	34,948,261,288円
2.	受益権の総数	34,684,805,033口	34,948,261,288口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25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）

（平成29年12月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	621,992
株式	2,902,205,122
投資証券	38,798,083
合計	2,941,625,197

（平成30年 6月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	1,987,581
株式	4,157,159,035
投資証券	14,748,774
合計	4,173,895,390

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成29年12月25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	579,886,895	-	583,408,942	3,522,047
合計		579,886,895	-	583,408,942	3,522,047

(平成30年 6月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,246,323,025	-	1,238,141,199	8,181,826
合計		1,246,323,025	-	1,238,141,199	8,181,826

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成29年12月25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	378,997,795	-	383,029,500	4,031,705
	米ドル	312,929,270	-	315,969,500	3,040,230
	ユーロ	66,068,525	-	67,060,000	991,475
	売建	117,573,715	-	117,504,160	69,555
	米ドル	84,975,000	-	84,907,500	67,500
	英ポンド	18,791,964	-	18,792,200	236

	豪ドル	13,806,751	-	13,804,460	2,291
	合計	496,571,510	-	500,533,660	4,101,260

（平成30年 6月25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	749,307,830	-	749,216,500	91,330
	米ドル	598,585,340	-	602,234,000	3,648,660
	ユーロ	150,722,490	-	146,982,500	3,739,990
	合計	749,307,830	-	749,216,500	91,330

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成29年12月25日現在		平成30年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	2.4553円	1口当たり純資産額	2.4323円
(1万口当たり純資産額)	(24,553円)	(1万口当たり純資産額)	(24,323円)

附属明細表



第1 有価証券明細表  
(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	11,203	74.11	830,254.33	
	ANDEAVOR	3,000	135.05	405,150.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,560	20.81	94,893.60	
	APACHE CORP	7,904	44.76	353,783.04	
	BAKER HUGHES A GE CO	8,105	32.72	265,195.60	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,730	23.11	224,860.30	
	CHENIERE ENERGY INC	4,070	68.72	279,690.40	
	CHEVRON CORP	39,541	125.10	4,946,579.10	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	97.69	195,868.45	
	CONCHO RESOURCES INC	3,055	127.36	389,084.80	
	CONOCOPHILLIPS	24,740	67.78	1,676,877.20	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	66.20	129,752.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	11,251	43.28	486,943.28	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	2,210	125.56	277,487.60	
	EOG RESOURCES INC	12,022	118.51	1,424,727.22	
	EQT CORP	5,765	53.68	309,465.20	
	EXXON MOBIL CORP	87,591	81.38	7,128,155.58	
	HALLIBURTON CO	18,077	46.22	835,518.94	
	HELMERICH & PAYNE	2,120	63.70	135,044.00	
	HESS CORP	6,000	64.57	387,420.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	3,740	71.19	266,250.60	
	KINDER MORGAN INC	40,700	17.39	707,773.00	
	MARATHON OIL CORP	17,867	21.48	383,783.16	
	MARATHON PETROLEUM CORP	10,032	72.62	728,523.84	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	7,521	42.60	320,394.60	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	4,040	30.75	124,230.00	
	NOBLE ENERGY INC	10,672	36.08	385,045.76	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,731	83.33	1,310,864.23	
	ONEOK INC	8,790	69.99	615,212.10	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	4,490	29.04	130,389.60	
	PHILLIPS 66	9,045	112.02	1,013,220.90	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,420	185.65	634,923.00	
SCHLUMBERGER LTD	28,731	66.58	1,912,909.98		
TARGA RESOURCES CORP	4,560	49.45	225,492.00		
TECHNIPFMC PLC	9,351	32.34	302,411.34		
VALERO ENERGY CORP	8,992	112.24	1,009,262.08		
WILLIAMS COS INC	16,874	27.64	466,397.36		

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	4,535	158.08	716,892.80
ALBEMARLE CORP	2,320	93.46	216,827.20
AVERY DENNISON CORP	1,820	100.25	182,455.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,170	30.42	126,851.40
BALL CORP	6,840	35.91	245,624.40
CELANESE CORP-SERIES A	2,700	114.00	307,800.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,850	45.30	219,705.00
CHEMOURS CO/THE	3,600	47.00	169,200.00
CROWN HOLDINGS INC	2,815	45.19	127,209.85
DOWDUPONT INC	48,257	67.00	3,233,219.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,015	102.09	307,801.35
ECOLAB INC	5,220	138.87	724,901.40
FMC CORP	2,790	88.94	248,142.60
FREEMONT-MCMORAN INC	27,868	16.44	458,149.92
INTERNATIONAL PAPER CO	8,020	53.00	425,060.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	124.60	207,334.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	6,750	111.02	749,385.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,245	227.43	283,150.35
MOSAIC CO/THE	6,820	28.88	196,961.60
NEWMONT MINING CORP	11,050	37.46	413,933.00
NUCOR CORP	6,569	66.20	434,867.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,950	115.28	224,796.00
PPG INDUSTRIES INC	5,124	105.42	540,172.08
PRAXAIR INC	5,920	158.14	936,188.80
SEALED AIR CORP	3,966	43.55	172,719.30
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,707	396.13	676,193.91
STEEL DYNAMICS INC	4,510	47.90	216,029.00
VULCAN MATERIALS CO	2,713	131.57	356,949.41
WESTLAKE CHEMICAL CORP	790	107.86	85,209.40
WESTROCK CO	5,239	57.97	303,704.83
3M CO	12,316	196.50	2,420,094.00
ACUITY BRANDS INC	890	121.41	108,054.90
AERCAP HOLDINGS NV	2,660	54.36	144,597.60
AGCO CORP	1,250	60.73	75,912.50
ALLEGION PLC	2,080	77.69	161,595.20
AMETEK INC	4,763	73.00	347,699.00
ARCONIC INC	8,783	17.04	149,662.32
BOEING CO/THE	11,542	338.91	3,911,699.22
CATERPILLAR INC	12,356	139.94	1,729,098.64
CUMMINS INC	3,195	136.05	434,679.75
DEERE & CO	6,240	143.17	893,380.80
DOVER CORP	3,150	72.94	229,761.00

EATON CORP PLC	9,026	76.59	691,301.34
EMERSON ELECTRIC CO	12,970	69.87	906,213.90
FASTENAL CO	5,753	50.59	291,044.27
FLOWSERVE CORP	2,575	40.79	105,034.25
FLUOR CORP	2,903	49.52	143,756.56
FORTIVE CORP	6,364	77.84	495,373.76
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3,160	55.25	174,590.00
GENERAL DYNAMICS CORP	5,182	189.38	981,367.16
GENERAL ELECTRIC CO	179,493	13.05	2,342,383.65
HARRIS CORP	2,410	143.70	346,317.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	3,740	44.46	166,280.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	15,596	144.00	2,245,824.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	960	212.96	204,441.60
IDEX CORP	1,570	138.66	217,696.20
ILLINOIS TOOL WORKS	6,320	141.46	894,027.20
INGERSOLL-RAND PLC	5,096	90.76	462,512.96
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,420	64.80	156,816.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,370	63.23	276,315.10
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	4,500	37.03	166,635.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18,864	33.99	641,187.36
L3 TECHNOLOGIES INC	1,651	194.14	320,525.14
LENNOX INTERNATIONAL INC	770	199.94	153,953.80
LOCKHEED MARTIN CORP	5,341	299.38	1,598,988.58
MASCO CORP	6,439	38.04	244,939.56
MIDDLEBY CORP	1,180	104.90	123,782.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	3,384	312.06	1,056,011.04
OWENS CORNING	2,170	65.63	142,417.10
PACCAR INC	7,014	62.11	435,639.54
PARKER HANNIFIN CORP	2,760	157.38	434,368.80
PENTAIR PLC	3,498	42.57	148,909.86
RAYTHEON COMPANY	6,002	193.38	1,160,666.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,683	167.98	450,690.34
ROCKWELL COLLINS INC.	3,373	134.47	453,567.31
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,260	276.22	624,257.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,460	51.23	177,255.80
SMITH (A.O.) CORP	3,020	60.27	182,015.40
SNAP-ON INC	1,160	159.67	185,217.20
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,310	85.28	196,996.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,116	135.00	420,660.00
TEXTRON INC	5,416	67.06	363,196.96
TRANSDIGM GROUP INC	1,100	342.24	376,464.00
UNITED RENTALS INC	1,720	154.95	266,514.00

UNITED TECHNOLOGIES CORP	15,715	124.87	1,962,332.05
WABCO HOLDINGS INC	1,110	120.46	133,710.60
WABTEC CORP	1,880	100.70	189,316.00
WW GRAINGER INC	1,107	312.10	345,494.70
XYLEM INC	3,548	66.45	235,764.60
CINTAS CORP	1,857	188.63	350,285.91
COPART INC	4,260	59.91	255,216.60
COSTAR GROUP INC	755	412.09	311,127.95
EQUIFAX INC	2,404	126.60	304,346.40
IHS MARKIT LTD	7,933	51.25	406,566.25
MANPOWERGROUP INC	1,447	91.74	132,747.78
NIELSEN HOLDINGS PLC	7,405	31.12	230,443.60
REPUBLIC SERVICES INC	4,590	69.73	320,060.70
ROBERT HALF INTL INC	2,375	69.84	165,870.00
ROLLINS INC	2,000	52.41	104,820.00
STERICYCLE INC	1,705	64.26	109,563.30
TRANSUNION	4,100	71.70	293,970.00
VERISK ANALYTICS INC	3,170	107.89	342,011.30
WASTE CONNECTIONS INC	5,246	76.43	400,951.78
WASTE MANAGEMENT INC	8,864	81.88	725,784.32
AMERCO	155	362.50	56,187.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	2,270	41.35	93,864.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,900	88.61	256,969.00
CSX CORP	17,833	64.78	1,155,221.74
DELTA AIR LINES INC	3,615	52.72	190,582.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,647	74.02	269,950.94
FEDEX CORP	5,288	241.77	1,278,479.76
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,820	128.13	233,196.60
KANSAS CITY SOUTHERN	2,160	108.28	233,884.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,750	40.60	111,650.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	5,860	151.82	889,665.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,190	157.80	187,782.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,890	51.91	150,019.90
UNION PACIFIC CORP	16,306	143.95	2,347,248.70
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	1,715	72.94	125,092.10
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	14,247	113.70	1,619,883.90
XPO LOGISTICS INC	2,450	108.76	266,462.00
APTIV PLC	5,900	96.24	567,816.00
AUTOLIV INC	1,770	149.80	265,146.00
BORGWARNER INC	4,330	45.09	195,239.70
FORD MOTOR COMPANY	78,845	11.65	918,544.25
GENERAL MOTORS CORP	26,215	41.25	1,081,368.75

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5,430	24.63	133,740.90
HARLEY-DAVIDSON INC	3,709	44.21	163,974.89
LEAR CORP	1,370	195.70	268,109.00
TESLA INC	2,720	333.63	907,473.60
DR HORTON INC	7,256	40.75	295,682.00
GARMIN LTD	2,395	60.23	144,250.85
HANESBRANDS INC	7,940	21.96	174,362.40
HASBRO INC	2,288	91.68	209,763.84
LEGGETT & PLATT INC	2,778	43.69	121,370.82
LENNAR CORP-CL A	5,820	51.20	297,984.00
LULULEMON ATHLETICA INC	2,010	124.18	249,601.80
MATTEL INC	7,349	17.52	128,754.48
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	2,970	66.63	197,891.10
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,318	211.87	279,244.66
NEWELL BRANDS INC	10,026	26.21	262,781.46
NIKE INC -CL B	26,698	73.43	1,960,434.14
NVR INC	70	3,000.65	210,045.50
POLARIS INDUSTRIES INC	1,240	123.28	152,867.20
PULTE GROUP INC	5,660	28.78	162,894.80
PVH CORP	1,600	152.08	243,328.00
RALPH LAUREN CORP	1,165	130.26	151,752.90
TAPESTRY INC	5,696	47.27	269,249.92
TOLL BROTHERS INC	3,321	37.11	123,242.31
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	3,560	22.38	79,672.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,112	20.79	85,488.48
VF CORP	6,840	81.58	558,007.20
WHIRLPOOL CORP	1,414	144.65	204,535.10
ARAMARK	4,960	38.25	189,720.00
CARNIVAL CORP	8,647	63.53	549,343.91
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	485	469.94	227,920.90
DARDEN RESTAURANTS INC	2,553	108.87	277,945.11
DOMINO'S PIZZA INC	940	292.39	274,846.60
H&R BLOCK INC	4,510	23.00	103,730.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,670	80.87	458,532.90
LAS VEGAS SANDS CORP	8,100	79.80	646,380.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,373	132.61	845,123.53
MCDONALD'S CORP	16,461	164.55	2,708,657.55
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	5,100	29.91	152,541.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	11,570	30.07	347,909.90
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,910	51.96	255,123.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	111.55	394,663.90
STARBUCKS CORP	29,264	51.24	1,499,487.36

VAIL RESORTS INC	840	280.81	235,880.40
WYNN RESORTS LTD	2,030	170.14	345,384.20
YUM! BRANDS INC	7,324	80.36	588,556.64
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	7,068	56.70	400,755.60
CHARTER COMMUNICATION-A	3,451	299.30	1,032,884.30
COMCAST CORP-CLASS A	95,984	33.81	3,245,219.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	28.12	93,358.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,490	26.25	170,362.50
DISH NETWORK CORP-A	4,769	34.91	166,485.79
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7,836	23.91	187,358.76
LIBERTY BROADBAND-C	2,140	77.09	164,972.60
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3,085	30.13	92,951.05
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,321	28.98	357,062.58
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,890	35.32	137,394.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	3,580	46.34	165,897.20
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	1,975	46.22	91,284.50
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,760	48.73	134,494.80
NEWS CORP - CLASS A	7,570	15.82	119,757.40
OMNICOM GROUP	4,577	75.91	347,440.07
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,250	7.14	244,545.00
THE WALT DISNEY CO.	31,203	106.34	3,318,127.02
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	9,599	48.35	464,111.65
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	21,392	48.61	1,039,865.12
VIACOM INC-CLASS B	7,248	30.28	219,469.44
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,508	138.85	209,385.80
AMAZON.COM INC	8,505	1,715.67	14,591,773.35
AUTOZONE INC	552	685.98	378,660.96
BEST BUY CO INC	5,564	76.26	424,310.64
BOOKING HOLDINGS INC	998	2,102.85	2,098,644.30
CARMAX INC	3,679	80.19	295,019.01
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	5,570	100.15	557,835.50
DOLLAR TREE INC	4,896	86.99	425,903.04
EXPEDIA INC	2,552	124.83	318,566.16
GAP INC/THE	5,106	33.39	170,489.34
GENUINE PARTS CO	2,961	93.04	275,491.44
HOME DEPOT INC	24,180	197.41	4,773,373.80
KOHL'S CORP	3,292	73.84	243,081.28
L BRANDS INC	4,858	36.69	178,240.02
LKQ CORP	6,330	32.87	208,067.10
LOWE'S COS INC	17,242	98.22	1,693,509.24
MACY'S INC	6,469	37.43	242,134.67
NETFLIX INC	8,970	411.09	3,687,477.30

NORDSTROM INC	2,540	51.43	130,632.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,775	286.16	507,934.00
QURATE RETAIL INC	8,930	21.13	188,690.90
ROSS STORES INC	7,862	85.98	675,974.76
TARGET CORP	10,600	76.04	806,024.00
TIFFANY & CO	2,610	133.67	348,878.70
TJX COMPANIES INC	12,853	95.08	1,222,063.24
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,750	76.85	211,337.50
TRIPADVISOR INC	2,330	56.66	132,017.80
ULTA BEAUTY INC	1,240	249.76	309,702.40
COSTCO WHOLESALE CORP	9,059	211.10	1,912,354.90
KROGER CO	17,720	29.69	526,106.80
SYSCO CORP	10,066	67.79	682,374.14
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	18,322	67.61	1,238,750.42
WALMART INC	30,532	84.82	2,589,724.24
ALTRIA GROUP INC	39,388	57.02	2,245,903.76
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11,343	46.53	527,789.79
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,280	49.81	262,996.80
BUNGE LTD	2,857	71.52	204,332.64
CAMPBELL SOUP CO	3,485	38.60	134,521.00
COCA-COLA CO/THE	83,812	43.25	3,624,869.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4,220	39.91	168,420.20
CONAGRA BRANDS INC	8,610	38.55	331,915.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,530	231.52	817,265.60
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,769	122.37	461,212.53
GENERAL MILLS INC	11,439	45.22	517,271.58
HERSHEY CO/THE	3,015	92.67	279,400.05
HORMEL FOODS CORP	5,960	36.27	216,169.20
INGREDION INC	1,470	109.67	161,214.90
JM SMUCKER CO/THE	2,250	105.71	237,847.50
KELLOGG CO	5,408	67.40	364,499.20
KRAFT HEINZ CO/THE	12,411	63.21	784,499.31
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,465	106.09	261,511.85
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,870	69.02	267,107.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	30,725	41.30	1,268,942.50
MONSTER BEVERAGE CORP	9,160	56.86	520,837.60
PEPSICO INC	29,271	108.37	3,172,098.27
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	32,108	80.19	2,574,740.52
TYSON FOODS INC-CL A	6,166	69.38	427,797.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,200	50.63	263,276.00
CLOROX COMPANY	2,616	128.91	337,228.56
COLGATE-PALMOLIVE CO	17,060	64.63	1,102,587.80

COTY INC-CL A	10,000	14.77	147,700.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,600	152.93	703,478.00
KIMBERLY-CLARK CORP	7,293	100.97	736,374.21
PROCTER & GAMBLE CO	52,049	77.43	4,030,154.07
ABBOTT LABORATORIES	36,046	61.94	2,232,689.24
ABIOMED INC	860	427.29	367,469.40
AETNA INC	6,779	190.92	1,294,246.68
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,560	353.27	551,101.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,254	93.50	304,249.00
ANTHEM INC	5,306	244.82	1,299,014.92
BAXTER INTERNATIONAL INC	11,029	74.32	819,675.28
BECTON DICKINSON AND CO	5,537	237.60	1,315,591.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	28,218	32.62	920,471.16
CARDINAL HEALTH INC	6,565	53.98	354,378.70
CENTENE CORP	4,130	125.60	518,728.00
CERNER CORP	6,230	59.81	372,616.30
CIGNA CORP	5,010	174.08	872,140.80
COOPER COS INC/THE	1,040	237.23	246,719.20
CVS HEALTH CORP	21,087	72.18	1,522,059.66
DANAHER CORP	13,049	99.30	1,295,765.70
DAVITA INC	2,978	71.95	214,267.10
DENTSPLY SIRONA INC	4,852	44.95	218,097.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,410	152.87	674,156.70
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	11,634	79.23	921,761.82
HCA HEALTHCARE INC	5,815	106.74	620,693.10
HENRY SCHEIN INC	3,340	74.69	249,464.60
HOLOGIC INC	5,708	40.46	230,945.68
HUMANA INC	2,945	299.98	883,441.10
IDEXX LABORATORIES INC	1,830	222.90	407,907.00
INTUITIVE SURGICAL INC	2,310	483.21	1,116,215.10
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	189.13	407,575.15
MCKESSON CORP	4,324	148.88	643,757.12
MEDTRONIC PLC	28,008	86.81	2,431,374.48
QUEST DIAGNOSTICS	2,876	112.04	322,227.04
RESMED INC	2,950	107.93	318,393.50
STRYKER CORP	7,013	172.00	1,206,236.00
TELEFLEX INC	900	281.71	253,539.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	20,020	254.37	5,092,487.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,810	115.01	208,168.10
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,924	118.40	227,801.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	2,450	82.84	202,958.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	4,162	111.76	465,145.12



ABBVIE INC	31,366	93.49	2,932,407.34
AGILENT TECHNOLOGIES INC	6,620	62.79	415,669.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,540	127.57	579,167.80
ALKERMES PLC	3,220	44.13	142,098.60
ALLERGAN PLC	6,745	173.42	1,169,717.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,800	104.20	187,560.00
AMGEN INC	13,941	185.15	2,581,176.15
BIOGEN INC	4,403	296.04	1,303,464.12
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	99.03	346,605.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	33,851	55.14	1,866,544.14
CELGENE CORP	16,084	78.80	1,267,419.20
ELI LILLY & CO	20,473	85.92	1,759,040.16
GILEAD SCIENCES INC	27,094	71.07	1,925,570.58
ILLUMINA INC	3,025	282.65	855,016.25
INCYTE CORP	3,700	74.03	273,911.00
IQVIA HOLDINGS INC	3,533	103.84	366,866.72
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,180	178.50	210,630.00
JOHNSON & JOHNSON	55,511	122.84	6,818,971.24
MERCK & CO. INC.	55,743	61.47	3,426,522.21
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	540	582.31	314,447.40
MYLAN NV	10,965	38.31	420,069.15
NEKTAR THERAPEUTICS	3,290	52.85	173,876.50
PERRIGO CO PLC	2,559	75.66	193,613.94
PFIZER INC	123,260	36.51	4,500,222.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,620	331.97	537,791.40
SEATTLE GENETICS INC	2,280	66.85	152,418.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	18,720	23.99	449,092.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	8,344	208.75	1,741,810.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	940	116.47	109,481.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,200	159.19	827,788.00
WATERS CORP	1,666	193.87	322,987.42
ZOETIS INC	9,960	85.82	854,767.20
BANK OF AMERICA CORP	201,289	28.99	5,835,368.11
BB&T CORP	16,118	51.61	831,849.98
CIT GROUP INC	2,655	51.35	136,334.25
CITIGROUP INC	53,017	67.20	3,562,742.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	10,080	41.18	415,094.40
COMERICA INC	3,570	95.44	340,720.80
EAST WEST BANCORP INC	3,000	69.07	207,210.00
FIFTH THIRD BANCORP	14,459	30.10	435,215.90
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,220	100.28	322,901.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	21,790	15.35	334,476.50

JPMORGAN CHASE & CO	70,940	105.75	7,501,905.00
KEYCORP	22,078	20.40	450,391.20
M & T BANK CORP	3,153	172.98	545,405.94
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	11.41	110,152.14
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	7,100	18.55	131,705.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9,750	139.36	1,358,760.00
REGIONS FINANCIAL CORP	23,184	18.53	429,599.52
SIGNATURE BANK	1,130	132.75	150,007.50
SUNTRUST BANKS INC	9,747	67.49	657,825.03
SVB FINANCIAL GROUP	1,090	310.17	338,085.30
US BANCORP	32,321	50.76	1,640,613.96
WELLS FARGO & CO	96,710	53.94	5,216,537.40
ZIONS BANCORPORATION	4,120	55.51	228,701.20
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,100	154.62	170,082.00
ALLY FINANCIAL INC	9,120	26.42	240,950.40
AMERICAN EXPRESS CO	15,224	97.23	1,480,229.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,060	146.36	447,861.60
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,992	56.75	1,191,296.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,380	188.91	4,983,445.80
BLACKROCK INC	2,495	522.74	1,304,236.30
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	9,795	95.01	930,622.95
CBOE GLOBAL MARKETS INC	2,120	104.98	222,557.60
CME GROUP INC	6,970	168.42	1,173,887.40
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7,280	73.42	534,497.60
E*TRADE FINANCIAL CORP	5,300	64.93	344,129.00
EATON VANCE CORP	2,260	53.89	121,791.40
FRANKLIN RESOURCES INC	6,635	32.90	218,291.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,428	226.02	1,678,876.56
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,990	74.80	896,852.00
INVESCO LTD	8,467	27.63	233,943.21
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,485	23.33	151,295.05
MOODY'S CORP	3,527	172.41	608,090.07
MORGAN STANLEY	28,005	48.89	1,369,164.45
MSCI INC	1,800	170.63	307,134.00
NASDAQ INC	2,185	93.60	204,516.00
NORTHERN TRUST CORP	4,420	107.30	474,266.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,690	96.02	258,293.80
S&P GLOBAL INC	5,152	206.35	1,063,115.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	25,094	54.90	1,377,660.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	2,715	65.16	176,909.40
STATE STREET CORP	7,617	98.14	747,532.38
SYNCHRONY FINANCIAL	15,730	34.13	536,864.90

T ROWE PRICE GROUP INC	4,925	123.00	605,775.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,600	58.39	326,984.00
VOYA FINANCIAL INC	3,700	49.37	182,669.00
AFLAC INC	16,044	44.19	708,984.36
ALLEGHANY CORP	330	585.00	193,050.00
ALLSTATE CORP	7,253	92.24	669,016.72
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,490	107.96	160,860.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	19,075	54.46	1,038,824.50
AON PLC	5,197	137.14	712,716.58
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,775	26.48	73,482.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD(N)	5,550	26.48	146,964.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,730	66.74	248,940.20
ASSURANT INC	1,110	102.37	113,630.70
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,700	44.51	164,687.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,485	55.93	83,056.05
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1,774	44.49	78,925.26
CHUBB LTD	9,575	125.38	1,200,513.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,190	68.34	218,004.60
EVEREST RE GROUP LTD	874	230.00	201,020.00
FNF GROUP	5,241	36.77	192,711.57
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7,282	51.78	377,061.96
LINCOLN NATIONAL CORP	4,513	65.37	295,014.81
LOEWS CORP	5,785	48.77	282,134.45
MARKEL CORP	320	1,114.68	356,697.60
MARSH & MCLENNAN COS	10,383	81.60	847,252.80
METLIFE INC	18,535	45.71	847,234.85
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,000	55.66	333,960.00
PROGRESSIVE CORP	12,140	60.78	737,869.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	8,552	96.50	825,268.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,310	137.72	180,413.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	122.62	108,763.94
TORCHMARK CORP	2,216	83.68	185,434.88
TRAVELERS COS INC/THE	5,654	124.41	703,414.14
UNUM GROUP	4,788	37.99	181,896.12
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,878	154.16	443,672.48
WR BERKLEY CORP	2,063	73.73	152,104.99
XL GROUP LTD	5,190	56.15	291,418.50
CBRE GROUP INC - A	6,310	48.80	307,928.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,700	7.21	170,877.00
JONES LANG LASALLE INC	890	168.83	150,258.70
ACCENTURE PLC-CL A	12,798	159.63	2,042,944.74
ACTIVISION BLIZZARD INC	14,600	75.98	1,109,308.00

ADOBE SYSTEMS INC	10,159	243.63	2,475,037.17
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3,690	80.32	296,380.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,010	236.62	238,986.20
ALPHABET INC-CL A	6,170	1,169.29	7,214,519.30
ALPHABET INC-CL C	6,512	1,155.48	7,524,485.76
ANSYS INC	1,820	179.32	326,362.40
AUTODESK INC	4,630	136.51	632,041.30
AUTOMATIC DATA PROCESSING	9,226	139.09	1,283,244.34
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,420	116.48	281,881.60
CA INC	6,270	36.15	226,660.50
CADENCE DESIGN SYS INC	5,760	43.87	252,691.20
CDK GLOBAL INC	2,510	66.08	165,860.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,710	97.48	264,170.80
CITRIX SYSTEMS INC	3,228	105.51	340,586.28
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	12,078	78.70	950,538.60
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	4,320	88.78	383,529.60
DXC TECHNOLOGY CO	5,903	80.85	477,257.55
EBAY INC	20,147	38.09	767,399.23
ELECTRONIC ARTS INC	6,294	141.26	889,090.44
FACEBOOK INC-A	49,560	201.74	9,998,234.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,745	107.63	725,964.35
FIRST DATA CORP- CLASS-A	9,680	21.72	210,249.60
FISERV INC	8,256	75.57	623,905.92
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,850	216.31	400,173.50
FORTINET INC	3,100	63.93	198,183.00
GARTNER INC	2,050	134.96	276,668.00
GLOBAL PAYMENTS INC	3,620	114.40	414,128.00
GODADDY INC-CLASS A	2,850	73.29	208,876.50
IAC/INTERACTIVECORP	1,650	158.50	261,525.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	18,992	141.28	2,683,189.76
INTUIT INC	4,966	205.98	1,022,896.68
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,530	131.31	200,904.30
LEIDOS HOLDINGS INC	2,900	58.50	169,650.00
MASTERCARD INC	19,340	201.48	3,896,623.20
MERCADOLIBRE INC	870	290.86	253,048.20
MICROSOFT CORP	151,184	100.41	15,180,385.44
ORACLE CORP	64,333	44.10	2,837,085.30
PAYCHEX INC	6,562	70.22	460,783.64
PAYPAL HOLDINGS INC	23,567	85.12	2,006,023.04
RED HAT INC	3,600	142.14	511,704.00
SABRE CORP	4,520	25.75	116,390.00
SALESFORCE.COM INC	14,240	135.01	1,922,542.40

SERVICENOW INC	3,780	176.70	667,926.00
SPLUNK INC	2,830	105.23	297,800.90
SQUARE INC - A	5,470	65.75	359,652.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,830	54.88	265,070.40
SYMANTEC CORP	13,055	20.72	270,499.60
SYNOPSYS INC	3,207	88.12	282,600.84
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,350	116.96	274,856.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3,366	87.10	293,178.60
TWITTER INC	12,970	45.88	595,063.60
VERISIGN INC	1,810	138.68	251,010.80
VISA INC-CLASS A SHARES	37,342	135.33	5,053,492.86
VMWARE INC	1,555	150.01	233,265.55
WESTERN UNION CO	9,241	21.14	195,354.74
WORKDAY INC-CLASS A	2,810	124.01	348,468.10
WORLDPAY INC-CLASS A	5,980	85.08	508,778.40
ZILLOW GROUP INC - C	2,000	61.46	122,920.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,750	89.20	602,100.00
APPLE INC	104,912	184.92	19,400,327.04
ARISTA NETWORKS INC	970	272.65	264,470.50
ARROW ELECTRONICS INC	1,930	77.58	149,729.40
AVNET INC	2,610	43.09	112,464.90
CDW CORP/DE	3,500	83.77	293,195.00
CISCO SYSTEMS INC	99,420	43.20	4,294,944.00
COGNEX CORP	3,400	45.11	153,374.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	4,030	29.31	118,119.30
CORNING INC	18,388	28.49	523,874.12
F5 NETWORKS INC	1,335	171.47	228,912.45
FLEX LTD	10,936	14.53	158,900.08
FLIR SYSTEMS INC	2,675	53.44	142,952.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	32,915	15.24	501,624.60
HP INC	34,005	23.80	809,319.00
IPG PHOTONICS CORP	730	234.25	171,002.50
JUNIPER NETWORKS INC	7,933	26.71	211,890.43
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,830	60.10	230,183.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,385	117.71	398,448.35
NETAPP INC	5,236	76.96	402,962.56
PALO ALTO NETWORKS INC	1,900	207.59	394,421.00
SEAGATE TECHNOLOGY	5,684	58.22	330,922.48
TE CONNECTIVITY LTD	7,185	95.13	683,509.05
TRIMBLE INC	5,170	33.34	172,367.80
WESTERN DIGITAL CORP	6,058	79.68	482,701.44
XEROX CORP	4,938	26.40	130,363.20

AT&T INC	149,007	31.69	4,722,031.83
CENTURYLINK INC	19,626	18.62	365,436.12
SPRINT CORP	17,350	5.50	95,425.00
T-MOBILE US INC	7,192	60.79	437,201.68
VERIZON COMMUNICATIONS INC	85,337	49.76	4,246,369.12
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,700	36.56	135,272.00
AES CORP	13,728	12.86	176,542.08
ALLIANT ENERGY CORP	4,740	41.09	194,766.60
AMEREN CORPORATION	4,942	58.68	289,996.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,008	67.35	674,038.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,655	83.42	304,900.10
ATMOS ENERGY CORP	2,190	89.11	195,150.90
CENTERPOINT ENERGY INC	8,142	26.62	216,740.04
CMS ENERGY CORP	5,770	45.44	262,188.80
CONSOLIDATED EDISON INC	6,306	75.76	477,742.56
DOMINION RESOURCES INC/VA	13,867	66.94	928,256.98
DTE ENERGY COMPANY	3,698	100.45	371,464.10
DUKE ENERGY CORP	14,576	77.43	1,128,619.68
EDISON INTERNATIONAL	6,589	61.70	406,541.30
ENERGY CORP	3,847	80.21	308,567.87
EVERGY INC	5,580	54.44	303,775.20
EVERSOURCE ENERGY	6,300	56.03	352,989.00
EXELON CORP	20,896	41.50	867,184.00
FIRSTENERGY CORP	8,995	35.09	315,634.55
NEXTERA ENERGY INC	9,765	164.30	1,604,389.50
NISOURCE INC	6,540	25.06	163,892.40
OGE ENERGY CORP	3,830	34.96	133,896.80
P G & E CORP	10,491	42.92	450,273.72
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	78.29	172,159.71
PPL CORP	15,728	28.26	444,473.28
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10,188	53.34	543,427.92
SCANA CORP	2,683	37.01	99,297.83
SEMPRA ENERGY	5,377	115.14	619,107.78
SOUTHERN CO	20,475	45.81	937,959.75
UGI CORP	3,500	51.56	180,460.00
VISTRA ENERGY CORP	7,920	23.65	187,308.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,320	62.29	393,672.80
XCEL ENERGY INC	10,414	43.85	456,653.90
ADVANCED MICRO DEVICES	19,050	15.80	300,990.00
ANALOG DEVICES INC	7,630	99.09	756,056.70
APPLIED MATERIALS INC	21,753	47.96	1,043,273.88
BROADCOM INC	8,460	259.71	2,197,146.60

	INTEL CORP	96,672	52.50	5,075,280.00
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,199	106.56	340,885.44
	LAM RESEARCH CORP	3,357	174.70	586,467.90
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,004	21.31	170,565.24
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5,850	60.39	353,281.50
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,904	96.92	475,295.68
	MICRON TECHNOLOGY INC	23,947	57.10	1,367,373.70
	NVIDIA CORP	11,875	250.95	2,980,031.25
	NXP SEMICONDUCTORS NV	7,297	115.07	839,665.79
	ON SEMICONDUCTOR CORP	8,730	24.08	210,218.40
	QORVO INC	2,670	82.05	219,073.50
	QUALCOMM INC	30,612	58.50	1,790,802.00
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3,810	98.55	375,475.50
	TEXAS INSTRUMENTS INC	20,332	112.38	2,284,910.16
	XILINX INC	5,075	66.73	338,654.75
米ドル小計		6,325,393		496,742,963.47 (54,487,735,663)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,850	26.51	102,063.50
	ARC RESOURCES LTD	7,925	13.28	105,244.00
	CAMECO CORP	7,892	15.06	118,853.52
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,574	44.17	1,085,433.58
	CENOVUS ENERGY INC	20,853	13.18	274,842.54
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	11,475	9.60	110,160.00
	ENBRIDGE INC	34,757	42.15	1,465,007.55
	ENCANA CORP	21,068	16.97	357,523.96
	HUSKY ENERGY INC	6,873	20.02	137,597.46
	IMPERIAL OIL LTD	5,952	43.23	257,304.96
	INTER PIPELINE LTD	7,180	25.08	180,074.40
	KEYERA CORP	4,270	36.98	157,904.60
	PEMBINA PIPELINE CORP	10,212	46.05	470,262.60
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	4,100	25.93	106,313.00
	SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	4,430	14.04	62,197.20
	SUNCOR ENERGY INC	34,059	53.35	1,817,047.65
	TOURMALINE OIL CORP	4,575	23.48	107,421.00
	TRANSCANADA CORP	17,673	57.68	1,019,378.64
	VERMILION ENERGY INC	2,640	46.45	122,628.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	59.54	279,540.30
	BARRICK GOLD CORP	23,944	17.35	415,428.40
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,050	64.57	196,938.50
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,710	20.32	298,907.20
	FRANCO-NEVADA CORP	3,805	92.99	353,826.95
	GOLDCORP INC	17,917	18.22	326,447.74

KINROSS GOLD CORP	25,015	4.97	124,324.55
LUNDIN MINING CORP	12,280	8.10	99,468.00
METHANEX CORP	1,650	92.59	152,773.50
NUTRIEN LTD	13,198	71.22	939,961.56
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,955	34.59	413,523.45
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	23,419	3.76	88,055.44
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,460	85.69	125,107.40
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9,395	28.81	270,669.95
BOMBARDIER INC 'B'	40,026	5.25	210,136.50
CAE INC	5,615	27.02	151,717.30
FINNING INTERNATIONAL INC	3,545	32.99	116,949.55
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,605	60.14	216,804.70
WSP GLOBAL INC	2,100	71.78	150,738.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	15,318	107.03	1,639,485.54
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,915	249.11	726,155.65
LINAMAR CORP	980	60.10	58,898.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,018	83.36	585,020.48
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4,540	37.70	171,158.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,638	80.65	374,054.70
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,935	27.78	248,214.30
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,290	173.94	224,382.60
DOLLARAMA INC	6,540	53.63	350,740.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	8,800	58.24	512,512.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,000	25.56	76,680.00
LOBLAW COMPANIES LTD	4,269	67.43	287,858.67
METRO INC	4,380	44.49	194,866.20
WESTON (GEORGE) LTD	1,182	106.07	125,374.74
SAPUTO INC	4,730	43.61	206,275.30
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	6,734	32.19	216,767.46
BANK OF MONTREAL	13,291	103.32	1,373,226.12
BANK OF NOVA SCOTIA	24,909	77.00	1,917,993.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,955	117.68	1,053,824.40
NATIONAL BANK OF CANADA	6,740	64.29	433,314.60
ROYAL BANK OF CANADA	29,849	101.37	3,025,793.13
TORONTO-DOMINION BANK	38,210	77.00	2,942,170.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,133	54.68	936,832.44
CI FINANCIAL CORP	5,700	24.60	140,220.00
IGM FINANCIAL INC	1,945	39.38	76,594.10
ONEX CORPORATION	1,725	96.32	166,152.00
THOMSON REUTERS CORP	5,534	54.08	299,278.72
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	590	751.50	443,385.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	5,974	32.97	196,962.78



	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,225	51.46	114,498.50
	INTACT FINANCIAL CORP	2,885	95.36	275,113.60
	MANULIFE FINANCIAL CORP	40,561	25.15	1,020,109.15
	POWER CORP OF CANADA	7,800	29.95	233,610.00
	POWER FINANCIAL CORP	5,715	31.49	179,965.35
	SUN LIFE FINANCIAL INC	12,574	54.32	683,019.68
	FIRST CAPITAL REALTY INC	3,320	21.00	69,720.00
	BLACKBERRY LTD	10,328	14.16	146,244.48
	CGI GROUP INC - CL A	4,940	83.70	413,478.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	420	1,049.95	440,979.00
	OPEN TEXT CORP	5,390	47.54	256,240.60
	SHOPIFY INC - CLASS-A	1,700	216.17	367,489.00
	BCE INC	2,930	54.37	159,304.10
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,185	62.63	449,996.55
	TELUS CORP	4,366	46.77	204,197.82
	ATCO LTD -CLASS I	1,920	40.20	77,184.00
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	32.60	84,434.00
	EMERA INC	1,270	42.73	54,267.10
	FORTIS INC	8,665	42.16	365,316.40
	HYDRO ONE LTD	6,290	20.07	126,240.30
加ドル小計		834,640		37,714,174.91 (3,111,042,288)
ユーロ	ENAGAS SA	4,790	24.78	118,696.20
	ENI SPA	51,366	15.63	803,158.77
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	10,915	16.09	175,622.35
	NESTE OYJ	2,740	65.52	179,524.80
	OMV AG	2,950	49.23	145,228.50
	REPSOL SA	28,019	16.70	467,917.30
	REPSOL SA-RTS	28,019	0.47	13,393.08
	SNAM SPA	46,120	3.47	160,451.48
	TENARIS SA	9,355	15.68	146,733.17
	TOTAL SA	49,557	52.48	2,600,751.36
	VOPAK	1,270	39.96	50,749.20
	AIR LIQUIDE SA	8,919	108.85	970,833.15
	AKZO NOBEL	5,058	74.78	378,237.24
	ARCELORMITTAL	13,632	27.36	372,971.52
	ARKEMA	1,335	101.95	136,103.25
	BASF SE	19,055	83.55	1,592,045.25
	COVESTRO AG	4,320	73.92	319,334.40
	CRH PLC	17,110	31.10	532,121.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,580	29.68	106,254.40
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	43.12	74,166.40

HEIDELBERGCEMENT AG	3,095	73.22	226,615.90
IMERYS SA	830	66.40	55,112.00
K+S AG	3,880	21.63	83,924.40
KONINKLIJKE DSM NV	3,842	86.54	332,486.68
LANXESS AG	1,935	68.66	132,857.10
LINDE AG	3,855	179.00	690,045.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	4,600	34.98	160,908.00
SOLVAY SA	1,581	110.80	175,174.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	11,535	16.85	194,422.42
SYMRISE AG	2,640	75.36	198,950.40
THYSSENKRUPP AG	8,755	21.48	188,057.40
UMICORE	4,240	49.34	209,201.60
UPM-KYMMENE OYJ	11,058	30.31	335,167.98
VOESTALPINE AG	2,509	42.33	106,205.97
ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS(N)	6,086	0.90	5,501.74
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,086	35.37	215,261.82
AIRBUS GROUP SE	12,068	100.64	1,214,523.52
ALSTOM	3,220	39.45	127,029.00
ANDRITZ AG	1,420	42.82	60,804.40
BOUYGUES SA	4,210	38.10	160,401.00
BRENTAG AG	3,095	48.83	151,128.85
CNH INDUSTRIAL NV	21,030	9.24	194,359.26
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,106	39.26	396,761.56
DASSAULT AVIATION SA	50	1,638.00	81,900.00
EIFFAGE	1,580	93.90	148,362.00
FERROVIAL SA	9,975	17.96	179,151.00
GEA GROUP AG	3,940	30.32	119,460.80
HOCHTIEF AG	440	153.10	67,364.00
KION GROUP AG	1,400	66.00	92,400.00
KONE OYJ-B	6,984	44.46	310,508.64
LEGRAND SA	5,628	63.32	356,364.96
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	8,130	8.74	71,121.24
MAN SE	824	92.85	76,508.40
METSO OYJ	2,420	28.78	69,647.60
MTU AERO ENGINES AG	1,110	162.80	180,708.00
OSRAM LICHT AG	2,002	46.54	93,173.08
PRYSMIAN SPA	4,255	23.20	98,716.00
REXEL SA	6,250	12.74	79,625.00
SAFRAN SA	6,810	99.70	678,957.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	11,448	71.74	821,279.52
SIEMENS AG-REG	15,796	116.30	1,837,074.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4,180	12.33	51,560.30

THALES SA	2,165	108.40	234,686.00
VINCI SA	10,390	83.22	864,655.80
WARTSILA OYJ ABP	8,820	16.52	145,750.50
BUREAU VERITAS SA	5,650	23.26	131,419.00
EDENRED	4,646	26.91	125,023.86
RANDSTAD NV	2,285	53.24	121,653.40
RELX NV	19,429	18.50	359,533.64
SOCIETE BIC SA	565	79.80	45,087.00
TELEPERFORMANCE	1,120	150.80	168,896.00
WOLTERS KLUWER	6,297	48.69	306,600.93
ADP	650	191.60	124,540.00
AENA SA	1,380	156.75	216,315.00
ATLANTIA SPA	10,860	25.01	271,608.60
BOLLORE	20,400	4.10	83,721.60
DEUTCHE LUFTHANSA	4,950	22.73	112,513.50
DEUTSCHE POST AG-REG	20,143	29.23	588,779.89
FRAPORT AG	980	83.12	81,457.60
GETLINK	8,760	12.01	105,207.60
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	12,822	8.28	106,268.73
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,645	80.31	533,659.95
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	69.20	82,348.00
CONTINENTAL AG	2,235	209.50	468,232.50
DAIMLER AG	18,742	57.66	1,080,663.72
FAURECIA	1,630	66.50	108,395.00
FERRARI NV	2,554	120.15	306,863.10
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	22,237	16.49	366,866.02
MICHELIN (CGDE)-B	3,459	108.35	374,782.65
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,565	34.95	89,646.75
PEUGEOT SA	11,700	20.45	239,265.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,150	58.30	183,645.00
RENAULT SA	3,867	76.72	296,676.24
SCHAEFFLER AG-PRF	3,550	12.05	42,777.50
VALEO SA	4,860	50.70	246,402.00
VOLKSWAGEN AG	631	148.20	93,514.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	149.38	575,561.14
ADIDAS AG	3,831	190.95	731,529.45
HERMES INTERNATIONAL	637	529.00	336,973.00
HUGO BOSS AG -ORD	1,230	77.56	95,398.80
KERING	1,557	486.00	756,702.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,486	55.02	191,799.72
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	5,784	287.40	1,662,321.60
MONCLER SPA	3,650	39.57	144,430.50

PUMA SE	219	490.00	107,310.00
SEB SA	480	147.20	70,656.00
ACCOR SA	3,926	42.99	168,778.74
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,150	95.65	205,647.50
SODEXO	1,880	87.22	163,973.60
AXEL SPRINGER SE	995	61.35	61,043.25
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	17.62	66,886.87
JC DECAUX SA	1,580	29.02	45,851.60
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	4,805	23.60	113,398.00
PUBLICIS GROUPE	4,275	60.64	259,236.00
RTL GROUP	860	64.05	55,083.00
SES	7,520	16.06	120,771.20
TELENET GROUP HOLDING NV	1,240	40.24	49,897.60
VIVENDI	21,300	21.55	459,015.00
INDITEX	22,045	29.81	657,161.45
ZALANDO SE	2,160	47.29	102,146.40
CARREFOUR SA	12,213	14.64	178,859.38
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	33.70	45,292.80
COLRUYT SA	1,375	48.13	66,178.75
JERONIMO MARTINS	5,075	13.18	66,888.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	26,448	20.44	540,729.36
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	4,140	11.00	45,540.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	15,831	85.21	1,348,959.51
DANONE	12,354	64.75	799,921.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	10,800	6.92	74,790.00
HEINEKEN HOLDING NV	2,255	82.90	186,939.50
HEINEKEN NV	5,293	86.58	458,267.94
KERRY GROUP PLC-A	3,330	88.75	295,537.50
PERNOD-RICARD SA	4,406	141.20	622,127.20
REMY COINTREAU	470	116.40	54,708.00
BEIERSDORF AG	2,015	93.42	188,241.30
HENKEL AG & CO KGAA	2,200	95.65	210,430.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,563	108.00	384,804.00
L'OREAL	5,236	209.60	1,097,465.60
UNILEVER NV-CVA	31,775	47.57	1,511,695.62
BIOMERIEUX	750	77.10	57,825.00
ESSILOR INTERNATIONAL	4,215	120.30	507,064.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,523	87.78	397,028.94
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,605	69.86	601,145.30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	19,211	36.19	695,342.14
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	730	122.00	89,060.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,400	36.94	125,596.00

BAYER AG - RTS	4	1.67	6.68
BAYER AG-REG	18,554	98.84	1,833,877.36
EUROFINS SCIENTIFIC	220	425.80	93,676.00
GRIFOLS SA	6,260	26.86	168,143.60
IPSEN	780	132.05	102,999.00
MERCK KGAA	2,630	83.28	219,026.40
ORION OYJ-CLASS B	1,830	23.44	42,895.20
QIAGEN N.V.	4,364	31.55	137,684.20
RECORDATI SPA	2,530	34.24	86,627.20
SANOFI	23,266	69.01	1,605,586.66
UCB SA	2,588	67.34	174,275.92
ABN AMRO GROUP NV-CVA	8,570	22.64	194,024.80
AIB GROUP PLC	15,300	4.88	74,664.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	138,753	6.06	840,843.18
BANCO DE SABADELL SA	133,052	1.41	188,601.21
BANCO SANTANDER SA	333,969	4.73	1,581,009.24
BANK OF IRELAND GROUP PLC	18,619	6.95	129,402.05
BANKIA SA	23,750	3.35	79,562.50
BANKINTER SA	13,960	8.57	119,665.12
BNP PARIBAS	23,242	53.92	1,253,208.64
CAIXABANK S.A	81,100	3.67	297,799.20
COMMERZBANK AG	21,334	8.58	183,237.72
CREDIT AGRICOLE SA	23,362	11.76	274,737.12
ERSTE GROUP BANK AG	6,438	35.16	226,360.08
ING GROEP NV-CVA	80,205	12.65	1,015,074.48
INTESA SANPAOLO	275,553	2.58	713,131.16
INTESA SANPAOLO-RSP	20,000	2.69	53,960.00
KBC GROEP NV	5,119	66.28	339,287.32
MEDIOBANCA SPA	12,760	8.43	107,617.84
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	27.37	75,814.90
SOCIETE GENERALE	15,729	36.22	569,704.38
UNICREDIT SPA	41,136	14.53	598,035.16
AMUNDI SA	1,140	60.36	68,810.40
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42,465	9.49	403,162.71
DEUTSCHE BOERSE AG	4,000	114.35	457,400.00
EURAZEO SE	1,055	65.65	69,260.75
EXOR NV	2,264	58.74	132,987.36
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,632	91.02	148,544.64
NATIXIS	19,150	6.10	116,968.20
WENDEL	600	120.90	72,540.00
AEGON NV	38,139	5.30	202,212.97
AGEAS	4,044	44.07	178,219.08

ALLIANZ SE-REG	9,188	175.72	1,614,515.36
ASSICURAZIONI GENERALI	25,628	14.54	372,631.12
AXA	39,542	21.42	846,989.64
CNP ASSURANCES	3,530	19.49	68,799.70
HANNOVER RUECK SE-REG	1,275	108.70	138,592.50
MAPFRE SA	20,814	2.60	54,137.21
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,216	179.80	578,236.80
NN GROUP NV	6,340	36.03	228,430.20
POSTE ITALIANE SPA	10,260	7.34	75,369.96
SAMPO OYJ-A SHS	9,109	41.21	375,381.89
SCOR SE	3,562	32.03	114,090.86
DEUTSCHE WOHNEN SE	7,500	41.50	311,250.00
VONOVIA SE	10,248	41.20	422,217.60
AMADEUS IT GROUP SA	8,910	69.50	619,245.00
ATOS SE	1,920	122.25	234,720.00
CAP GEMINI SA	3,279	113.40	371,838.60
DASSAULT SYSTEMES SA	2,620	121.45	318,199.00
DELIVERY HERO AG	1,880	44.40	83,472.00
SAP SE	20,292	100.90	2,047,462.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,920	96.48	185,241.60
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,400	56.26	135,024.00
WIRECARD AG	2,440	147.20	359,168.00
INGENICO GROUP	1,160	73.88	85,700.80
NOKIA OYJ	119,986	5.07	608,329.02
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	68,656	13.54	929,602.24
DRILLISCH AG	980	59.10	57,918.00
ELISA OYJ	3,045	39.23	119,455.35
ILIAD SA	520	137.15	71,318.00
KONINKLIJKE KPN NV	65,606	2.42	159,028.94
ORANGE S.A.	41,574	14.49	602,615.13
PROXIMUS	3,040	20.93	63,627.20
TELECOM ITALIA SPA	233,203	0.66	155,872.88
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.57	72,913.75
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,270	3.48	56,717.22
TELEFONICA SA	95,499	7.45	712,040.54
E.ON SE	44,659	9.09	406,218.26
EDF	11,785	11.86	139,770.10
ENDESA SA	6,840	19.42	132,867.00
ENEL SPA	173,657	4.74	824,176.12
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	54,991	3.39	186,694.44
ENGIE	37,224	13.23	492,659.64
FORTUM OYJ	8,865	19.66	174,285.90

	GAS NATURAL SDG SA	7,722	21.63	167,026.86
	IBERDROLA SA	117,842	6.52	769,036.89
	INNOGY SE	2,850	36.72	104,652.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,010	17.91	161,414.15
	RWE AG	10,685	19.31	206,327.35
	SUEZ	7,629	11.48	87,619.06
	TERNA SPA	35,697	4.46	159,387.10
	UNIPER SE	3,800	25.39	96,482.00
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	12,624	18.45	232,975.92
	ASML HOLDING NV	8,512	177.35	1,509,603.20
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	23,445	23.11	541,813.95
	STMICROELECTRONICS NV	15,063	20.16	303,670.08
ユーロ小計		4,097,305		82,110,020.36 (10,495,302,802)
英ポンド	BP PLC	411,568	5.76	2,373,101.08
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	95,228	26.09	2,484,498.52
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	77,629	27.07	2,101,805.17
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	13,000	6.51	84,656.00
	ANGLO AMERICAN PLC	21,904	16.97	371,710.88
	ANTOFAGASTA PLC	8,730	10.28	89,788.05
	BHP BILLITON PLC	42,721	16.66	711,817.30
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,751	48.12	132,378.12
	FRESNILLO PLC	4,710	11.73	55,248.30
	GLENCORE PLC	238,063	3.87	921,660.90
	JOHNSON MATTHEY PLC	4,199	36.90	154,943.10
	MONDI PLC	7,400	20.15	149,110.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	1,840	57.22	105,284.80
	RIO TINTO PLC	24,875	41.82	1,040,272.50
	ASHTREAD GROUP PLC	9,930	22.52	223,623.60
	BAE SYSTEMS PLC ORD	65,595	6.25	409,968.75
	BUNZL PLC	7,276	22.96	167,056.96
	DCC PLC	1,810	68.75	124,437.50
	FERGUSON PLC	4,882	60.77	296,679.14
	MEGGITT PLC	16,205	4.91	79,679.98
	MELROSE INDUSTRIES PLC	100,000	2.21	221,900.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	33,045	9.40	310,689.09
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT-C	2,346,195	0.00	2,346.19
	SMITHS GROUP PLC	8,233	17.28	142,266.24
	TRAVIS PERKINS PLC	5,250	14.19	74,497.50
	WEIR GROUP PLC/THE	4,490	20.08	90,159.20
	BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	8.40	52,710.00
	EXPERIAN PLC	18,678	18.55	346,476.90

G4S PLC	34,639	2.71	94,114.16
INTERTEK GROUP PLC	3,365	56.82	191,199.30
RELX PLC	21,976	16.33	358,868.08
EASYJET PLC	3,840	17.90	68,755.20
ROYAL MAIL PLC	19,950	5.03	100,508.10
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,690	5.27	109,201.82
BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,600	38.19	99,294.00
BURBERRY GROUP PLC	8,904	21.62	192,504.48
PERSIMMON PLC	6,170	25.76	158,939.20
TAYLOR WIMPEY PLC	66,880	1.81	121,119.68
CARNIVAL PLC	3,850	47.43	182,605.50
COMPASS GROUP PLC	32,678	16.22	530,037.16
GVC HOLDINGS PLC	11,000	10.35	113,850.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,859	48.29	186,351.11
MERLIN ENTERTAINME	15,550	3.84	59,836.40
TUI AG-DI	9,213	17.32	159,569.16
WHITBREAD PLC	3,820	40.59	155,053.80
INFORMA PLC	25,000	8.25	206,250.00
ITV PLC	77,235	1.76	136,397.01
PEARSON PLC	17,749	8.66	153,706.34
SKY PLC	21,334	14.15	301,876.10
WPP PLC	25,954	12.20	316,768.57
KINGFISHER PLC	45,257	3.02	136,992.93
MARKS & SPENCER GROUP PLC	34,970	2.97	103,895.87
NEXT PLC	2,987	60.10	179,518.70
SAINSBURY (J) PLC	32,441	3.17	103,000.17
TESCO PLC	196,154	2.61	513,335.01
WM MORRISON SUPERMARKETS	49,255	2.49	122,891.22
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	7,335	28.35	207,947.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	47,407	39.11	1,854,087.77
COCA-COLA HBC AG-CDI	3,550	25.35	89,992.50
DIAGEO PLC	51,072	27.47	1,402,947.84
IMPERIAL BRANDS PLC	19,242	27.28	524,921.76
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,595	63.17	858,796.15
UNILEVER PLC	25,637	41.33	1,059,705.39
CONVATEC GROUP PLC	27,730	2.26	62,725.26
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	7,000	5.42	37,968.00
NMC HEALTH PLC	2,120	35.62	75,514.40
SMITH & NEPHEW PLC	18,346	13.95	256,018.43
ASTRAZENECA PLC	25,953	52.29	1,357,082.37
GLAXOSMITHKLINE PLC	101,941	15.46	1,576,007.86
SHIRE PLC	18,565	40.66	754,852.90



	BARCLAYS PLC	349,341	1.94	677,791.40
	HSBC HOLDINGS PLC	413,591	7.20	2,981,577.51
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,475,366	0.62	916,497.35
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	95,080	2.61	248,634.20
	STANDARD CHARTERED PLC	58,190	7.11	413,789.09
	3I GROUP PLC	20,499	9.32	191,132.67
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	19.98	114,285.60
	INVESTEC PLC	13,185	5.48	72,280.17
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,577	44.61	293,399.97
	SCHRODERS PLC	2,621	31.57	82,744.97
	ST JAMES' S PLACE PLC	11,000	11.82	130,075.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	53,130	3.44	182,767.20
	ADMIRAL GROUP PLC	4,245	19.12	81,164.40
	AVIVA PLC	82,385	5.14	424,117.98
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	29,333	3.48	102,166.83
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	122,761	2.69	330,840.89
	PRUDENTIAL PLC	53,062	18.14	962,544.68
	RSA INSURANCE GROUP PLC	21,498	6.81	146,573.36
	AUTO TRADER GROUP PLC	20,690	4.27	88,346.30
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,700	13.64	118,668.00
	SAGE GROUP PLC/THE	22,180	6.32	140,177.60
	BT GROUP PLC	173,382	2.18	379,273.12
	VODAFONE GROUP PLC	547,308	1.87	1,024,998.42
	CENTRICA PLC	111,175	1.58	175,656.50
	NATIONAL GRID PLC	68,318	8.34	569,772.12
	SEVERN TRENT PLC	4,423	19.30	85,363.90
	SSE PLC	20,977	13.51	283,399.27
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,325	7.50	100,017.45
英ボンド小計		8,557,357		39,911,828.67 (5,801,583,415)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	4,430	23.93	106,009.90
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	170	637.00	108,290.00
	GIVAUDAN-REG	183	2,218.00	405,894.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	9,359	49.65	464,674.35
	SIKA AG-REG	2,640	135.10	356,664.00
	ABB LTD-REG	37,695	22.20	836,829.00
	GEBERIT AG-REG	760	431.90	328,244.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	360	209.40	75,384.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	840	214.00	179,760.00
	ADECCO GROUP AG-REG	3,327	60.12	200,019.24
	SGS SA-REG	113	2,594.00	293,122.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,150	149.15	171,522.50

CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	10,649	87.24	929,018.76	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	680	475.50	323,340.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	86.85	80,770.50	
DUFREY AG-REG	690	136.30	94,047.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	45	1,800.00	81,000.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	23	6,360.00	146,280.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	75,800.00	151,600.00	
NESTLE SA-REG	64,403	75.20	4,843,105.60	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,160	174.75	202,710.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	230	746.50	171,695.00	
LONZA GROUP AG-REG	1,478	272.60	402,902.80	
NOVARTIS AG-REG	45,993	74.64	3,432,917.52	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,508	219.85	3,189,583.80	
VIFOR PHARMA AG	1,070	161.00	172,270.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	53,758	15.38	826,798.04	
JULIUS BAER GROUP LTD	4,600	59.04	271,584.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	775	85.45	66,223.75	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	370	727.00	268,990.00	
UBS GROUP AG-REG	79,442	15.47	1,229,364.95	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,080	145.60	157,248.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	640	346.20	221,568.00	
SWISS RE AG	6,569	86.72	569,663.68	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,091	297.40	919,263.40	
SWISS PRIME SITE-REG	1,460	91.30	133,298.00	
TEMENOS AG	1,230	148.90	183,147.00	
SWISSCOM AG-REG	504	447.70	225,640.80	
スイスフラン小計	356,407		22,820,443.59 (2,533,069,238)	
スウェーデンク ローナ	EPIROC AB-A	13,705	88.06	1,206,862.30
	EPIROC AB-B	9,100	80.00	728,000.00
	LUNDIN PETROLEUM AB	4,320	273.50	1,181,520.00
	BOLIDEN AB	5,920	294.30	1,742,256.00
	ALFA LAVAL AB	6,030	214.90	1,295,847.00
	ASSA ABLOY AB-B	20,660	186.85	3,860,321.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	13,705	264.50	3,624,972.50
	ATLAS COPCO AB-B SHS	9,100	240.00	2,184,000.00
	SANDVIK AB	23,320	152.80	3,563,296.00
	SKANSKA AB-B SHS	7,170	157.85	1,131,784.50
	SKF AB-B SHARES-B	7,829	165.30	1,294,133.70
	VOLVO AB-B SHS-B	31,980	142.00	4,541,160.00
	SECURITAS AB-B SHS	5,849	144.10	842,840.90
	ELECTROLUX AB - B	4,825	208.00	1,003,600.00

	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	84.74	718,595.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,788	138.24	2,597,253.12	
	ICA GRUPPEN AB	1,450	274.50	398,025.00	
	SWEDISH MATCH AB	4,040	429.80	1,736,392.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	12,875	217.50	2,800,312.50	
	NORDEA BANK AB	60,808	84.92	5,163,815.36	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	30,130	81.80	2,464,634.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31,220	97.00	3,028,340.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	18,460	188.20	3,474,172.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	3,370	173.90	586,043.00	
	INVESTOR AB-B SHS	9,135	358.50	3,274,897.50	
	KINNEVIK AB - B	4,885	307.60	1,502,626.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,400	276.20	386,680.00	
	ERICSSON LM-B SHS	64,235	68.60	4,406,521.00	
	HEXAGON AB-B SHS	5,260	504.00	2,651,040.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	529.50	725,415.00	
	TELE2 AB-B SHS	7,555	111.90	845,404.50	
	TELIA CO AB	57,340	41.49	2,379,036.60	
	スウェーデンクローナ小計	504,314		67,339,796.68	(834,340,080)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	2,200	305.80	672,760.00	
	EQUINOR ASA	23,294	214.30	4,991,904.20	
	NORSK HYDRO A S	26,460	51.16	1,353,693.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	3,780	335.00	1,266,300.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,070	240.00	496,800.00	
	MARINE HARVEST	8,740	164.75	1,439,915.00	
	ORKLA ASA	17,310	73.12	1,265,707.20	
	DNB ASA	19,945	157.50	3,141,337.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	128.60	540,120.00	
	TELENOR ASA	14,895	168.00	2,502,360.00	
	ノルウェークローネ小計	122,894		17,670,897.50	(239,087,243)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,890	631.20	1,192,968.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,845	324.50	1,572,202.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	4,440	410.80	1,823,952.00	
	ISS A/S	3,100	224.50	695,950.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	80	8,440.00	675,200.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	138	8,910.00	1,229,580.00	
	DSV A/S	3,870	523.60	2,026,332.00	
	PANDORA A/S	2,190	487.70	1,068,063.00	
	CARLSBERG AS-B	2,180	750.60	1,636,308.00	
	COLOPLAST-B	2,545	640.40	1,629,818.00	

	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,610	256.40	669,204.00
	GENMAB A/S	1,180	994.80	1,173,864.00
	H LUNDBECK A/S	1,460	474.10	692,186.00
	NOVO NORDISK A/S-B	36,375	301.00	10,948,875.00
	DANSKE BANK A/S	16,415	206.70	3,392,980.50
	TRYG A/S	2,575	152.30	392,172.50
	ORSTED A/S	3,870	380.90	1,474,083.00
	デンマーククロネ小計	89,763		32,293,738.50 (553,837,615)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	5,335	32.25	172,053.75
	OIL SEARCH LTD	28,830	8.35	240,730.50
	ORIGIN ENERGY LTD	35,950	9.72	349,434.00
	SANTOS LTD	39,755	5.94	236,144.70
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,013	34.37	619,106.81
	ALUMINA LTD	46,512	2.76	128,373.12
	AMCOR LIMITED	23,840	14.33	341,627.20
	BHP BILLITON LTD	66,686	32.52	2,168,628.72
	BLUESCOPE STEEL LTD	11,500	17.95	206,425.00
	BORAL LTD	25,275	6.57	166,056.75
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,665	4.59	136,162.35
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	3.51	110,740.50
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	8,505	22.24	189,151.20
	NEWCREST MINING LTD	15,439	21.47	331,475.33
	ORICA LIMITED	7,605	17.93	136,357.65
	RIO TINTO LTD	8,718	82.46	718,886.28
	SOUTH32 LTD	106,097	3.63	385,132.11
	CIMIC GROUP LTD	1,867	41.91	78,245.97
	BRAMBLES LTD	32,868	9.04	297,126.72
	SEEK LTD	6,920	22.39	154,938.80
	AURIZON HOLDINGS LTD	41,770	4.43	185,041.10
	SYDNEY AIRPORT	24,156	7.55	182,377.80
	TRANSURBAN GROUP	45,855	12.21	559,889.55
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	12,980	30.88	400,822.40
	CROWN RESORTS LTD	6,745	13.60	91,732.00
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,180	53.43	63,047.40
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	970	62.37	60,498.90
	TABCORP HOLDINGS LTD	39,384	4.54	178,803.36
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	10,760	3.45	37,122.00
	WESFARMERS LTD	22,995	49.20	1,131,354.00
	WOOLWORTHS GROUP LTD	26,772	29.96	802,089.12
	COCA-COLA AMATIL LTD	10,650	9.01	95,956.50
	TREASURY WINE ESTATES LTD	15,946	18.42	293,725.32

	COCHLEAR LTD	1,277	201.94	257,877.38	
	HEALTHSCOPE LTD	33,080	2.18	72,114.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	56.11	164,682.85	
	SONIC HEALTHCARE LTD	8,110	25.24	204,696.40	
	CSL LTD	9,312	198.47	1,848,152.64	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	60,029	28.65	1,719,830.85	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	10.51	85,341.20	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.77	112,848.06	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	36,367	73.86	2,686,066.62	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	55,573	27.64	1,536,037.72	
	WESTPAC BANKING CORP	70,591	29.38	2,073,963.58	
	AMP LTD	59,627	3.63	216,446.01	
	ASX LTD	4,035	64.29	259,410.15	
	CHALLENGER LTD	12,110	12.36	149,679.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	6,494	122.03	792,462.82	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	8.57	431,053.86	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	62,000	2.91	180,420.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	29,260	9.64	282,066.40	
	SUNCORP GROUP LTD	27,180	14.74	400,633.20	
	COMPUTERSHARE LTD	9,430	18.68	176,152.40	
	REA GROUP LTD	1,150	93.20	107,180.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	88,954	2.68	238,396.72	
	TPG TELECOM LTD	7,840	5.27	41,316.80	
	AGL ENERGY LTD	12,851	21.90	281,436.90	
	AUSNET SERVICES	40,750	1.58	64,588.75	
豪ドル小計		1,518,944		25,632,112.22	(2,085,941,292)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	18,583	6.82	126,736.06	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	21,455	6.90	148,039.50	
	A2 MILK CO LTD	15,000	11.95	179,250.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	10,700	15.15	162,105.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	8,500	12.00	102,000.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	35,157	3.66	128,674.62	
	MERIDIAN ENERGY LTD	28,000	3.16	88,480.00	
ニュージーランドドル小計		137,395		935,285.18	(70,903,969)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	55,708	84.80	4,724,038.40	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	14.12	402,420.00	
	MTR CORP	34,000	43.45	1,477,300.00	
	MINTH GROUP LTD	14,000	34.00	476,000.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	3.00	414,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	44.05	1,277,450.00	

YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	22.45	325,525.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	49,000	63.70	3,121,300.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	16,800	20.60	346,080.00	
SANDS CHINA LTD	49,800	43.95	2,188,710.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	15.46	432,880.00	
SJM HOLDINGS LTD	48,000	10.32	495,360.00	
WYNN MACAU LTD	35,800	26.65	954,070.00	
WH GROUP LTD	182,000	6.43	1,170,260.00	
BANK OF EAST ASIA	26,040	31.95	831,978.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	77,000	38.40	2,956,800.00	
HANG SENG BANK LTD	15,900	194.70	3,095,730.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	24,300	242.20	5,885,460.00	
AIA GROUP LTD	247,790	68.60	16,998,394.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	53,708	64.45	3,461,480.60	
HANG LUNG GROUP LTD	17,000	22.85	388,450.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	46,000	16.62	764,520.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27,638	42.70	1,180,142.60	
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	45.15	677,250.00	
KERRY PROPERTIES LTD	11,450	42.45	486,052.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	125,666	11.30	1,420,025.80	
SINO LAND CO	63,050	13.08	824,694.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	34,480	121.90	4,203,112.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	10,517	85.40	898,151.80	
SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	30.15	699,480.00	
WHARF HOLDINGS LTD	24,800	26.10	647,280.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	24,800	59.50	1,475,600.00	
WHEELLOCK & CO LTD	17,600	56.65	997,040.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	70,000	9.96	697,200.00	
PCCW LTD	80,000	4.49	359,200.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	13,000	57.45	746,850.00	
CLP HOLDINGS LTD	34,500	80.20	2,766,900.00	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	56,000	7.45	417,200.00	
HONG KONG & CHINA GAS	188,668	14.94	2,818,699.92	
POWER ASSETS HOLDINGS	28,500	54.60	1,556,100.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,200	100.50	623,100.00	
香港ドル小計	2,085,915		75,682,284.62 (1,058,038,338)	
シンガポールドル				
KEPPEL CORP LTD	29,060	7.05	204,873.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	21,000	2.76	57,960.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.35	110,550.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	50,900	0.95	48,609.50	
COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.23	102,580.00	

	SATS LTD	13,000	4.95	64,350.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	12,800	11.02	141,056.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	125,000	1.23	153,750.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	32,550	2.67	86,908.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	32.55	65,100.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.33	42,900.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	49,660	3.14	155,932.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	36,715	26.89	987,266.35	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	63,840	11.75	750,120.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	27,100	26.31	713,001.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	15,800	7.17	113,286.00	
	CAPITALAND LTD	51,800	3.22	166,796.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	11.12	111,200.00	
	UOL GROUP LTD	9,350	7.56	70,686.00	
	VENTURE CORP LTD	5,600	18.06	101,136.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	172,180	3.12	537,201.60	
シンガポールドル小計		937,355		4,785,262.35	(385,739,998)
イスラエルシュケル	FRUTAROM	810	353.50	286,335.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	13,070	17.29	225,980.30	
	ELBIT SYSTEMS LTD	500	443.40	221,700.00	
	BANK HAPOLIM BM	21,225	24.97	529,988.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	30,255	21.85	661,071.75	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,900	69.05	200,245.00	
	AZRIELI GROUP LTD	940	184.30	173,242.00	
	NICE LTD	1,385	389.00	538,765.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	4.02	196,379.75	
イスラエルシュケル小計		119,875		3,033,707.05	(92,285,368)
合 計		25,687,557		81,748,907,309	(81,748,907,309)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	出資金	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP	3,327.00	83,141.73	
	出資金小計		3,327.00	83,141.73	(9,119,816)
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	7,890	149,121.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	2,050	260,514.00	
		AMERICAN TOWER CORP	9,169	1,309,516.58	

		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	22,720	241,286.40
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,825	482,594.75
		BOSTON PROPERTIES INC	3,147	395,263.20
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	178,848.60
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,410	871,276.00
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,135	446,125.15
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	197,725.00
		EQUINIX INC	1,618	677,715.48
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	475,293.60
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	329,532.00
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,450	243,211.50
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	177,738.15
		GGP INC	15,475	319,558.75
		HCP INC	9,285	230,453.70
		HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	324,919.98
		INVITATION HOMES INC	6,200	140,120.00
		IRON MOUNTAIN INC	5,515	193,025.00
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	157,430.50
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	137,937.03
		MACERICH CO/THE	2,460	142,065.00
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	226,046.60
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	130,752.70
		PROLOGIS INC	10,932	703,036.92
		PUBLIC STORAGE	3,259	736,403.64
		REALTY INCOME CORP	5,400	290,412.00
		REGENCY CENTERS CORP	3,175	199,009.00
		SBA COMMUNICATIONS CORP	2,390	387,323.40
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,754	1,167,428.90
		SL GREEN REALTY CORP	2,040	207,243.60
		UDR INC	5,820	216,678.60
		VENTAS INC	7,285	405,701.65
		VEREIT INC	19,554	147,437.16
		VORNADO REALTY TRUST	3,491	257,112.15
		WELLTOWER INC	7,380	435,789.00
		WEYERHAEUSER CO	15,508	552,084.80
		投資証券小計	247,834	14,143,731.49 (1,551,425,907)
		米ドル小計	251,161	14,226,873.22 (1,560,545,723)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	47,642.40
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	82,269.20
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	51,528.10



加ドル小計			7,410	181,439.70 (14,966,960)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	595	52,865.75
		GECINA SA	970	139,098.00
		ICADE	685	55,450.75
		KLEPIERRE	4,732	156,108.68
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,770	528,100.50
ユーロ小計			9,752	931,623.68 (119,080,138)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	20,201	138,902.07
		HAMMERSON PLC	15,295	81,614.12
		LAND SECURITIES GROUP PLC	15,214	144,913.35
		SEGRO PLC	21,263	140,803.58
英ポンド小計			71,973	506,233.12 (73,586,046)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	22,538	221,999.30
		DEXUS	21,247	211,832.59
		GOODMAN GROUP	37,672	371,069.20
		GPT GROUP	37,975	197,470.00
		LENLEASE GROUP	12,197	242,598.33
		MIRVAC GROUP	78,535	176,703.75
		SCENTRE GROUP	107,261	468,730.57
		STOCKLAND	50,500	211,595.00
		VICINITY CENTRES	72,862	198,184.64
豪ドル小計			440,787	2,300,183.38 (187,188,923)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	46,000	3,220,000.00
香港ドル小計			46,000	3,220,000.00 (45,015,600)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	51,900	134,940.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	54,940	90,101.60
		CAPITALAND MALL TRUST	48,100	97,643.00
		SUNTEC REIT	54,600	92,274.00
シンガポールドル小計			209,540	414,958.60 (33,449,812)
合計				2,033,833,202 (2,033,833,202)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入出資金 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	出資金 1銘柄		0.0%		0.0%
	株式 598銘柄	97.2%			65.0%
	投資証券 38銘柄			2.8%	1.9%
加ドル	株式 87銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 242銘柄	98.9%			12.5%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英ポンド	株式 98銘柄	98.7%			6.9%
	投資証券 4銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
豪ドル	株式 58銘柄	91.8%			2.5%
	投資証券 9銘柄			8.2%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 41銘柄	95.9%			1.3%
	投資証券 1銘柄			4.1%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	92.0%			0.5%
	投資証券 4銘柄			8.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	277,464,637	270,963,674
金銭信託	-	35,296,200
コール・ローン	137,230,848	15,320,087
株式	14,886,171,808	15,433,040,969
投資信託受益証券	49,896,384	58,464,360

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
投資証券	69,637,993	60,219,457
派生商品評価勘定	20,698,314	346,072
未収入金	5,201,249	5,296,515
未収配当金	10,426,585	38,104,157
差入委託証拠金	366,040,330	388,420,969
流動資産合計	15,822,768,148	16,305,472,460
資産合計	15,822,768,148	16,305,472,460
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	29,396,372
未払金	31,647,993	-
未払解約金	3,760,000	-
未払利息	193	16
流動負債合計	35,408,186	29,396,388
負債合計	35,408,186	29,396,388
純資産の部		
元本等		
元本	8,154,304,705	9,038,460,715
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,633,055,257	7,237,615,357
元本等合計	15,787,359,962	16,276,076,072
純資産合計	15,787,359,962	16,276,076,072
負債純資産合計	15,822,768,148	16,305,472,460

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

## （貸借対照表に関する注記）

		平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
1.	期首	平成29年 6月27日	平成29年12月26日
	期首元本額	7,321,484,408円	8,154,304,705円
	期首からの追加設定元本額	1,220,338,963円	1,232,535,529円
	期首からの一部解約元本額	387,518,666円	348,379,519円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	1,794,783,177円	1,813,348,190円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	24,477,692円	24,089,743円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	6,335,043,836円	7,201,022,782円
	計	8,154,304,705円	9,038,460,715円
2.	受益権の総数	8,154,304,705口	9,038,460,715口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在

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

（有価証券に関する注記）

（平成29年12月25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	1,557,687,289
投資信託受益証券	3,568,312
投資証券	480,625
合計	1,561,736,226

（平成30年 6月25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	629,128,090
投資信託受益証券	1,697,867
投資証券	4,630,790
合計	635,456,747

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成29年12月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	766,418,202	-	787,112,683	20,694,481
合計		766,418,202	-	787,112,683	20,694,481

(平成30年 6月25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	749,145,405	-	720,095,105	29,050,300
合計		749,145,405	-	720,095,105	29,050,300

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成29年12月25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	2,044,154	-	2,047,987	3,833
	マレーシアリン ギット	2,044,154	-	2,047,987	3,833
合計		2,044,154	-	2,047,987	3,833

## (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。

(平成30年 6月25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)

平成29年12月25日現在		平成30年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.9361円	1口当たり純資産額	1.8008円
(1万口当たり純資産額)	(19,361円)	(1万口当たり純資産額)	(18,008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	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	4,040	19.80	79,992.00	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	147,240	4.31	635,929.56	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	25,600	1.34	34,534.40	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	11,565	66.10	764,446.50	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,506	142.80	357,856.80	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A. -ADR	12,800	9.43	120,704.00	
	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	5,050	7.98	40,299.00	
	ROSNEFT PJSC-REG S GDR	34,410	6.16	212,172.06	
	SURGUTNEFTGAS-SP ADR	36,800	4.45	163,907.20	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	6,999	63.64	445,416.36	
	ULTRAPAR PARTICPAC-SPON ADR	380	12.18	4,628.40	
	BRASKEM SA-SPON ADR	1,780	26.68	47,490.40	
	CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	6,384	6.37	40,666.08	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5,450	14.97	81,586.50	
	CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR	10,170	2.07	21,051.90	
	FIBRIA CELULO SA-ADR	600	18.84	11,304.00	
	GERDAU SA -SPON ADR	3,700	3.76	13,912.00	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL WORKS-GDR	5,600	9.20	51,520.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	17,324	17.86	309,493.26	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	3,490	25.15	87,773.50	
	PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	3,700	12.99	48,063.00	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,740	31.10	54,114.00	
	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	1,100	49.18	54,098.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	8,270	15.40	127,358.00	
	SOUTHERN COPPER CORP(US)	2,230	46.72	104,185.60	
	VALE SA-SP ADR	26,510	12.81	339,593.10	
	EMBRAER SA ADR	320	25.62	8,198.40	
	51JOB INC-ADR	600	105.06	63,036.00	
	DP WORLD LTD	4,470	22.90	102,363.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	110	92.58	10,183.80	
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	2,280	10.95	24,966.00		
HUAZHU GROUP LTD-ADR	3,500	45.87	160,545.00		
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	3,610	100.92	364,321.20		



TAL EDUCATION GROUP- ADR	8,330	39.24	326,869.20
YUM CHINA HOLDINGS INC	10,450	40.46	422,807.00
GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR	3,410	17.90	61,039.00
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	10,690	48.78	521,458.20
JD.COM INC-ADR	19,230	40.82	784,968.60
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,750	11.23	120,722.50
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	2,730	20.62	56,292.60
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	9,820	17.34	170,327.90
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	3,050	27.90	85,095.00
AMBEV SA-ADR	12,220	4.81	58,778.20
BRF SA-ADR	2,580	5.21	13,441.80
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	1,780	25.17	44,802.60
EMBOTELLADORA ANDINA-ADR B	200	24.82	4,964.00
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	540	85.05	45,927.00
BANCO BRADESCO-ADR	9,942	6.90	68,599.80
BANCO DE CHILE-ADR	70	94.57	6,619.90
BANCO SANTANDER BRASIL-ADS	1,100	7.92	8,712.00
BANCO SANTANDER MEXICO -ADR	2,600	6.60	17,160.00
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2,673	31.76	84,894.48
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	3,060	47.04	143,942.40
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	1,600	4.66	7,464.00
CREDICORP LTD	1,765	220.53	389,235.45
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	1,850	8.16	15,096.00
ITAU CORPBANCA-ADR	800	15.20	12,160.00
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	16,850	10.42	175,577.00
SBERBANK-SPONSORED ADR	73,510	13.94	1,024,729.40
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	61,030	1.46	89,408.95
NOAH HOLDINGS LTD-SPON-ADR	700	55.70	38,990.00
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	23,400	1.42	33,438.60
58.COM INC-ADR	2,490	78.33	195,041.70
ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	30,920	202.01	6,246,149.20
AUTOHOME INC-ADR	1,470	114.40	168,168.00
BAIDU INC - SPON ADR	7,410	259.00	1,919,190.00
FANG HOLDINGS LTD-ADR	5,500	4.15	22,825.00
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,400	42.77	59,878.00

	MOMO INC-SPON-ADR	2,900	50.78	147,262.00	
	NETEASE INC-ADR	2,145	259.40	556,413.00	
	SINA CORP	1,570	88.81	139,431.70	
	WEIBO CORP-SPON-ADR	1,194	98.17	117,214.98	
	YY INC-ADR	1,110	115.54	128,249.40	
	AMERICA MOVIL-SPN CL L-ADR	3,450	16.30	56,235.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	13,892	8.48	117,804.16	
	TELEF BRASIL-ADR	5,624	12.01	67,544.24	
	TIM PARTICIPACOES SA-ADR	400	17.08	6,832.00	
	CEMIG SA -SPONS ADR	3,800	1.71	6,498.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	6,180	6.03	37,265.40	
	ENEL AMERICAS SA-SPONS ADR	1,780	9.30	16,554.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	1,500	5.10	7,650.00	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	61,000	1.04	63,806.00	
	米ドル小計	852,793		19,899,242.38 (2,182,747,896)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	331,903	12.75	4,231,763.25	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	102,778	57.16	5,874,790.48	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	4,910	337.17	1,655,504.70	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	26,565	56.24	1,494,015.60	
	ALFA S.A.B. -A	88,700	22.23	1,971,801.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	13,700	64.10	878,170.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	7,900	185.93	1,468,847.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	5,950	319.89	1,903,345.50	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,900	178.20	1,051,380.00	
	ALSEA SAB DE CV	12,100	66.16	800,536.00	
	GRUPO TELEVISA SAB	49,700	71.66	3,561,502.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	4,400	118.19	520,036.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	142,000	52.88	7,508,960.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10,900	123.06	1,341,354.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	12,400	116.01	1,438,524.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	46,600	170.35	7,938,310.00	
	GRUMA S.A.B. -B	5,500	238.10	1,309,550.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	40,800	37.22	1,518,576.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	41,670	31.31	1,304,687.70	

	BANCO SANTANDER MEXICO-B	32,000	26.65	852,800.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	66,900	111.33	7,447,977.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	59,200	28.24	1,671,808.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	835,800	16.31	13,631,898.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	13,300	86.58	1,151,514.00	
メキシコペソ小計		1,961,576		72,527,650.23 (396,726,246)	
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	3,900	35.39	138,021.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	53,360	17.76	947,673.60	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	94,500	15.11	1,427,895.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	9,140	45.93	419,800.20	
	BRASKEM SA-PREF A	1,000	50.74	50,740.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	7,800	7.72	60,216.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	5,929	71.33	422,915.57	
	GERDAU SA-PREF	22,000	14.26	313,720.00	
	KLABIN SA - UNIT	14,900	19.37	288,613.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	11,000	43.88	482,680.00	
	VALE SA	58,639	48.01	2,815,258.39	
	EMBRAER SA	16,000	24.30	388,800.00	
	WEG SA	18,486	15.44	285,423.84	
	CCR SA	34,820	9.84	342,628.80	
	LOCALIZA RENT A CAR	13,261	22.82	302,616.02	
	RUMO SA	27,800	13.08	363,624.00	
	KROTON EDUCACIONAL SA	39,008	9.65	376,427.20	
	LOJAS AMERICANAS SA-PRF	18,892	15.91	300,571.72	
	LOJAS RENNER S.A.	19,600	28.38	556,248.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	1,900	122.81	233,339.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8,500	17.54	149,090.00	
	ATACADA0 DISTRIBUICAO COMERC	12,400	15.26	189,224.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	1,450	78.00	113,100.00	
	RAIA DROGASIL SA	6,060	67.87	411,292.20	
	AMBEV SA	114,200	18.16	2,073,872.00	
	BRF SA	8,400	19.45	163,380.00	
	JBS SA	21,600	9.33	201,528.00	
	M DIAS BRANCO SA	2,850	39.00	111,150.00	

	NATURA COSMETICOS SA	4,300	30.29	130,247.00	
	ODONTOPREV S.A.	6,700	12.62	84,554.00	
	HYPERMARCAS SA	9,000	27.80	250,200.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	26,969	23.60	636,468.40	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	80,449	26.14	2,102,936.86	
	BANCO DO BRASIL S.A.	23,100	26.10	602,910.00	
	BANCO SAN. BRASIL-UNIT	9,700	30.15	292,455.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	70,436	39.34	2,770,952.24	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	121,841	8.98	1,094,132.18	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	55,783	19.97	1,113,986.51	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	19,000	24.32	462,080.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	2,600	47.01	122,226.00	
	PORTO SEGURO SA	3,200	38.80	124,160.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	6,362	18.27	116,233.74	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	22,197	9.13	202,658.61	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,900	53.76	155,904.00	
	CIELO SA	33,688	15.33	516,437.04	
	TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	6,830	45.50	310,765.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	19,905	12.88	256,376.40	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS	5,900	12.87	75,933.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	6,600	15.22	100,452.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	19,399	6.59	127,839.41	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,160	22.80	49,248.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,300	14.05	102,565.00	
	ENGIE BRASIL SA	4,300	33.78	145,254.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	5,660	56.98	322,506.80	
	ブラジルリアル小計	1,223,674		26,199,328.73	(758,994,553)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	11,820	9,889.60	116,895,072.00	
	EMPRESAS CMPC SA	32,000	2,382.80	76,249,600.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	2,020	31,515.00	63,660,300.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	5,300	7,020.40	37,208,120.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	20,500	5,934.40	121,655,200.00	
	CENCOSUD SA	40,550	1,669.10	67,682,005.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	5,600	2,639.40	14,780,640.00	

	BANCO DE CHILE	599,174	100.90	60,456,656.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,130	42,982.00	48,569,660.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	747,000	50.57	37,775,790.00	
	ITAU CORPBANCA	2,600,000	6.46	16,809,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	4,140	6,078.90	25,166,646.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	69,000	364.22	25,131,180.00	
	COLBUN SA	208,000	139.20	28,953,600.00	
	ENEL AMERICAS SA	656,060	118.03	77,434,761.80	
	ENEL CHILE SA	658,500	65.42	43,079,070.00	
チリペソ小計		5,660,794		861,507,301.40	(148,351,557)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	50,000	2,880.00	144,000,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	11,190	9,600.00	107,424,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	7,360	19,000.00	139,840,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,400	33,500.00	147,400,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	2,000	34,100.00	68,200,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	47,000	1,190.00	55,930,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	6,600	36,500.00	240,900,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF-PRF	2,300	34,020.00	78,246,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	13,000	13,660.00	177,580,000.00	
コロンビアペソ小計		143,850		1,159,520,000.00	(43,597,952)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	1,250	22.05	27,562.50	
	OPAP SA	6,000	9.40	56,400.00	
	JUMBO SA	2,700	13.16	35,532.00	
	ALPHA BANK AE	37,000	2.00	74,000.00	
	EUROBANK ERGASIAS SA	49,000	0.95	46,550.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	145,000	0.28	40,600.00	
	PIRAEUS BANK S.A	7,500	3.04	22,845.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,500	10.54	68,510.00	
ユーロ小計		254,950		371,999.50	(47,548,976)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	3,070	113.50	348,445.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	35,017	10.52	368,378.84	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	18,200	4.65	84,630.00	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	9,000	21.14	190,260.00	
	KOC HOLDING AS	18,924	14.45	273,451.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	21,170	4.14	87,643.80	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	4,300	23.00	98,900.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	14,550	12.90	187,695.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,700	69.75	118,575.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	3,300	25.48	84,084.00	
	ARCELIK A.S.	6,500	16.22	105,430.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,500	68.25	375,375.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK	5,581	24.00	133,944.00	
	COCA-COLA ICECEK URETIM AS	2,000	33.20	66,400.00	
	ULKER BISKUVI SANAYI	4,100	18.72	76,752.00	
	AKBANK T.A.S.	61,659	7.37	454,426.83	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	63,390	8.52	540,082.80	
	TURKIYE HALK BANKASI	14,660	7.43	108,923.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	39,904	6.00	239,424.00	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	19,682	4.90	96,441.80	
	YAPI VE KREDI BANKASI	45,308	2.35	106,473.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	23,953	8.90	213,181.70	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	32,356	11.50	372,094.00	
	トルコリラ小計	453,824		4,731,013.17	(112,361,562)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,950	916.00	1,786,200.00	
	MONETA MONEY BANK AS	12,500	76.10	951,250.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	1,750	254.50	445,375.00	
	CEZ AS	4,180	553.50	2,313,630.00	
	チェココルナ小計	20,380		5,496,455.00	(27,207,452)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	9,840	2,614.00	25,721,760.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	3,550	5,015.00	17,803,250.00	
	OTP BANK PLC	6,435	10,080.00	64,864,800.00	
	ハンガリーフォリント小計	19,825		108,389,810.00	(42,640,551)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	2,550	56.00	142,800.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	8,270	82.80	684,756.00	

	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	43,985	5.68	249,834.80	
	GRUPA AZOTY SA	1,400	44.32	62,048.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,300	80.10	104,130.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,710	87.00	322,770.00	
	CCC SA	750	225.40	169,050.00	
	LPP SA	33	9,135.00	301,455.00	
	CYFROWY POLSAT SA	5,600	22.68	127,008.00	
	DINO POLSKA SA	1,120	98.15	109,928.00	
	ALIOR BANK SA	2,380	69.00	164,220.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	850	69.00	58,650.00	
	BANK MILLENNIUM SA	16,500	8.05	132,825.00	
	BANK PEKAO SA	4,372	114.75	501,687.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	900	344.00	309,600.00	
	MBANK	410	402.00	164,820.00	
	PKO BANK POLSKI SA	25,765	37.90	976,493.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	16,290	38.26	623,255.40	
	CD PROJEKT SA	1,830	166.30	304,329.00	
	ORANGE POLSKA SA	18,105	4.76	86,179.80	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	2,630	26.18	68,853.40	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	20,400	9.46	192,984.00	
	ポーランドズロチ小計	179,150		5,857,676.90	(173,152,929)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	46,000	7.35	338,100.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	685,300	7.05	4,831,365.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	93,500	20.80	1,944,800.00	
	CNOOC LTD	479,000	12.34	5,910,860.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	80,000	6.92	553,600.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	575,000	5.71	3,283,250.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	50,000	11.20	560,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	103,000	3.60	370,800.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	28,000	8.18	229,040.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	32,500	47.00	1,527,500.00	
	BBMG CORP-H	62,000	2.95	182,900.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	99,000	3.99	395,010.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	100,000	8.82	882,000.00	

CHINA RESOURCES CEMENT	48,000	8.87	425,760.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	43,200	4.35	187,920.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	31,000	10.44	323,640.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	37,000	8.12	300,440.00	
MMG LTD	56,000	5.82	325,920.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	42,000	10.82	454,440.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	88,500	4.86	430,110.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	28,000	6.01	168,280.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	181,750	3.18	577,965.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	52,000	4.60	239,200.00	
BOC AVIATION LTD	5,000	49.45	247,250.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	126,000	8.14	1,025,640.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	45,500	28.90	1,314,950.00	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	12,000	10.40	124,800.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	60,500	8.23	497,915.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	100,000	6.08	608,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	52,000	8.89	462,280.00	
CITIC LTD	159,000	11.10	1,764,900.00	
CRRC CORP LTD- H	109,000	6.28	684,520.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	66,500	15.54	1,033,410.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	16,000	19.36	309,760.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	75,000	2.34	175,500.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	70,000	2.70	189,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	13,000	19.10	248,300.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	31,500	8.10	255,150.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	17,000	14.90	253,300.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	48,400	11.34	548,856.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-H	16,200	10.16	164,592.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	14,500	37.85	548,825.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	55,000	10.18	559,900.00	
AIR CHINA LTD-H	58,000	8.67	502,860.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40,000	8.73	349,200.00	
CAR INC	20,000	7.76	155,200.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	61,500	3.80	233,700.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	36,000	6.12	220,320.00	



CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	35,000	16.60	581,000.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	48,000	7.73	371,040.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	100,000	1.39	139,000.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	32,000	3.90	124,800.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	42,000	6.81	286,020.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	32,000	10.22	327,040.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	22,500	16.28	366,300.00	
SINOTRANS LIMITED-H	49,000	4.14	202,860.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	43,000	7.22	310,460.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	42,500	8.07	342,975.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	80,000	14.48	1,158,400.00	
BYD CO LTD-H	18,000	48.80	878,400.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	78,000	4.18	326,040.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	19,000	8.15	154,850.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	68,000	8.87	603,160.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	12,800	27.75	355,200.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	132,000	21.70	2,864,400.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	83,000	6.66	552,780.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	78,845	8.24	649,682.80	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	21,000	11.82	248,220.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30,000	43.40	1,302,000.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	36,000	27.65	995,400.00	
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	580,000	0.29	171,100.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20,000	96.90	1,938,000.00	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	48,000	3.84	184,320.00	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	58,000	3.13	181,540.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	300,000	0.90	270,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,400	71.40	314,160.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	291,160	0.79	230,016.40	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	13,500	24.60	332,100.00	
SUN ART RETAIL GROUP	59,000	11.14	657,260.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	0.42	37,800.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	72,000	28.00	2,016,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	45,000	37.90	1,705,500.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	50,000	6.03	301,500.00	

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	50,000	18.44	922,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	10,000	46.10	461,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	31,000	9.57	296,670.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	132,000	7.42	979,440.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20,000	78.55	1,571,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	88,000	7.73	680,240.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	44,000	5.76	253,440.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	23,100	21.90	505,890.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	32,000	32.50	1,040,000.00	
3SBIO INC	30,500	19.10	582,550.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	35,000	17.44	610,400.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	49,500	10.88	538,560.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	48,000	7.00	336,000.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	126,000	23.65	2,979,900.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20,000	23.60	472,000.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	27,500	8.24	226,600.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	12,500	45.05	563,125.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	90,000	1.86	167,400.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	175,500	12.22	2,144,610.00	
SSY GROUP LTD	36,000	9.32	335,520.00	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	15,000	13.16	197,400.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	13,000	89.75	1,166,750.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	777,000	3.77	2,929,290.00	
BANK OF CHINA LTD - H	2,144,000	3.90	8,361,600.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	239,245	6.16	1,473,749.20	
CHINA CITIC BANK - H	246,000	5.07	1,247,220.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,559,920	7.38	18,892,209.60	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	70,000	3.75	262,500.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	103,150	29.80	3,073,870.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	142,200	7.06	1,003,932.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	75,000	5.03	377,250.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	1,868,575	6.03	11,267,507.25	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	67,000	5.23	350,410.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	251,000	2.69	675,190.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	30,000	15.46	463,800.00	

CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	84,000	4.24	356,160.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	261,000	2.50	652,500.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	25,200	14.76	371,952.00	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	412,000	0.93	383,160.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	63,500	16.48	1,046,480.00	
FAR EAST HORIZON LTD	50,000	7.83	391,500.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	35,600	11.60	412,960.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	14,400	16.92	243,648.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	93,600	8.34	780,624.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	47,400	13.06	619,044.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	202,000	20.85	4,211,700.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	71,000	32.00	2,272,000.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	135,000	1.72	232,200.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	42,940	27.00	1,159,380.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	22,600	35.35	798,910.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	181,000	3.77	682,370.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	125,334	13.36	1,674,462.24	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	140,500	75.65	10,628,825.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	4,300	52.35	225,105.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	44,000	15.30	673,200.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	75,000	21.65	1,623,750.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	136,000	4.23	575,280.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	102,320	26.85	2,747,292.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	75,777	27.55	2,087,656.35	
CHINA VANKE CO LTD-H	30,360	29.25	888,030.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	86,000	5.88	505,680.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	202,713	15.64	3,170,431.32	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	190,000	3.57	678,300.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	42,000	7.72	324,240.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	21,000	11.48	241,080.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	16.88	445,632.00	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	24,000	13.88	333,120.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	50,000	3.80	190,000.00	
KWG PROPERTY HOLDING LTD	30,500	11.18	340,990.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	34,000	11.70	397,800.00	

LONGFOR PROPERTIES	40,500	22.70	919,350.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	78,000	2.97	231,660.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	32,000	23.45	750,400.00	
SHUI ON LAND LTD	95,500	2.08	198,640.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	79,000	4.96	391,840.00	
SOHO CHINA LTD	65,000	3.86	250,900.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	63,000	30.95	1,949,850.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	166,000	1.58	262,280.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	40,000	5.08	203,200.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	48,000	8.12	389,760.00	
KINGSOFT CORP LTD	20,000	24.00	480,000.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	152,200	397.40	60,484,280.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	23,000	22.00	506,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	19,500	115.80	2,258,100.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	16,000	11.32	181,120.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	35,000	5.42	189,700.00	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	17,000	30.00	510,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	26,000	9.70	252,200.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	8,800	24.30	213,840.00	
LENOVO GROUP LTD	182,000	4.21	766,220.00	
MEITU INC	30,000	6.75	202,500.00	
SUNNY OPTICAL TECH	18,700	145.90	2,728,330.00	
ZTE CORP-H	21,600	11.86	256,176.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	60,000	4.91	294,600.00	
CHINA MOBILE LTD	165,200	68.70	11,349,240.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	387,000	3.50	1,354,500.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	165,882	9.79	1,623,984.78	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	14,500	40.60	588,700.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	152,000	4.42	671,840.00	
CGN POWER CO LTD-H	261,000	2.07	540,270.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	46,000	32.60	1,499,600.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	79,000	6.74	532,460.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	105,000	1.94	203,700.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	22,000	32.05	705,100.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	51,000	14.24	726,240.00	

	DATANG INTL POWER GEN CO-H	80,000	2.43	194,400.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20,000	81.00	1,620,000.00	
	GUANGDONG INVEST	76,000	12.62	959,120.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	44,000	3.20	140,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	106,000	5.34	566,040.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	118,000	2.87	338,660.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	26,000	7.45	193,700.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	344,000	0.76	261,440.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	4.07	976,800.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	75,000	11.30	847,500.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	70,000	2.58	180,600.00	
香港ドル小計		23,929,571		269,120,477.94 (3,762,304,281)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	83,000	3.14	260,620.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	6,300	24.28	152,964.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	62,800	8.40	527,520.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	30,500	4.22	128,710.00	
	GAMUDA BHD	54,900	3.26	178,974.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	15,800	9.74	153,892.00	
	IJM CORP BHD	70,000	1.81	126,700.00	
	SIME DARBY BERHAD	58,720	2.42	142,102.40	
	AIRASIA GROUP BHD	47,000	3.10	145,700.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	22,000	8.75	192,500.00	
	MISC BHD	35,000	5.92	207,200.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	24,000	3.33	79,920.00	
	UMW HOLDINGS BHD	11,700	6.30	73,710.00	
	GENTING BHD	59,900	8.54	511,546.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	84,200	4.93	415,106.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	43,000	1.60	68,800.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	3,700	35.12	129,944.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	43,000	1.51	64,930.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3,400	38.60	131,240.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	5,500	9.54	52,470.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	58,175	4.59	267,023.25	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	14,600	23.64	345,144.00	

	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,800	147.10	264,780.00	
	PPB GROUP BERHAD	15,400	19.36	298,144.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	63,220	5.28	333,801.60	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	34,000	5.76	195,840.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	55,000	6.00	330,000.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	17,000	11.56	196,520.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	27,000	4.17	112,590.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	42,600	3.65	155,490.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	123,500	5.81	717,535.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	17,800	18.12	322,536.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,000	18.18	90,900.00	
	MALAYAN BANKING BHD	103,950	9.19	955,300.50	
	PUBLIC BANK BERHAD	79,570	22.92	1,823,744.40	
	RHB BANK BHD	18,259	5.65	103,163.35	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	46,845	1.57	73,546.65	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	58,720	1.16	68,115.20	
	SP SETIA BHD	45,500	2.93	133,315.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	76,900	4.26	327,594.00	
	DIGI.COM BHD	81,000	4.37	353,970.00	
	MAXIS BHD	50,300	5.50	276,650.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	29,000	3.21	93,090.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	17,500	17.36	303,800.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	89,325	13.80	1,232,685.00	
	YTL CORP BHD	107,598	1.14	122,661.72	
	マレーシアリングット小計	2,043,982		13,242,488.07	(362,049,623)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	52,500	19.80	1,039,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	28,000	33.75	945,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	244,800	6.05	1,481,040.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	36,010	129.50	4,663,295.00	
	PTT PCL-NVDR	288,000	48.00	13,824,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	27,800	80.00	2,224,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	39,000	55.50	2,164,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	62,945	81.25	5,114,281.25	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	10,200	404.00	4,120,800.00	

	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	116,900	65.00	7,598,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	195,000	7.60	1,482,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	160,000	9.20	1,472,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	67,800	32.75	2,220,450.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	100,000	13.50	1,350,000.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	12,000	56.50	678,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	30,000	51.50	1,545,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	133,400	77.25	10,305,150.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	79,000	24.60	1,943,400.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	51,000	16.30	831,300.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	110,000	25.00	2,750,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	9,500	176.00	1,672,000.00	
	BANGKOK BANK-FOREIGN REG	6,640	200.00	1,328,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	29,200	201.00	5,869,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,800	193.00	3,821,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	91,125	17.10	1,558,237.50	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,000	128.50	6,425,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	345,000	2.30	793,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	34,500	69.25	2,389,125.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	78,500	11.50	902,750.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	12,000	60.00	720,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	28,700	187.50	5,381,250.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	244,700	5.95	1,455,965.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,000	231.00	693,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	12,800	94.50	1,209,600.00	
タイパーツ小計		2,809,820		101,971,243.75 (339,564,241)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	52,000	55.35	2,878,200.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	102,000	12.00	1,224,000.00	
	DMCI HOLDINGS INC	115,000	10.00	1,150,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	71,500	49.65	3,549,975.00	
	SM INVESTMENTS CORP	6,218	868.00	5,397,224.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	13,500	79.40	1,071,900.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	11,200	267.00	2,990,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	23,000	115.00	2,645,000.00	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	23,907	88.00	2,103,816.00	
	BDO UNIBANK INC	55,334	125.50	6,944,417.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	23,562	73.20	1,724,738.40	
	SECURITY BANK CORP	6,500	198.00	1,287,000.00	
	AYALA CORPORATION	6,342	886.50	5,622,183.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	2,200	902.00	1,984,400.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	374,000	4.59	1,716,660.00	
	AYALA LAND INC	206,060	37.55	7,737,553.00	
	MEGAWORLD CORP	303,000	4.45	1,348,350.00	
	ROBINSONS LAND CO	56,000	18.62	1,042,720.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	266,210	33.25	8,851,482.50	
	GLOBE TELECOM INC	830	1,540.00	1,278,200.00	
	PLDT INC	2,360	1,133.00	2,673,880.00	
	ABOITIZ POWER CORP	38,500	35.70	1,374,450.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,300	334.80	1,774,440.00	
	フィリピンペソ小計	1,764,523		68,370,988.90 (140,844,237)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	348,000	1,930.00	671,640,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	43,500	32,975.00	1,434,412,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	67,300	19,250.00	1,295,525,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	47,600	14,150.00	673,540,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	76,000	7,625.00	579,500,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	45,000	4,110.00	184,950,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	140,000	2,100.00	294,000,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	49,000	4,250.00	208,250,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	554,000	6,600.00	3,656,400,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	147,000	2,100.00	308,700,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	64,000	8,450.00	540,800,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	200,000	3,620.00	724,000,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	12,800	66,525.00	851,520,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	267,400	3,400.00	909,160,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	56,000	8,400.00	470,400,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	112,000	6,550.00	733,600,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	43,100	44,200.00	1,905,020,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	550,000	1,310.00	720,500,000.00	



	BANK DANAMON INDONESIA TBK	78,000	6,400.00	499,200,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	517,000	6,700.00	3,463,900,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,472,100	2,980.00	4,386,858,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	96,500	2,690.00	259,585,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA	262,500	21,925.00	5,755,312,500.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	214,000	7,400.00	1,583,600,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	220,000	1,645.00	361,900,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	520,000	530.00	275,600,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,369,000	3,580.00	4,901,020,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	54,000	4,880.00	263,520,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	274,500	2,030.00	557,235,000.00	
	インドネシアルピア小計	7,900,300		38,469,648,000.00	(300,063,254)
韓国ウォン	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	929	55,500.00	51,559,500.00	
	GS HOLDINGS	1,270	54,700.00	69,469,000.00	
	S-OIL CORPORATION	1,145	110,000.00	125,950,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,702	202,000.00	343,804,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	2,650	22,200.00	58,830,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,030	55,100.00	111,853,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	255	378,000.00	96,390,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	460	112,000.00	51,520,000.00	
	LG CHEM LTD	1,247	343,000.00	427,721,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	230	204,000.00	46,920,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	400	348,000.00	139,200,000.00	
	OCI CO LTD	420	110,500.00	46,410,000.00	
	POSCO	2,090	343,500.00	717,915,000.00	
	CJ CORP	370	140,500.00	51,985,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	750	80,000.00	60,000,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	3,686	5,850.00	21,563,100.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	850	30,950.00	26,307,500.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,400	15,650.00	21,910,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,203	46,600.00	56,059,800.00	
	HANWHA CORPORATION	1,160	32,100.00	37,236,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	2,110	61,300.00	129,343,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	972	110,500.00	107,406,000.00	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	246	367,500.00	90,405,000.00	
KCC CORP	150	329,500.00	49,425,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,730	40,300.00	69,719,000.00	
LG CORP	2,620	71,900.00	188,378,000.00	
LOTTE CORP	734	56,000.00	41,104,000.00	
POSCO DAEWOO CORP	1,431	20,550.00	29,407,050.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,052	118,000.00	242,136,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3,850	15,400.00	59,290,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	11,184	7,240.00	80,972,160.00	
SK HOLDINGS CO LTD	861	257,000.00	221,277,000.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	710	35,500.00	25,205,000.00	
S1 CORPORATION	420	95,800.00	40,236,000.00	
CJ LOGISTICS	205	164,000.00	33,620,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	500	120,500.00	60,250,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,214	28,150.00	34,174,100.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,000	4,780.00	23,900,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	2,112	43,850.00	92,611,200.00	
HANON SYSTEMS	5,400	10,850.00	58,590,000.00	
HYUNDAI MOBIS	1,805	217,000.00	391,685,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	4,220	130,000.00	548,600,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	970	92,000.00	89,240,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	620	83,300.00	51,646,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	7,320	31,300.00	229,116,000.00	
COWAY CO LTD	1,480	87,400.00	129,352,000.00	
HANSSEM CO LTD	270	107,500.00	29,025,000.00	
HLB INC	760	98,000.00	74,480,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,835	82,300.00	233,320,500.00	
KANGWON LAND INC	3,040	27,650.00	84,056,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	2,350	19,900.00	46,765,000.00	
CJ E&M CORP	470	97,600.00	45,872,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	830	125,000.00	103,750,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	380	111,000.00	42,180,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	272	203,000.00	55,216,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	222	391,500.00	86,913,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	212	195,500.00	41,446,000.00	

DONGSUH COMPANIES INC	850	26,150.00	22,227,500.00	
E-MART CO LTD	537	239,000.00	128,343,000.00	
GS RETAIL CO LTD	600	42,250.00	25,350,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	224	350,500.00	78,512,000.00	
KT&G CORP	3,075	104,000.00	319,800,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	526	154,000.00	81,004,000.00	
OTTOGI CORPORATION	30	860,000.00	25,800,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	880	311,500.00	274,120,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	220	148,000.00	32,560,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	750	121,000.00	90,750,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	255	1,480,000.00	377,400,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PRF	55	761,000.00	41,855,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	901	111,400.00	100,371,400.00	
CELLTRION INC	2,168	295,500.00	640,644,000.00	
CELLTRION PHARM INC	370	89,100.00	32,967,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	157	423,000.00	66,411,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	277	64,700.00	17,921,900.00	
MEDY-TOX INC	110	745,800.00	82,038,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	455	437,500.00	199,062,500.00	
SILLAJEN INC	1,440	72,000.00	103,680,000.00	
VIROMED CO LTD	330	232,000.00	76,560,000.00	
YUHAN CORPORATION	264	219,000.00	57,816,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	6,484	9,330.00	60,495,720.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	4,186	10,200.00	42,697,200.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,838	43,250.00	338,993,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,440	15,700.00	101,108,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	10,645	52,900.00	563,120,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,700	43,800.00	512,460,000.00	
WOORI BANK	12,261	16,350.00	200,467,350.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,165	83,600.00	97,394,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	9,858	8,560.00	84,384,480.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	3,771	14,950.00	56,376,450.00	
SAMSUNG CARD CO	690	37,750.00	26,047,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,757	34,650.00	60,880,050.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	1,300	60,600.00	78,780,000.00	

	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	7,000	5,530.00	38,710,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1,550	36,400.00	56,420,000.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	770	42,800.00	32,956,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	840	265,000.00	222,600,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,910	100,500.00	191,955,000.00	
	KAKAO CORP	1,285	114,000.00	146,490,000.00	
	NAVER CORP	743	723,000.00	537,189,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	470	372,500.00	175,075,000.00	
	NETMARBLE CORP	665	155,500.00	103,407,500.00	
	PEARL ABYSS CORP	135	227,600.00	30,726,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	950	201,000.00	190,950,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	6,560	19,000.00	124,640,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	360	139,000.00	50,040,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,460	151,000.00	220,460,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	128,650	47,250.00	6,078,712,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	23,500	37,450.00	880,075,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,488	227,000.00	337,776,000.00	
	KT CORP	1,027	27,700.00	28,447,900.00	
	SK TELECOM	565	242,000.00	136,730,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	6,850	34,900.00	239,065,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	828	61,700.00	51,087,600.00	
	SK HYNIX INC	15,690	89,500.00	1,404,255,000.00	
	韓国ウォン小計	391,669		22,898,879,460.00 (2,250,959,850)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	34,080	120.00	4,089,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,978	33.70	1,953,858.60	
	CHINA STEEL CORP	330,181	23.70	7,825,289.70	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	94,047	117.50	11,050,522.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	111,424	109.50	12,200,928.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	129,145	84.60	10,925,667.00	
	TAIWAN CEMENT	103,170	44.60	4,601,382.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	415.00	1,245,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	83,957	28.85	2,422,159.45	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	5,789	340.00	1,968,260.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	46,000	23.10	1,062,600.00	

CHINA AIRLINES LTD	67,000	9.85	659,950.00
EVA AIRWAYS CORP	44,482	15.00	667,230.00
EVERGREEN MARINE CORP LTD	50,365	14.10	710,146.50
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	45,000	23.50	1,057,500.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	50,947	45.10	2,297,709.70
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	5,254	345.50	1,815,257.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,921	135.50	1,208,795.50
FORMOSA TAFFETA CO.	18,000	33.70	606,600.00
GIANT MANUFACTURING	8,000	126.50	1,012,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	4,000	265.00	1,060,000.00
POU CHEN	58,145	35.35	2,055,425.75
RUENTEX INDUSTRIES LTD	19,000	63.00	1,197,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	277.00	1,939,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	15,448	331.00	5,113,288.00
STANDARD FOODS CORP	21,320	62.20	1,326,104.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	126,703	76.70	9,718,120.10
TAIMED BIOLOGICS INC	5,000	308.00	1,540,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	117,540	17.70	2,080,458.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	350,715	11.05	3,875,400.75
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	461,746	21.85	10,089,150.10
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	242,992	20.90	5,078,532.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	242,984	20.65	5,017,619.60
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	187,166	17.55	3,284,763.30
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	292,356	26.60	7,776,669.60
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	267,133	11.10	2,965,176.30
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	243,706	14.40	3,509,366.40
TAIWAN BUSINESS BANK	94,788	9.47	897,642.36
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	225,159	17.75	3,996,572.25
CHAILEASE HOLDING CO LTD	33,329	105.00	3,499,545.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	179,743	53.70	9,652,199.10
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	264,257	14.00	3,699,598.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	214,538	56.00	12,014,128.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	60,357	31.80	1,919,352.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	220,337	11.85	2,610,993.45
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	21,950	45.70	1,003,115.00

RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	26,023	35.70	929,021.10
ACER INC	77,812	25.75	2,003,659.00
ADVANTECH CO LTD	9,216	202.00	1,861,632.00
ASUSTEK COMPUTER INC	18,797	274.50	5,159,776.50
AU OPTRONICS CORP	246,994	12.95	3,198,572.30
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	17,405	334.00	5,813,270.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	13,260	69.60	922,896.00
COMPAL ELECTRONICS	123,955	19.25	2,386,133.75
DELTA ELECTRONICS INC	53,541	110.50	5,916,280.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	23,787	73.30	1,743,587.10
GENERAL INTERFACE SOLUTION	4,000	194.00	776,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	438,765	82.30	36,110,359.50
HTC CORP	17,011	56.70	964,523.70
INNOLUX CORP	230,282	11.20	2,579,158.40
INVENTEC CORP	62,162	24.80	1,541,617.60
LARGAN PRECISION CO LTD	2,636	4,370.00	11,519,320.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	53,787	37.95	2,041,216.65
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	17,000	100.00	1,700,000.00
PEGATRON CORP	50,854	65.00	3,305,510.00
QUANTA COMPUTER INC	76,416	54.50	4,164,672.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	37,120	46.50	1,726,080.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	7,000	320.50	2,243,500.00
WISTRON CORP	78,311	22.75	1,781,575.25
WPG HOLDINGS LTD	56,000	43.85	2,455,600.00
YAGEO CORPORATION	5,700	942.00	5,369,400.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	67.90	746,900.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	101,371	110.00	11,150,810.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	77.70	3,263,400.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	44,188	111.00	4,904,868.00
ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	93,387	72.30	6,751,880.10
GLOBALWAFERS CO LTD	5,700	492.00	2,804,400.00
MACRONIX INTERNATIONAL	47,000	43.40	2,039,800.00
MEDIATEK INC	40,432	310.50	12,554,136.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	29,000	92.50	2,682,500.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	14,522	136.50	1,982,253.00

	PHISON ELECTRONICS CORP	4,000	262.50	1,050,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	20,635	87.70	1,809,689.50	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,815	114.50	1,352,817.50	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	661,355	227.50	150,458,262.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	330,592	17.80	5,884,537.60	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	22,000	68.50	1,507,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	233.00	2,097,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	69,000	19.30	1,331,700.00	
台湾ドル小計		8,578,983		498,884,991.96 (1,805,963,670)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,350	426.35	8,249,872.50	
	COAL INDIA LTD	17,100	264.85	4,528,935.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,850	311.15	4,931,727.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	30,400	170.00	5,168,000.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	33,490	159.55	5,343,329.50	
	PETRONET LNG LTD	17,200	209.90	3,610,280.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	75,772	1,012.50	76,719,150.00	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	18,310	204.95	3,752,634.50	
	ASIAN PAINTS LTD	7,680	1,267.70	9,735,936.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	9,320	1,010.40	9,416,928.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	29,280	222.00	6,500,160.00	
	JSW STEEL LTD	22,000	336.95	7,412,900.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,960	1,050.70	3,110,072.00	
	SHREE CEMENT LTD	225	15,577.80	3,505,005.00	
	TATA STEEL LIMITED	10,712	561.85	6,018,537.20	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,470	3,641.05	8,993,393.50	
	UPL LTD	10,250	640.20	6,562,050.00	
	VEDANTA LTD	37,660	228.55	8,607,193.00	
	ASHOK LEYLAND LTD	31,000	136.40	4,228,400.00	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	19,725	75.00	1,479,375.00	
	EICHER MOTORS LTD	345	29,140.65	10,053,524.25	
	HAVELLS INDIA LTD	6,100	542.65	3,310,165.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	12,880	1,299.85	16,742,068.00	
	SIEMENS INDIA LIMITED	1,890	993.75	1,878,187.50	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	18,900	365.80	6,913,620.00	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,150	1,247.00	1,434,050.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,250	1,187.25	2,671,312.50	
BAJAJ AUTO LTD	2,220	2,832.20	6,287,484.00	
BHARAT FORGE LTD	5,200	613.10	3,188,120.00	
BOSCH LTD	190	17,959.25	3,412,257.50	
HERO MOTOCORP LTD	1,400	3,637.65	5,092,710.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	19,600	908.20	17,800,720.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,810	8,874.90	24,938,469.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	16,000	303.75	4,860,000.00	
TATA MOTORS LTD	43,698	308.00	13,458,984.00	
TITAN CO LTD	8,540	877.55	7,494,277.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	13,630	565.75	7,711,172.50	
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,070	1,494.25	4,587,347.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	860	5,959.45	5,125,127.00	
ITC LTD	93,225	265.15	24,718,608.75	
NESTLE INDIA LIMITED	680	9,871.05	6,712,314.00	
UNITED SPIRITS LTD	7,450	681.30	5,075,685.00	
DABUR INDIA LTD	13,900	385.15	5,353,585.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,400	1,165.95	7,462,080.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	17,560	1,608.10	28,238,236.00	
MARICO LTD	11,400	333.55	3,802,470.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	7,500	611.10	4,583,250.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	5,300	409.20	2,168,760.00	
CIPLA LTD	8,850	615.75	5,449,387.50	
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,240	2,336.25	7,569,450.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	4,100	599.85	2,459,385.00	
LUPIN LTD	5,530	902.90	4,993,037.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,086	2,599.00	5,421,514.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	26,384	577.25	15,230,164.00	
AXIS BANK LTD	48,050	525.65	25,257,482.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	40,915	1,906.75	78,014,676.25	
ICICI BANK LTD	62,487	300.65	18,786,716.55	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	8,820	1,199.65	10,580,913.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	7,800	497.40	3,879,720.00	
STATE BANK OF INDIA	44,100	273.05	12,041,505.00	



	YES BANK LTD	46,770	335.10	15,672,627.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	4,720	2,336.05	11,026,156.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	7,400	497.35	3,680,390.00	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	17,600	110.85	1,950,960.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,000	1,494.00	5,976,000.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	920	6,176.50	5,682,380.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	15,200	904.80	13,752,960.00	
	INFOSYS LTD	46,684	1,247.85	58,254,629.40	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	24,920	1,809.80	45,100,216.00	
	TECH MAHINDRA LTD	13,260	691.15	9,164,649.00	
	WIPRO LTD	28,739	258.25	7,421,846.75	
	BHARTI AIRTEL LTD	38,300	374.55	14,345,265.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	9,890	286.00	2,828,540.00	
	IDEA CELLULAR LTD	53,000	60.55	3,209,150.00	
	GAIL INDIA LTD	19,333	340.00	6,573,220.00	
	NTPC LIMITED	44,360	157.30	6,977,828.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	41,800	197.70	8,263,860.00	
	TATA POWER CO LTD	29,640	76.15	2,257,086.00	
	インドルピー小計	1,443,800		834,770,177.15 (1,360,675,388)	
パキスタンル ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	17,000	156.54	2,661,180.00	
	LUCKY CEMENT	2,800	500.29	1,400,812.00	
	HABIB BANK LTD	15,300	163.86	2,507,058.00	
	MCB BANK LTD	11,500	197.78	2,274,470.00	
	UNITED BANK LTD	10,500	169.13	1,775,865.00	
	パキスタンルピー小計	57,100		10,619,385.00 (9,663,640)	
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	4,280	107.00	457,960.00	
	COMMERCIAL BANK QSC	4,917	37.40	183,895.80	
	DOHA BANK QSC	3,810	27.20	103,632.00	
	MASRAF AL RAYAN	10,840	34.70	376,148.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	2,930	119.00	348,670.00	
	QATAR NATIONAL BANK	12,047	154.00	1,855,238.00	
	QATAR INSURANCE CO	3,823	36.44	139,310.12	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,000	33.69	101,070.00	

	EZDAN HOLDING GROUP	18,900	8.30	156,870.00	
	OOREDOO QSC	2,160	70.10	151,416.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,240	183.88	228,011.20	
カタールリアル小計		67,947		4,102,221.12	(123,764,011)
エジプトポンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	2,000	196.19	392,380.00	
	EASTERN TOBACCO	3,550	163.06	578,863.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	25,687	85.99	2,208,825.13	
エジプトポンド小計		31,237		3,180,068.13	(19,525,618)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	6,810	124.16	845,529.60	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,660	330.34	548,364.40	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	12,292	110.92	1,363,428.64	
	GOLD FIELDS LTD	25,030	47.62	1,191,928.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,500	302.09	453,135.00	
	MONDI LTD	3,100	358.40	1,111,040.00	
	SAPPI LIMITED	14,415	89.45	1,289,421.75	
	SASOL LTD	14,875	467.88	6,959,715.00	
	BIDVEST GROUP LTD	9,342	203.36	1,899,789.12	
	NASPERS LTD-N SHS	11,785	3,307.43	38,978,062.55	
	FOSCHINI GROUP LTD/THE	5,925	189.96	1,125,513.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	4,055	206.14	835,897.70	
	MR PRICE GROUP LTD	6,350	232.73	1,477,835.50	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	11,620	81.03	941,568.60	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	25,805	54.15	1,397,340.75	
	BID CORP LTD	8,879	273.08	2,424,677.32	
	CLICKS GROUP LTD	6,750	204.02	1,377,135.00	
	PICK'N PAY STORES LTD	9,400	78.94	742,036.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,200	228.60	2,788,920.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	5,110	186.58	953,423.80	
	PIONEER FOODS LTD	3,400	113.07	384,438.00	
	TIGER BRANDS LTD	4,590	332.59	1,526,588.10	
LIFE HEALTHCARE GROUP	34,543	24.78	855,975.54		
NETCARE LTD	26,950	27.80	749,210.00		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	10,741	259.60	2,788,363.60		

	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	19,160	161.95	3,102,962.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,000	881.05	881,050.00	
	NEDBANK GROUP LTD	5,750	256.44	1,474,530.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	34,583	190.24	6,579,069.92	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	5,500	60.80	334,400.00	
	FIRSTRAND LTD	89,060	61.40	5,468,284.00	
	INVESTEC LTD	8,970	96.39	864,618.30	
	PSG GROUP LTD	3,900	217.67	848,913.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	3,600	238.42	858,312.00	
	REMGRO LTD	14,470	204.50	2,959,115.00	
	RMB HOLDINGS LTD	20,260	74.16	1,502,481.60	
	DISCOVERY LTD	9,127	150.50	1,373,613.50	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	4,000	120.29	481,160.00	
	MMI HOLDINGS LTD	24,429	17.85	436,057.65	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	19,830	37.43	742,236.90	
	SANLAM LTD	46,151	73.07	3,372,253.57	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	9,670	120.12	1,161,560.40	
	MTN GROUP LTD	45,452	107.11	4,868,363.72	
	TELKOM SA SOC LTD	6,700	48.50	324,950.00	
	VODACOM GROUP LTD	15,935	126.82	2,020,876.70	
南アフリカランド小計		664,674		114,664,145.83	(935,659,429)
アラブディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	58,900	2.01	118,389.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	58,950	7.19	423,850.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	39,733	5.02	199,459.66	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,955	12.05	457,357.75	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	84,600	2.02	170,892.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	44,000	2.33	102,520.00	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	19,000	5.20	98,800.00	
	EMAAR MALLS PJSC	48,000	2.14	102,720.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	97,850	5.20	508,820.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	47,600	16.10	766,360.00	
アラブディルハム小計		536,588		2,949,168.91	(88,209,642)
香港・オフショア 人民元	DAQIN RAILWAY CO LTD-A	3,000	9.22	27,660.00	

香港・オフショア人民元小計	3,000		27,660.00 (464,411)
合 計	60,994,010		15,433,040,969 (15,433,040,969)

(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
メキシコ ペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	88,300	2,369,972.00	
メキシコペソ小計			88,300	2,369,972.00 (12,963,746)	
トルコリ ラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMEN	58,000	116,580.00	
トルコリラ小計			58,000	116,580.00 (2,768,775)	
香港ドル	投資信託受益証 券	ISHARES FTSE A50 CHINA INDEX-ETF	300,000	4,182,000.00	
香港ドル小計			300,000	4,182,000.00 (58,464,360)	
南アフリ カランド	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	24,000	373,200.00	
		FORTRESS REIT LTD-B	21,500	318,415.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	80,500	2,105,075.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	6,700	686,884.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	146,650	1,541,291.50	
		RESILIENT REIT LTD	7,700	426,965.00	
南アフリカランド小計			287,050	5,451,830.50 (44,486,936)	
合 計				118,683,817 (118,683,817)	

(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	組入投資信託 受益証券時価比率	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 82銘柄	100.0%			14.0%
メキシコペソ	株式 24銘柄	96.8%			2.6%
	投資証券 1銘柄			3.2%	0.1%
ブラジルリアル	株式 54銘柄	100.0%			4.9%
チリペソ	株式 16銘柄	100.0%			1.0%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 23銘柄	97.6%			0.7%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	100.0%			1.1%
香港ドル	株式 199銘柄	98.5%			24.1%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.5%		0.4%
マレーシアリングギット	株式 46銘柄	100.0%			2.3%
タイバーツ	株式 34銘柄	100.0%			2.2%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.0%			0.9%
インドネシアルピア	株式 29銘柄	100.0%			1.9%
韓国ウォン	株式 114銘柄	100.0%			14.5%
台湾ドル	株式 89銘柄	100.0%			11.6%
インドルピー	株式 78銘柄	100.0%			8.7%
パキスタンルピー	株式 5銘柄	100.0%			0.1%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.0%			0.8%
エジプトポンド	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
南アフリカランド	株式 45銘柄	95.5%			6.0%
	投資証券 6銘柄			4.5%	0.3%
アラブディルハム	株式 10銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人民元	株式 1銘柄	100.0%			0.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

#### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	137,498,069
コール・ローン	10,660,092	59,680,148
国債証券	29,115,682,772	29,536,452,095
地方債証券	2,911,586,340	2,597,121,000
特殊債券	3,316,386,504	3,319,885,000
社債券	1,747,440,000	2,157,458,580
未収利息	68,037,563	68,273,044
前払費用	1,352,956	774,767
流動資産合計	37,171,146,227	37,877,142,703
資産合計	37,171,146,227	37,877,142,703
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,533,849	19,968,693
未払利息	15	65
流動負債合計	5,533,864	19,968,758
負債合計	5,533,864	19,968,758
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,749,059,072	27,102,404,194
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,416,553,291	10,754,769,751
元本等合計	37,165,612,363	37,857,173,945
純資産合計	37,165,612,363	37,857,173,945
負債純資産合計	37,171,146,227	37,877,142,703

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券</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）

		平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
1.	期首	平成29年 6月27日	平成29年12月26日
	期首元本額	26,195,380,333円	26,749,059,072円
	期首からの追加設定元本額	1,418,134,121円	1,835,301,113円
	期首からの一部解約元本額	864,455,382円	1,481,955,991円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	1,357,362,982円	1,587,156,685円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,436,413,016円	1,626,660,257円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,073,817,116円	1,189,375,177円
	DCインデックスバランス（株式80）	176,521,828円	194,125,073円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,732,190,101円	1,759,589,274円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,071,887,608円	3,832,032,845円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	4,994,522円	4,792,931円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,094,893,656円	1,514,625,168円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,993,954円	4,785,133円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	25,086,790円	25,441,648円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	104,165,549円	107,849,280円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	318,328,046円	314,785,064円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	5,481,306,102円	5,123,225,756円
	世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け）	27,666,287円	17,226,651円
	世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け）	116,047,635円	38,947,554円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,221,979,198円	1,226,476,025円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,222,765,226円	1,233,094,052円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	675,382,466円	678,044,524円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	103,126,597円	101,096,328円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,250,900,728円	6,274,393,549円

	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	249,229,665円	248,681,220円
	計	26,749,059,072円	27,102,404,194円
2.	受益権の総数	26,749,059,072口	27,102,404,194口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券  同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品  同左



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

（有価証券に関する注記）

（平成29年12月25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	89,233,595
地方債証券	2,337,660
特殊債券	558,496
社債券	1,436,000
合計	84,901,439

（平成30年 6月25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	127,171,765
地方債証券	13,581,000
特殊債券	10,139,000
社債券	9,496,420
合計	93,955,345

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成29年12月25日現在		平成30年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3894円	1口当たり純資産額	1.3968円
(1万口当たり純資産額)	(13,894円)	(1万口当たり純資産額)	(13,968円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第120回利付国債(5年)	330,000,000	331,386,000	
	第121回利付国債(5年)	100,000,000	100,297,000	
	第122回利付国債(5年)	300,000,000	301,047,000	
	第123回利付国債(5年)	505,000,000	507,014,950	
	第124回利付国債(5年)	560,000,000	562,559,200	
	第125回利付国債(5年)	325,000,000	326,673,750	
	第126回利付国債(5年)	220,000,000	221,260,600	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	101,661,700	
	第2回利付国債(40年)	165,000,000	231,994,950	
	第3回利付国債(40年)	50,000,000	70,572,500	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	134,559,900	
	第5回利付国債(40年)	35,000,000	47,676,300	
	第6回利付国債(40年)	70,000,000	93,468,200	
	第7回利付国債(40年)	50,000,000	63,835,000	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	112,620,600	
	第9回利付国債(40年)	160,000,000	137,659,200	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	127,377,500	
	第302回利付国債(10年)	94,000,000	95,429,655	
	第303回利付国債(10年)	581,000,000	592,073,860	
	第304回利付国債(10年)	36,000,000	36,641,520	
	第305回利付国債(10年)	473,000,000	483,098,550	
	第306回利付国債(10年)	93,000,000	95,477,520	
	第308回利付国債(10年)	140,000,000	143,995,600	
	第309回利付国債(10年)	134,000,000	137,291,040	
	第310回利付国債(10年)	78,000,000	79,975,740	
	第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,482,080	
	第312回利付国債(10年)	205,000,000	211,822,400	
	第313回利付国債(10年)	370,000,000	384,500,300	

第315回利付国債(10年)	65,000,000	67,579,200	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,283,800	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	109,177,950	
第318回利付国債(10年)	185,000,000	191,759,900	
第319回利付国債(10年)	5,000,000	5,214,350	
第320回利付国債(10年)	190,000,000	197,480,300	
第321回利付国債(10年)	175,000,000	182,346,500	
第322回利付国債(10年)	75,000,000	77,867,250	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,836,900	
第324回利付国債(10年)	25,000,000	25,920,500	
第325回利付国債(10年)	210,000,000	218,223,600	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	31,109,100	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,696,200	
第328回利付国債(10年)	115,000,000	118,911,150	
第329回利付国債(10年)	230,000,000	240,488,000	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	220,004,400	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	82,968,800	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	218,347,500	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	124,942,800	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	507,806,600	
第336回利付国債(10年)	80,000,000	82,997,600	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,732,900	
第338回利付国債(10年)	310,000,000	319,851,800	
第339回利付国債(10年)	370,000,000	382,069,400	
第340回利付国債(10年)	420,000,000	434,036,400	
第341回利付国債(10年)	910,000,000	934,278,800	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,513,200	
第343回利付国債(10年)	245,000,000	247,746,450	
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,536,500	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	616,215,900	
第346回利付国債(10年)	490,000,000	494,708,900	
第347回利付国債(10年)	160,000,000	161,436,800	
第348回利付国債(10年)	90,000,000	90,788,400	
第349回利付国債(10年)	490,000,000	493,944,500	
第350回利付国債(10年)	340,000,000	342,475,200	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	274,855,360	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	196,925,610	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	46,993,450	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	144,818,300	
第21回利付国債(30年)	20,000,000	26,447,600	
第22回利付国債(30年)	40,000,000	54,358,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	74,815,950	

第24回利付国債(30年)	68,000,000	92,663,600	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,586,400	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	229,246,700	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,735,510	
第28回利付国債(30年)	94,000,000	129,272,560	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	375,818,160	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	198,004,590	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	159,775,200	
第32回利付国債(30年)	50,000,000	67,840,500	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	175,346,100	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	268,850,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	219,090,480	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	176,461,200	
第37回利付国債(30年)	61,000,000	78,610,090	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	120,589,200	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	97,026,750	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	114,422,400	
第41回利付国債(30年)	40,000,000	49,946,800	
第42回利付国債(30年)	105,000,000	131,182,800	
第43回利付国債(30年)	195,000,000	243,763,650	
第44回利付国債(30年)	70,000,000	87,652,600	
第45回利付国債(30年)	60,000,000	72,258,000	
第46回利付国債(30年)	100,000,000	120,455,000	
第47回利付国債(30年)	115,000,000	141,542,000	
第48回利付国債(30年)	105,000,000	124,082,700	
第49回利付国債(30年)	90,000,000	106,360,200	
第50回利付国債(30年)	25,000,000	25,760,000	
第51回利付国債(30年)	70,000,000	63,151,900	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	85,654,800	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	102,506,250	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	113,036,000	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	112,921,600	
第56回利付国債(30年)	50,000,000	51,275,500	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	102,444,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	102,335,000	
第43回利付国債(20年)	47,000,000	48,768,140	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	53,332,230	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	22,098,300	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	105,497,370	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	60,499,230	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	250,248,300	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	41,490,150	

第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,217,700	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	71,248,320	
第57回利付国債(20年)	52,000,000	56,192,760	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	146,577,600	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,700,060	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	315,145,550	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,432,080	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,967,010	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	59,684,040	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	110,999,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,552,320	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	37,886,880	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	88,264,800	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	119,542,800	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	127,300,320	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	128,278,730	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	134,724,140	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	11,467,600	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	23,797,830	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,600,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	183,113,600	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	69,393,000	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	152,701,900	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	356,223,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	18,945,600	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	298,090,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	70,810,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	70,539,000	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	59,219,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	98,942,840	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	116,487,700	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	54,117,900	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	112,178,660	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	140,103,990	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,334,200	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	81,216,960	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	100,057,680	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,478,740	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	39,779,520	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	93,121,490	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,439,120	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	157,713,400	

第108回利付国債(20年)	134,000,000	159,772,220	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	32,279,850	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	119,253,260	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	30,770,500	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	97,594,400	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	354,835,300	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	63,844,560	
第115回利付国債(20年)	55,000,000	68,152,700	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	68,352,900	
第117回利付国債(20年)	93,000,000	114,500,670	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,228,100	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	35,953,800	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	82,238,800	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	26,706,020	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	20,431,450	
第123回利付国債(20年)	65,000,000	80,681,900	
第124回利付国債(20年)	80,000,000	98,318,400	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	62,844,500	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	30,777,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	79,385,150	
第129回利付国債(20年)	50,000,000	60,429,500	
第130回利付国債(20年)	60,000,000	72,659,400	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,376,480	
第132回利付国債(20年)	35,000,000	42,003,850	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	36,398,100	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,772,500	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	36,062,100	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	213,964,200	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	240,644,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	141,124,800	
第139回利付国債(20年)	150,000,000	178,444,500	
第140回利付国債(20年)	340,000,000	409,740,800	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	235,345,500	
第142回利付国債(20年)	85,000,000	103,852,150	
第143回利付国債(20年)	54,000,000	64,494,900	
第144回利付国債(20年)	130,000,000	153,305,100	
第145回利付国債(20年)	205,000,000	248,109,450	
第146回利付国債(20年)	75,000,000	90,894,000	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,860,800	
第148回利付国債(20年)	120,000,000	142,058,400	
第149回利付国債(20年)	215,000,000	254,738,450	
第150回利付国債(20年)	90,000,000	105,245,100	

	第151回利付国債(20年)	150,000,000	170,668,500	
	第152回利付国債(20年)	90,000,000	102,414,600	
	第153回利付国債(20年)	120,000,000	138,496,800	
	第154回利付国債(20年)	120,000,000	136,468,800	
	第155回利付国債(20年)	140,000,000	154,357,000	
	第156回利付国債(20年)	110,000,000	109,908,700	
	第157回利付国債(20年)	50,000,000	48,120,000	
	第158回利付国債(20年)	170,000,000	172,157,300	
	第159回利付国債(20年)	150,000,000	154,234,500	
	第160回利付国債(20年)	140,000,000	146,172,600	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	122,932,800	
	第162回利付国債(20年)	70,000,000	71,542,100	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	168,377,550	
	第164回利付国債(20年)	125,000,000	125,000,000	
国債証券 合計		26,584,000,000	29,536,452,095	
地方債証券	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,605,000	
	第690回東京都公募公債	100,000,000	103,125,000	
	第694回東京都公募公債	200,000,000	207,204,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	103,424,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	102,986,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	206,264,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	103,568,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	103,402,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	207,006,000	
	平成22年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,336,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,907,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,712,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	103,058,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,377,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,355,000	
	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,049,000	
	第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,418,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,361,000	
	第3回川崎市公募公債(15年)	100,000,000	104,454,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	99,957,000	
平成22年度第2回福井県公募公債	100,000,000	103,871,000		
平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,682,000		
地方債証券 合計		2,500,000,000	2,597,121,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,476,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,545,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,076,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,824,000	

第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,480,000	
第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,602,000	
第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,855,000	
第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,091,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,161,000	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,603,000	
第17回道路債券	100,000,000	106,671,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,089,000	
第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,328,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,140,000	
第135回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,138,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,556,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	118,660,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,918,000	
F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,906,000	
F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,456,000	
第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,643,000	
第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,446,000	
第17回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,478,000	
第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,068,000	
第298回信金中金債(5年)	200,000,000	200,388,000	
第316回信金中金債(5年)	100,000,000	100,000,000	
第318回信金中金債(5年)	100,000,000	99,928,000	
第320回信金中金債(5年)	100,000,000	99,753,000	
第322回信金中金債(5年)	200,000,000	199,606,000	
特殊債券 合計	3,200,000,000	3,319,885,000	
社債券			
第8回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,471,000	
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	100,353,000	
第14回森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,362,000	
第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,706,000	
第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,163,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,899,000	
第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,448,000	
第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,247,580	
第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,196,000	



第9回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	201,346,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	106,930,000	
第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	110,010,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,513,000	
第87回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	206,738,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	204,932,000	
第563回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,251,000	
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,320,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,573,000	
社債券 合計	2,100,000,000	2,157,458,580	
合計	34,384,000,000	37,610,916,675	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	280,328,786	79,253,155
金銭信託	-	66,487,282
コール・ローン	51,079,470	28,858,375
国債証券	156,333,134,880	147,175,709,364
派生商品評価勘定	63,400	124,890
未収入金	-	106,930,449
未収利息	1,358,318,767	1,227,552,599
前払費用	26,071,325	32,507,355
流動資産合計	158,048,996,628	148,717,423,469
資産合計	158,048,996,628	148,717,423,469
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,500	256,201
未払解約金	116,575,995	112,389,065
未払利息	72	31
流動負債合計	116,580,567	112,645,297
負債合計	116,580,567	112,645,297

平成29年12月25日現在

平成30年 6月25日現在

純資産の部		平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
元本等			
元本		68,229,329,807	67,168,628,623
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		89,703,086,254	81,436,149,549
元本等合計		157,932,416,061	148,604,778,172
純資産合計		157,932,416,061	148,604,778,172
負債純資産合計		158,048,996,628	148,717,423,469

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
1.	期首	平成29年 6月27日	平成29年12月26日
	期首元本額	70,935,063,552円	68,229,329,807円
	期首からの追加設定元本額	1,224,053,253円	1,906,715,129円
	期首からの一部解約元本額	3,929,786,998円	2,967,416,313円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	11,567,602,293円	11,837,865,888円
	DCインデックスバランス(株式20)	125,242,375円	153,562,648円
	DCインデックスバランス(株式40)	191,755,522円	226,810,344円
	DCインデックスバランス(株式60)	257,544,310円	298,367,826円
	DCインデックスバランス(株式80)	211,633,950円	243,997,870円

財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,840,791,172円	23,593,143,511円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,439,136,286円	2,384,654,413円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	21,583,845,086円	20,232,824,810円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	27,002,128円	27,201,486円
日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	936,911,723円	861,958,333円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	309,287,835円	429,052,200円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	112,785,347円	158,821,660円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,002,414円	3,004,405円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,009,910円	3,209,486円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,945,836円	7,518,496円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	14,687,431円	15,232,044円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	672,382,781円	879,853,294円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,115,217,944円	1,071,714,429円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	23,410,884円	15,354,552円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	80,178,974円	28,334,170円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	56,356,099円	59,394,514円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	82,042,952円	86,448,443円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	81,291,454円	85,615,186円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	61,984,897円	63,625,347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	4,183,028,204円	4,155,226,246円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	242,252,000円	245,837,022円
計	68,229,329,807円	67,168,628,623円
2. 受益権の総数	68,229,329,807口	67,168,628,623口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成29年12月25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	217,428,584
合計	217,428,584

（平成30年 6月25日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,182,449,560
合計	2,182,449,560

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（平成29年12月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	107,606,400	-	107,547,500	58,900
	米ドル	107,606,400	-	107,547,500	58,900
	合計	107,606,400	-	107,547,500	58,900

（平成30年 6月25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	57,738,480	-	57,525,919	212,561
	米ドル	57,738,480	-	57,525,919	212,561
	売建	135,149,870	-	135,068,620	81,250
	米ドル	43,856,000	-	43,868,000	12,000

	ユーロ	57,738,480	-	57,770,120	31,640
	英ポンド	33,555,390	-	33,430,500	124,890
	合計	192,888,350	-	192,594,539	131,311

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成29年12月25日現在		平成30年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	2.3147円	1口当たり純資産額	2.2124円
(1万口当たり純資産額)	(23,147円)	(1万口当たり純資産額)	(22,124円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.5%-19/05/31	4,100,000.00	4,068,048.70	
		US TREASURY N/B-0.875%-19/06/15	3,000,000.00	2,957,052.00	

US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	2,510,000.00	2,491,124.80	
US TREASURY N/B-0.75%-19/07/15	2,650,000.00	2,604,711.50	
US TREASURY N/B-1.625%-19/07/31	3,000,000.00	2,974,746.00	
US TREASURY N/B-1.375%-19/07/31	800,000.00	791,062.40	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	4,320,000.00	4,377,879.36	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	4,110,000.00	4,370,890.47	
US TREASURY N/B-0.75%-19/08/15	9,000,000.00	8,832,483.00	
US TREASURY N/B-1.0%-19/08/31	3,300,000.00	3,245,474.10	
US TREASURY N/B-1.625%-19/08/31	3,600,000.00	3,566,390.40	
US TREASURY N/B-1.75%-19/09/30	7,450,000.00	7,385,252.05	
US TREASURY N/B-1.0%-19/10/15	5,100,000.00	5,004,074.10	
US TREASURY N/B-1.5%-19/10/31	4,100,000.00	4,047,228.90	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	10,530,000.00	10,656,486.36	
US TREASURY N/B-1.5%-19/11/30	5,000,000.00	4,930,860.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/12/31	1,900,000.00	1,875,358.90	
US TREASURY N/B-1.25%-20/01/31	4,000,000.00	3,921,484.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/01/31	3,000,000.00	2,976,036.00	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	8,070,000.00	8,211,225.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/02/29	3,000,000.00	2,943,222.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/03/31	1,100,000.00	1,078,064.90	
US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	2,430,000.00	2,379,074.49	
US TREASURY N/B-2.375%-20/04/30	3,000,000.00	2,990,859.00	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	7,830,000.00	7,966,108.89	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	2,440,000.00	2,386,005.24	
US TREASURY N/B-1.5%-20/05/31	5,100,000.00	4,998,897.60	
US TREASURY N/B-1.875%-20/06/30	710,000.00	700,500.91	
US TREASURY N/B-1.625%-20/06/30	4,000,000.00	3,926,640.00	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	5,370,000.00	5,307,595.23	
US TREASURY N/B-1.625%-20/07/31	4,000,000.00	3,922,344.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	5,610,000.00	6,326,043.57	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,180,000.00	5,184,247.60	
US TREASURY N/B-2.125%-20/08/31	1,450,000.00	1,435,782.75	
US TREASURY N/B-1.375%-20/08/31	2,300,000.00	2,241,241.90	
US TREASURY N/B-1.375%-20/09/30	3,700,000.00	3,601,358.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/10/15	2,000,000.00	1,956,562.00	

US TREASURY N/B-1.75%-20/10/31	2,000,000.00	1,961,132.00	
US TREASURY N/B-1.375%-20/10/31	1,290,000.00	1,253,996.10	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,501,298.50	
US TREASURY N/B-1.75%-20/11/15	1,400,000.00	1,372,436.80	
US TREASURY N/B-2.0%-20/11/30	2,000,000.00	1,971,250.00	
US TREASURY N/B-1.625%-20/11/30	1,120,000.00	1,094,122.40	
US TREASURY N/B-1.875%-20/12/15	2,400,000.00	2,357,952.00	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	2,982,363.00	
US TREASURY N/B-1.75%-20/12/31	2,000,000.00	1,957,852.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/01/15	1,900,000.00	1,870,907.20	
US TREASURY N/B-2.125%-21/01/31	2,400,000.00	2,369,625.60	
US TREASURY N/B-1.375%-21/01/31	2,000,000.00	1,937,266.00	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	4,730,000.00	4,848,529.07	
US TREASURY N/B-2.25%-21/02/15	2,500,000.00	2,475,780.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/02/28	2,370,000.00	2,331,210.21	
US TREASURY N/B-1.125%-21/02/28	2,000,000.00	1,922,226.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/03/31	340,000.00	336,473.86	
US TREASURY N/B-1.25%-21/03/31	1,270,000.00	1,223,069.69	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	4,180,000.00	4,134,772.40	
US TREASURY N/B-1.375%-21/04/30	2,000,000.00	1,930,820.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,320,000.00	4,377,036.96	
US TREASURY N/B-2.625%-21/05/15	880,000.00	879,347.04	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	2,060,000.00	1,985,767.90	
US TREASURY N/B-2.125%-21/06/30	6,050,000.00	5,956,884.45	
US TREASURY N/B-1.125%-21/06/30	3,900,000.00	3,727,167.60	
US TREASURY N/B-2.25%-21/07/31	5,300,000.00	5,234,370.10	
US TREASURY N/B-1.125%-21/07/31	5,000,000.00	4,771,485.00	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	3,900,000.00	3,834,948.00	
US TREASURY N/B-1.125%-21/08/31	4,400,000.00	4,191,686.40	
US TREASURY N/B-2.125%-21/09/30	2,400,000.00	2,357,906.40	
US TREASURY N/B-1.125%-21/09/30	1,500,000.00	1,426,875.00	
US TREASURY N/B-2.0%-21/10/31	3,830,000.00	3,744,648.45	
US TREASURY N/B-1.25%-21/10/31	2,000,000.00	1,907,774.00	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	9,250,000.00	10,834,423.25	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	4,000,000.00	3,910,392.00	



US TREASURY N/B-1.75%-21/11/30	600,000.00	581,355.60	
US TREASURY N/B-2.125%-21/12/31	4,520,000.00	4,432,248.72	
US TREASURY N/B-1.5%-22/01/31	800,000.00	766,687.20	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,500,000.00	2,438,380.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/02/28	2,500,000.00	2,415,332.50	
US TREASURY N/B-1.75%-22/03/31	1,800,000.00	1,737,351.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	3,000,000.00	2,892,540.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/04/30	3,800,000.00	3,681,474.20	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	2,000,000.00	1,927,656.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,310,587.36	
US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,441,602.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	3,816,552.69	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	9,700,000.00	9,372,819.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	2,000,000.00	1,912,110.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,834,317.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,406,892.40	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,000,000.00	1,929,570.00	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	2,892,186.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	1,000,000.00	969,102.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	1,000,000.00	953,320.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,302,905.54	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,794,501.10	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	1,912,344.00	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,553,369.10	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	5,800,000.00	5,607,991.00	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	2,927,624.50	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	570,000.00	566,526.42	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	1,887,110.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,104,207.83	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	660,000.00	625,608.06	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,596,061.60	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,150,000.00	7,767,333.05	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,420,342.50	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	4,000,000.00	3,737,108.00	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	2,000,000.00	1,854,140.00	

US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,226,605.60	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,723,463.70	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,325,880.00	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,600,822.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,989,764.00	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	3,230,000.00	3,118,842.78	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,500,000.00	2,428,565.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,941,640.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,288,654.60	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,445,566.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,000,000.00	2,889,081.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,911,172.00	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	5,800,000.00	5,696,574.40	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	4,330,000.00	4,133,543.57	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,100,000.00	1,049,533.10	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	3,180,000.00	3,053,979.78	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,499,357.94	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,343,453.48	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,400,000.00	2,301,561.60	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,052,403.72	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	5,930,000.00	5,723,262.41	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,100,000.00	1,053,400.70	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,832,534.80	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,468,857.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	4,713,831.29	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,047,487.56	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,338,039.20	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,202,620.20	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,579,780.80	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,220,000.00	4,929,533.10	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,940,000.00	5,694,048.36	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,186,366.40	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	5,250,000.00	4,799,445.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	3,400,000.00	3,099,113.60	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,597,344.00	

US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,450,000.00	3,110,542.05	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	4,705,117.20	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,800,000.00	4,563,283.20	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	2,730,000.00	2,618,774.34	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	5,090,000.00	4,824,464.88	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,960,000.00	5,006,228.04	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	6,100,000.00	5,773,552.40	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,948,280.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,209,023.00	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	1,000,000.00	1,213,027.00	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,413,299.06	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	1,460,000.00	1,837,090.26	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	1,800,000.00	2,333,741.40	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,170,000.00	1,415,242.53	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	1,600,000.00	1,968,187.20	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,850,000.00	2,213,460.25	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,820,000.00	2,250,686.62	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,750,000.00	2,131,547.25	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,680,000.00	2,114,600.88	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,940,141.85	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,990,000.00	2,269,260.68	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	2,010,000.00	2,415,455.19	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,927,353.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	1,870,000.00	2,289,543.85	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,960,000.00	2,198,147.84	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	761,672.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,902,890.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,031,328.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,636,759.00	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,120,000.00	5,647,201.28	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	4,500,000.00	5,064,610.50	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,312,774.00	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	3,400,000.00	3,605,060.80	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	4,050,000.00	4,113,439.20	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	3,300,000.00	3,277,441.20	

		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	2,974,639.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,176,998.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	5,300,000.00	5,137,067.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,900,000.00	3,870,750.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,516,281.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,243,947.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,828,172.95	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	1,935,546.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	2,777,250.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	2,656,863.56	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,885,508.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,870,000.00	1,762,364.67	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	1,450,000.00	1,437,283.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	900,000.00	914,273.10	
		米ドル小計	595,260,000.00	593,421,769.99 (65,092,433,950)	
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	391,712.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	1,670,000.00	1,702,815.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-19/08/01	1,090,000.00	1,079,372.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	1,390,000.00	1,391,000.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-19/11/01	950,000.00	944,100.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-20/02/01	780,000.00	773,650.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-20/03/01	2,170,000.00	2,160,191.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-20/05/01	590,000.00	589,528.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,150,000.00	1,186,765.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-20/09/01	2,020,000.00	1,973,641.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/03/01	2,300,000.00	2,233,277.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	950,000.00	986,822.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-21/09/01	1,210,000.00	1,167,383.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-22/03/01	1,190,000.00	1,130,238.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,010,291.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,310,000.00	1,260,403.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	1,140,000.00	1,128,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,380,000.00	1,348,467.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	160,000.00	159,976.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,148,929.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,030,000.00	1,042,102.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,100,000.00	1,052,931.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	370,000.00	546,601.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,160,000.00	1,055,646.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	787,000.00	778,382.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	890,000.00	1,201,918.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,015,000.00	1,477,687.75	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,090,000.00	1,558,678.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	1,345,000.00	1,773,221.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,340,000.00	1,693,103.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	1,055,000.00	1,182,233.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	200,000.00	190,696.00	
			35,267,000.00	37,320,368.15	
				(3,078,557,168)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	18,000,000.00	17,304,201.90	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	27,400,000.00	27,542,652.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	24,700,000.00	23,884,109.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 21/12/09	1,900,000.00	1,869,482.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	21,400,000.00	20,477,197.76	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,200,000.00	8,291,112.66	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	21,500,000.00	24,000,842.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	10,650,000.00	9,436,000.11	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	9,200,000.00	9,063,535.48	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,750,000.00	12,405,194.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	11,900,000.00	11,886,952.24	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,800,000.00	5,783,701.13	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	7,800,000.00	9,474,096.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	9,400,000.00	10,064,979.03	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,500,000.00	15,381,572.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	4,900,000.00	4,996,584.88	

メキシコペソ小計			210,000,000.00	211,862,216.02 (1,158,886,321)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	960,000.00	1,003,046.40	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	1,518,000.00	1,666,803.77	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	1,285,000.00	1,483,544.06	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	1,080,000.00	1,259,042.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,320,000.00	1,577,774.88	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	1,080,000.00	1,209,726.36	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	490,000.00	496,224.47	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	1,340,000.00	1,542,275.68	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	500,000.00	510,581.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,295,000.00	1,342,878.74	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	920,000.00	1,211,864.48	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,210,000.00	1,263,806.28	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	940,000.00	956,514.86	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,715,000.00	2,509,885.35	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	460,000.00	463,101.32	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	750,000.00	749,499.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	913,975.26	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	320,000.00	324,348.16	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	590,000.00	743,374.04	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,585,000.00	2,484,960.30	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	320,000.00	322,589.44	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	530,000.00	570,878.90	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,430,000.00	2,177,831.37	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	815,000.00	1,186,025.49	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	650,000.00	631,093.19	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	260,000.00	282,666.80	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	321,000.00	334,360.02	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	1,740,000.00	1,835,461.62	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	1,850,000.00	1,967,117.95	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	1,480,000.00	1,519,964.44	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	2,000,000.00	2,155,380.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.15%- 20/07/30	1,180,000.00	1,214,152.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	1,790,000.00	2,000,340.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.05%- 21/01/31	280,000.00	281,053.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	2,080,000.00	2,410,437.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.75%- 21/07/30	1,725,000.00	1,767,762.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,960,000.00	2,369,981.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.4%- 22/04/30	1,630,000.00	1,648,727.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%- 22/10/31	1,300,000.00	1,313,014.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	1,675,000.00	2,067,469.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	110,000.00	109,651.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,750,000.00	2,112,503.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,510,000.00	1,864,170.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,680,000.00	1,987,329.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,960,000.00	2,210,507.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,660,000.00	1,749,216.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,850,000.00	2,333,297.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,690,000.00	1,834,163.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,660,000.00	1,773,004.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,620,000.00	2,224,404.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,675,000.00	1,700,060.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,495,000.00	1,529,872.37	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,785,000.00	1,811,444.77
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,590,000.00	1,595,844.51
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,455,000.00	1,974,897.69
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,010,000.00	2,913,312.09
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,630,000.00	1,687,296.13
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,551,820.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,120,000.00	1,182,092.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,560,000.00	2,077,899.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,420,000.00	2,076,552.47
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,540,000.00	2,204,847.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	1,080,000.00	1,651,870.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,260,000.00	1,363,214.16
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	585,000.00	602,259.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	560,000.00	651,503.44
BUNDESobligation-0.25%-20/10/16	1,000,000.00	1,021,108.00
BUNDESobligation-0.0%-21/04/09	1,200,000.00	1,220,244.00
BUNDESobligation-0.0%-21/10/08	740,000.00	753,216.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	3,770,000.00	3,933,214.61
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	3,220,000.00	3,417,920.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	2,720,000.00	2,924,507.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	1,520,000.00	1,618,438.69
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	1,800,000.00	1,944,593.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-	1,730,000.00	1,932,468.82



21/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,580,000.00	1,722,482.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,178,542.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,470,000.00	2,691,312.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,730,390.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	2,065,628.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,874,363.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	2,067,880.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	1,074,141.67	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	2,060,000.00	2,287,275.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,950,000.00	2,141,142.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,956,041.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	2,670,000.00	2,767,906.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,840,000.00	3,042,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,760,000.00	2,848,885.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,530,000.00	2,500,910.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,570,000.00	2,579,367.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,766,167.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,080,000.00	2,123,457.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,729,685.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,380,000.00	1,401,861.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-	860,000.00	1,235,940.40	

28/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	830,000.00	1,374,695.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,420,000.00	2,281,795.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,630,000.00	2,625,481.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,775,000.00	2,744,403.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,060,000.00	1,741,238.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,280,000.00	2,260,287.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,220,000.00	1,816,125.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,690,000.00	2,254,651.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,500,000.00	2,022,144.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	400,000.00	413,966.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 19/08/01	730,000.00	738,796.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	2,550,000.00	2,662,771.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 19/10/15	470,000.00	467,097.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.05%- 19/12/01	1,100,000.00	1,107,088.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,540,000.00	2,690,393.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	2,670,000.00	2,822,306.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%- 20/05/01	750,000.00	747,808.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 20/06/15	400,000.00	396,070.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	2,550,000.00	2,716,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.2%- 20/10/15	380,000.00	373,214.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%-	940,000.00	932,596.16	

20/11/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	2,000,000.00	2,137,066.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,200,000.00	1,285,338.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 21/06/01	540,000.00	529,313.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	2,910,000.00	3,128,203.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	2,890,000.00	3,201,440.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 21/11/01	770,000.00	746,976.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 21/12/15	1,060,000.00	1,088,219.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,180,000.00	2,450,836.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.2%- 22/04/01	1,390,000.00	1,374,363.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 22/04/15	970,000.00	963,238.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,234,104.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,900,000.00	2,192,104.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,298,700.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,312,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	730,000.00	702,626.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,100,000.00	1,059,745.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,531,326.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,934,906.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	380,000.00	356,193.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	2,490,000.00	3,375,297.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	1,650,000.00	1,861,777.50	

24/03/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	895,000.00	881,475.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,500,000.00	1,632,939.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	810,000.00	773,712.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,400,000.00	1,425,317.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,160,000.00	3,696,327.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	480,000.00	454,275.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,210,000.00	1,148,132.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	2,060,000.00	2,009,584.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,430,000.00	1,639,954.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,158,904.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,660,000.00	2,252,235.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,470,000.00	1,338,279.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	860,000.00	833,572.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	950,000.00	904,993.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	3,160,000.00	4,156,622.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	300,000.00	283,032.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,270,000.00	1,486,631.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,870,000.00	3,516,709.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,240,000.00	1,306,358.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,890,000.00	3,805,855.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-	1,485,000.00	1,279,015.65	

32/03/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,740,000.00	2,281,378.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	490,000.00	456,007.91
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,080,000.00	2,579,512.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	798,439.58
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,710,000.00	3,029,928.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	680,000.00	650,617.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,303,167.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,820,000.00	2,251,575.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,310,000.00	1,590,795.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,240,000.00	1,214,230.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,123,819.19
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	950,000.00	946,857.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	583,457.68
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	350,000.00	368,223.45
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	740,000.00	794,009.64
FINNISH GOVERNMENT-0.375%-20/09/15	300,000.00	306,537.00
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	700,000.00	779,374.05
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	324,748.95
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	550,000.00	595,141.80
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	251,416.92
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	520,000.00	581,309.71
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	590,000.00	747,430.29
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	335,012.48
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	410,000.00	415,815.03
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	303,000.00	302,896.56
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	460,991.30

FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	340,000.00	337,407.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	230,000.00	234,216.59	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	380,000.00	498,431.33	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,177,771.87	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	3,230,000.00	3,416,994.39	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	1,650,000.00	1,675,509.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/02/25	1,000,000.00	1,009,645.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	3,180,000.00	3,417,536.77	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	1,600,000.00	1,617,026.08	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,480,000.00	3,727,208.76	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	2,450,000.00	2,495,844.40	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	3,900,000.00	4,369,600.95	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	3,920,000.00	4,403,100.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	3,770,000.00	4,256,541.12	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	3,051,592.22	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	180,000.00	181,386.72	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,365,658.56	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,457,845.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,848,059.79	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	3,140,000.00	3,555,183.36	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,355,000.00	3,709,103.47	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,580,000.00	3,656,857.58	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,980,000.00	4,244,981.98	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,645,000.00	2,788,296.84	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,080,000.00	3,851,309.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,840,000.00	2,874,900.76	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,580,000.00	2,543,789.70	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,780,000.00	2,899,906.96	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,330,000.00	4,003,026.30	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	1,770,000.00	1,787,579.64	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,615,000.00	3,929,030.96	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,600,000.00	3,093,888.46	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,670,000.00	2,857,148.31	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,720,000.00	4,471,443.36	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	180,000.00	183,366.72	

FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,390,000.00	3,724,031.08	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	1,530,000.00	1,529,814.34	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	2,220,000.00	3,297,782.91	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	765,000.00	816,907.46	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,605,000.00	4,175,940.04	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	2,030,000.00	2,782,512.88	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,440,000.00	1,552,691.52	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,220,000.00	1,956,547.55	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	930,000.00	1,524,387.36	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	791,961.06	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	600,000.00	628,320.18	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	505,000.00	547,512.01	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	870,000.00	950,678.75	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	640,000.00	722,536.19	
IRISH TREASURY-0.8%-22/03/15	480,000.00	499,066.80	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	35,000.00	35,240.73	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	678,716.10	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	670,000.00	796,602.53	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	965,000.00	1,290,207.41	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	1,025,000.00	1,061,579.07	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	420,000.00	422,297.52	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	790,000.00	908,252.73	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	125,000.00	124,255.25	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	545,000.00	561,885.19	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	665,000.00	702,589.79	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	1,180,000.00	1,239,041.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	1,240,000.00	1,258,659.89	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	1,330,000.00	1,445,378.03	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,540,000.00	1,720,750.57	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-22/01/15	700,000.00	710,749.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,230,000.00	1,363,431.01	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	500,000.00	593,569.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	910,000.00	1,237,396.97	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	950,000.00	1,045,400.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	180,000.00	180,856.45	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,580,000.00	1,775,655.34	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,275,000.00	1,286,746.69	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,125,000.00	1,147,489.30	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	960,000.00	991,285.04	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	1,195,000.00	1,770,774.90	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	500,000.00	512,620.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,090,000.00	1,348,233.86	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,195,000.00	1,832,902.95	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,255,000.00	1,977,046.55	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,105,000.00	1,547,963.56	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	205,000.00	182,507.73	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	300,000.00	326,745.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	530,000.00	543,158.84	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-19/10/18	610,000.00	616,781.98	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,218,000.00	1,331,310.54	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,260,000.00	1,424,448.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	695,000.00	802,358.73	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	1,094,035.92	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	450,000.00	452,516.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	1,070,000.00	1,175,565.13	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	815,000.00	895,797.47	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	900,000.00	960,924.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	760,000.00	1,028,780.08	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	960,000.00	985,690.56	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	625,000.00	624,995.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	800,000.00	1,212,013.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	460,000.00	465,957.63	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	570,000.00	682,281.45	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	994,000.00	1,494,901.45	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	873,998.37	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	375,000.00	376,391.62	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	273,000.00	460,540.08	
ユーロ小計		401,227,000.00	463,175,808.38 (59,203,131,827)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	285,000.00	289,651.20



UK TREASURY-1.75%-19/07/22	2,093,000.00	2,116,650.90	
UK TREASURY-3.75%-19/09/07	1,490,000.00	1,544,712.80	
UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,610,000.00	1,720,909.68	
UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,870,000.00	1,917,883.22	
UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,610,000.00	1,716,739.78	
UK TREASURY-1.5%-21/01/22	2,030,000.00	2,067,416.96	
UK TREASURY-8.0%-21/06/07	1,020,000.00	1,234,997.23	
UK TREASURY-3.75%-21/09/07	1,110,000.00	1,212,623.94	
UK TREASURY-4.0%-22/03/07	1,100,000.00	1,226,286.05	
UK TREASURY-1.75%-22/09/07	2,130,000.00	2,200,682.55	
UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,610,000.00	1,707,633.62	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,165,000.00	1,278,128.49	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,305,000.00	1,629,757.86	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,490,000.00	1,517,341.50	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,095,000.00	1,084,434.98	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,190,000.00	1,499,745.10	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	300,000.00	304,582.56	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,000,000.00	1,447,045.40	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,250,000.00	1,705,750.00	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,260,000.00	1,675,355.72	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,000,000.00	2,797,344.00	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,670,000.00	2,314,987.40	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	100,000.00	99,606.42	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,410,000.00	2,138,163.48	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,240,000.00	1,784,508.80	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,510,000.00	2,203,044.70	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,735,000.00	2,670,289.92	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,455,000.00	1,886,960.40	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,740,000.00	2,365,599.60	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,560,000.00	2,417,277.72	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,295,000.00	1,214,592.65	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,340,000.00	2,149,373.40	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,530,000.00	2,336,640.17	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,580,000.00	2,717,600.63	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	665,000.00	684,088.16	

		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,220,000.00	2,093,820.85	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	1,660,000.00	2,744,683.84	
		UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,565,000.00	1,538,023.46	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,200,000.00	1,181,539.20	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	1,180,000.00	1,247,850.00	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,142,000.00	1,483,090.27	
英ポンド小計			56,810,000.00	71,167,414.61	(10,344,895,387)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	425,017.64	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	220,000.00	237,249.98	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	551,000.00	668,032.40	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	385,000.00	538,210.75	
スイスフラン小計			1,556,000.00	1,868,510.77	(207,404,695)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,710,000.00	8,775,102.57	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	8,300,000.00	9,565,052.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	7,040,000.00	7,661,878.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,750,000.00	5,539,176.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,090,000.00	5,385,729.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,639,863.63	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,840,000.00	5,499,238.65	
スウェーデンクローナ小計			40,280,000.00	46,066,041.45	(570,758,253)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	6,870,000.00	7,382,392.08	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	5,039,044.36	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,970,000.00	4,295,992.58	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,270,000.00	3,301,758.89	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	3,250,000.00	3,212,950.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	3,070,000.00	3,072,424.99	
ノルウェークローネ小計			25,330,000.00	26,304,562.90	(355,900,736)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	6,720,000.00	7,158,150.72	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	6,930,000.00	7,752,318.65	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	6,640,000.00	7,236,491.12	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	8,190,000.00	9,192,619.80	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,810,000.00	2,848,820.42	

		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,270,000.00	17,536,226.29	
デンマーククローネ小計			41,560,000.00	51,724,627.00	(887,077,353)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	1,810,000.00	1,846,743.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,450,000.00	1,528,010.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	2,570,000.00	2,567,044.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	220,000.00	212,773.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,590,000.00	1,719,664.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	2,160,000.00	2,169,180.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	2,430,000.00	2,415,420.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,410,000.00	1,580,821.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	2,280,000.00	2,285,244.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,070,000.00	2,361,352.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	1,150,000.00	1,157,360.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	2,270,000.00	2,437,753.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,580,000.00	2,635,212.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,900,000.00	2,787,915.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,590,000.00	2,463,219.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	510,000.00	492,405.00	
POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	1,061,944.20			
ポーランドズロチ小計			30,845,000.00	31,722,061.70	(937,704,143)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	1,455,000.00	1,469,047.73	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,240,000.00	2,337,543.93	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	2,120,000.00	2,104,560.63	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,510,000.00	2,765,458.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.0%-21/12/21	1,355,000.00	1,347,484.11	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,050,000.00	2,330,310.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	670,000.00	669,351.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,020,000.00	2,313,003.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,990,000.00	2,026,029.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	2,330,000.00	2,438,547.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	2,660,000.00	2,975,405.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	2,330,000.00	2,720,616.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	2,240,000.00	2,260,698.04	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	2,020,000.00	1,949,952.37	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,800,000.00	1,815,215.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,620,000.00	1,709,421.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	700,000.00	704,069.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,145,000.00	1,375,830.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	630,000.00	614,231.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	930,000.00	1,034,076.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	683,835.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	990,000.00	962,545.96	
豪ドル小計			36,467,000.00	38,607,236.45	(3,141,856,902)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	770,000.00	775,393.54	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-19/10/01	450,000.00	449,057.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-20/07/01	220,000.00	220,183.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	520,000.00	534,092.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	610,000.00	613,050.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-21/10/01	240,000.00	233,688.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-22/04/01	210,000.00	207,018.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	380,000.00	395,010.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	200,000.00	196,215.07	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	455,000.00	465,244.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	559,980.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	200,000.00	199,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	200,000.00	195,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	540,000.00	583,092.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	170,000.00	171,174.87	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	200,000.00	205,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	330,000.00	336,930.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	379,871.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	145,000.00	132,423.42	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	375,000.00	364,875.00	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	410,000.00	397,013.25			
シンガポールドル小計			7,520,000.00	7,614,611.69	(613,813,848)
マレーシ	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	1,010,000.00	1,012,081.71	

アリン ギット		MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	460,000.00	465,166.85	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	850,000.00	849,982.78	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-22/03/10	100,000.00	100,322.65	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	580,000.00	578,765.96	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	793,468.24	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	100,000.00	99,546.29	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	120,000.00	118,679.85	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	980,000.00	960,279.95	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	450,000.00	436,030.66	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	450,000.00	434,806.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	552,509.10	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,140,000.00	1,128,966.13	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	590,000.00	594,323.10	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	1,040,000.00	1,008,078.64	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	970,000.00	994,012.73	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	2,470,000.00	2,500,431.38	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	550,000.00	549,584.48	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.889%-20/07/31	800,000.00	805,731.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,130,000.00	2,157,369.43	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	637,832.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,717,059.29	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	942,461.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,270,000.00	1,275,956.68	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	434,116.58	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	650,000.00	608,640.08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	412,923.59	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	794,976.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,210,000.00	1,189,233.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	989,397.38	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	450,000.00	422,658.09	
	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	885,428.55		
マレーシアリングット小計			26,755,000.00	26,450,821.91	(723,165,471)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	3,750,000.00	3,736,237.50	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	4,650,000.00	4,529,890.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,900,000.00	5,794,065.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,600,000.00	17,112,732.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	7,000,000.00	6,381,900.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,600,000.00	7,950,528.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	6,920,000.00	6,293,290.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	6,610,000.00	6,251,374.45	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,300,000.00	6,002,145.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	8,800,000.00	7,983,228.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	6,310,000.00	5,941,369.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	7,450,000.00	5,310,322.75	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	9,450,000.00	8,636,496.75	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	14,800,000.00	13,483,688.00	
南アフリカランド小計		115,140,000.00	105,407,268.45 (860,123,310)	
合計			147,175,709,364 (147,175,709,364)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 191銘柄	100.0%	44.4%
加ドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%

ユーロ	国債証券	287銘柄	100.0%	40.2%
英ポンド	国債証券	42銘柄	100.0%	7.0%
スイスフラン	国債証券	4銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	17銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドollar	国債証券	21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	9,522,918	9,378,994
金銭信託	-	16,527,058
コール・ローン	43,044,075	7,173,463
国債証券	3,540,165,479	3,630,577,694
派生商品評価勘定	4,029	37,980
未収利息	53,972,127	64,629,677
前払費用	4,282,222	5,906,656
流動資産合計	3,650,990,850	3,734,231,522
<b>資産合計</b>	<b>3,650,990,850</b>	<b>3,734,231,522</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	99,681	3,046
未払金	21,624,583	11,666,990
未払解約金	851,572	-
未払利息	60	7

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
流動負債合計	22,575,896	11,670,043
負債合計	22,575,896	11,670,043
純資産の部		
元本等		
元本	2,671,902,859	2,985,641,834
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	956,512,095	736,919,645
元本等合計	3,628,414,954	3,722,561,479
純資産合計	3,628,414,954	3,722,561,479
負債純資産合計	3,650,990,850	3,734,231,522

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25日現在
1. 期首	平成29年 6月27日	平成29年12月26日
期首元本額	2,335,188,029円	2,671,902,859円
期首からの追加設定元本額	433,860,279円	385,671,411円
期首からの一部解約元本額	97,145,449円	71,932,436円
元本の内訳		
全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	34,397,093円	35,101,806円



インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券 （1年決算型）	2,603,891,771円	2,929,877,774円
インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家 向け）	33,613,995円	20,662,254円
計	2,671,902,859円	2,985,641,834円
2. 受益権の総数	2,671,902,859口	2,985,641,834口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成29年 6月27日 至 平成29年12月25日	自 平成29年12月26日 至 平成30年 6月25日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月25日現在	平成30年 6月25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。	(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。	(3)上記以外の金融商品  同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成29年12月25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	11,111,123
合計	11,111,123

（平成30年 6月25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	60,163,713
合計	60,163,713

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

（平成29年12月25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	34,031,190	-	33,934,439	96,751

	米ドル	12,112,400	-	12,113,470	1,070
	メキシコペソ	4,515,240	-	4,515,240	-
	ブラジルレアル	12,443,860	-	12,344,179	99,681
	ポーランドズロチ	4,959,690	-	4,961,550	1,860
	売建	12,443,860	-	12,442,761	1,099
	米ドル	12,443,860	-	12,442,761	1,099
	合計	46,475,050	-	46,377,200	95,652

（平成30年 6月25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	10,400,939	-	10,435,873	34,934
	メキシコペソ	2,439,000	-	2,457,000	18,000
	ハンガリーフォリント	1,949,769	-	1,949,273	496
	ポーランドズロチ	3,016,650	-	3,014,100	2,550
	南アフリカランド	2,995,520	-	3,015,500	19,980
	合計	10,400,939	-	10,435,873	34,934

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成29年12月25日現在		平成30年 6月25日現在	
1口当たり純資産額	1.3580円	1口当たり純資産額	1.2468円
(1万口当たり純資産額)	(13,580円)	(1万口当たり純資産額)	(12,468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
アルゼンチンペソ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA-18.2%-21/10/03	2,000,000.00	1,776,077.80	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-16.0%-23/10/17	4,200,000.00	3,819,199.86	
		REPUBLIC OF ARGENTINA-15.5%-26/10/17	2,700,000.00	2,457,787.59	
アルゼンチンペソ小計			8,900,000.00	8,053,065.25 (32,695,444)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	5,370,000.00	5,162,420.23	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	8,980,000.00	9,026,752.57	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	7,800,000.00	7,542,350.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-21/12/09	700,000.00	688,756.84	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	6,550,000.00	6,267,553.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	2,830,000.00	2,861,444.97	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	6,610,000.00	7,378,863.63	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,100,000.00	3,632,638.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	5,030,000.00	4,955,389.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	2,360,000.00	2,491,596.55	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	3,650,000.00	3,645,997.95	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	2,000,000.00	1,994,379.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	2,480,000.00	3,012,276.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	2,390,000.00	2,559,074.45	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	4,760,000.00	4,723,631.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	2,000,000.00	2,039,422.40	
メキシコペソ小計			67,610,000.00	67,982,549.29	(371,864,544)
ブラジル リアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	253,750.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-19/10/01	1,100,000.00	993,740.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/01/01	1,350,000.00	1,189,755.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/04/01	1,290,000.00	1,108,755.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-20/07/01	2,510,000.00	2,103,129.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-21/07/01	950,000.00	710,600.00	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-22/01/01	1,280,000.00	899,584.00	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 21/01/01	1,380,000.00	1,389,051.76	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 23/01/01	1,700,000.00	1,641,960.73	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 25/01/01	1,040,000.00	966,845.62	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 27/01/01	1,020,000.00	920,916.42	
NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 29/01/01	350,000.00	309,735.73			
ブラジルリアル小計			14,220,000.00	12,487,823.26	(361,772,239)
チリペソ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE-5.5%-20/08/05	560,000,000.00	582,050,000.00	
チリペソ小計			560,000,000.00	582,050,000.00	(100,229,010)
コロンビ アペソ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA-7.75%-21/04/14	140,000,000.00	147,264,621.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-4.375%-23/03/21	30,000,000.00	28,370,607.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA-9.85%-27/06/28	97,000,000.00	121,338,939.30	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-19/09/11	437,000,000.00	447,970,885.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-11.0%-20/07/24	625,000,000.00	694,337,500.00	

		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-22/05/04	1,335,000,000.00	1,389,708,300.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,105,000,000.00	1,316,690,375.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	280,000,000.00	276,159,800.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,360,000,000.00	1,441,980,800.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	730,000,000.00	700,332,800.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	605,000,000.00	648,877,625.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	250,000,000.00	248,245,000.00	
コロンビアペソ小計			6,994,000,000.00	7,461,277,252.30	(280,544,024)
ペルーヌ エボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	280,000.00	290,254.58	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	710,000.00	746,756.70	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	550,000.00	557,456.90	
		PERU BONO SOBERANO-7.84%-20/08/12	125,000.00	137,937.56	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	440,000.00	521,001.80	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	520,000.00	565,615.18	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	200,000.00	213,762.10	
ペルーヌエボソル小計			2,825,000.00	3,032,784.82	(101,719,602)
ウルグアイ ペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-9.875%- 22/06/20	1,300,000.00	1,284,400.00	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%- 28/03/15	1,300,000.00	1,121,900.00	
ウルグアイペソ小計			2,600,000.00	2,406,300.00	(8,422,050)
トルコリ ラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-19/07/10	570,000.00	519,275.70	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-20/01/15	495,000.00	446,242.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.4%-20/02/05	580,000.00	496,770.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.4%-20/07/08	550,000.00	472,175.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-21/02/17	610,000.00	522,160.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.2%-21/09/22	580,000.00	466,320.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.5%-22/01/12	480,000.00	383,520.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-22/03/02	690,000.00	576,150.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.7%-22/08/17	650,000.00	533,975.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.5%-22/09/14	490,000.00	370,195.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.2%-23/01/18	570,000.00	494,760.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	610,000.00	425,780.00	

		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.8%-23/09/27	470,000.00	346,625.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	270,000.00	213,300.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	660,000.00	487,080.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	620,000.00	417,260.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	810,000.00	618,435.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	660,000.00	507,540.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	710,000.00	531,080.00	
トルコリラ小計			11,075,000.00	8,828,643.20	(209,680,276)
チェココ ルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-1.5%-19/10/29	2,980,000.00	3,010,813.20	
		CZECH REPUBLIC-0.0%-20/02/10	1,700,000.00	1,679,260.00	
		CZECH REPUBLIC-3.75%-20/09/12	3,050,000.00	3,233,259.25	
		CZECH REPUBLIC-3.85%-21/09/29	2,840,000.00	3,088,855.00	
		CZECH REPUBLIC-4.7%-22/09/12	2,870,000.00	3,257,765.70	
		CZECH REPUBLIC-0.45%-23/10/25	2,100,000.00	1,985,560.50	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	3,020,000.00	3,740,889.10	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	2,600,000.00	2,688,413.00	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	2,600,000.00	2,403,713.00	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	1,600,000.00	1,379,328.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	3,860,000.00	3,973,889.30	
CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	1,950,000.00	1,661,419.50			
チェココルナ小計			31,170,000.00	32,103,165.55	(158,910,669)
ハンガ リーフォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-19/10/30	13,500,000.00	13,744,957.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.5%-20/06/24	28,000,000.00	29,273,020.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-20/09/23	19,000,000.00	18,845,435.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.5%-20/11/12	32,200,000.00	36,755,817.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-0.5%-21/04/21	15,000,000.00	14,452,650.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-21/10/27	25,000,000.00	25,455,000.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-22/06/24	36,800,000.00	43,671,480.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.75%- 22/10/26	46,000,000.00	45,076,780.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	45,000,000.00	53,100,450.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	35,000,000.00	35,555,275.00	
HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	49,800,000.00	58,062,816.00			

		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%- 26/12/22	12,000,000.00	11,457,180.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	35,000,000.00	33,568,850.00	
ハンガリーフォリント小計			392,300,000.00	419,019,710.50 (164,842,354)	
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	600,000.00	612,180.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	590,000.00	621,742.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.5%-20/04/25	870,000.00	868,999.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-20/07/25	300,000.00	290,145.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	520,000.00	562,406.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.0%-21/04/25	810,000.00	813,442.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-21/07/25	820,000.00	815,080.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	450,000.00	504,517.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-22/04/25	890,000.00	892,047.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	700,000.00	798,525.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	620,000.00	623,968.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	760,000.00	816,164.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	880,000.00	898,832.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,080,000.00	1,038,258.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	990,000.00	941,539.50	
POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	280,000.00	270,340.00			
ポーランドズロチ小計			11,160,000.00	11,368,186.00 (336,043,578)	
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.8%-19/12/11	5,000,000.00	4,990,325.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.4%-20/05/27	7,900,000.00	7,813,100.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-21/04/14	6,900,000.00	6,989,700.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.5%-21/08/18	10,800,000.00	10,908,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-21/12/15	11,500,000.00	11,411,622.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.6%-22/07/20	6,800,000.00	6,881,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.4%-22/12/07	13,400,000.00	13,420,100.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/01/25	5,400,000.00	5,327,100.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.0%-23/08/16	9,900,000.00	9,771,300.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-6.5%-24/02/28	2,000,000.00	1,910,000.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.1%-24/10/16	13,200,000.00	12,979,692.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.75%-26/09/16	13,700,000.00	13,878,100.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.15%-27/02/03	13,400,000.00	13,922,600.00	



		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.05%-28/01/19	14,900,000.00	14,423,200.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-8.5%-31/09/17	8,750,000.00	9,410,625.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-7.7%-33/03/23	14,500,000.00	14,601,500.00	
ロシアルーブル小計			158,050,000.00	158,638,564.50	(274,444,716)
ルーマニア アレ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.25%- 20/02/26	405,000.00	396,148.72	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.75%- 20/04/29	370,000.00	383,146.10	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 21/03/22	320,000.00	312,371.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.95%- 21/06/11	370,000.00	386,766.55	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.4%-22/03/08	180,000.00	173,214.90	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-22/12/19	400,000.00	381,382.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	360,000.00	377,784.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 24/04/29	250,000.00	229,866.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	340,000.00	337,467.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	400,000.00	421,242.00	
ルーマニアアレ小計			3,395,000.00	3,399,388.72	(93,245,232)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.654%-19/10/31	410,000.00	411,038.32	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.659%-20/10/15	500,000.00	501,030.55	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.62%-21/11/30	280,000.00	279,994.33	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	500,000.00	495,917.64	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	500,000.00	497,731.47	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	600,000.00	587,926.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	350,000.00	339,134.96	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	550,000.00	531,430.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	450,000.00	445,644.52	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.226%- 20/04/15	300,000.00	297,900.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.948%- 22/04/14	430,000.00	430,524.08	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%- 27/07/26	480,000.00	473,765.36	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	580,000.00	587,145.83	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.492%-20/03/31	560,000.00	559,576.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	550,000.00	557,067.22	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	480,000.00	481,256.73	
マレーシアリングット小計			7,520,000.00	7,477,084.73	(204,423,496)
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-2.55%-20/06/26	7,100,000.00	7,212,468.97	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-21/12/17	11,620,000.00	12,294,343.46	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.875%-22/06/17	7,000,000.00	6,959,706.53	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-22/12/17	8,500,000.00	8,468,581.70	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%-23/06/16	7,800,000.00	8,314,208.76	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	7,570,000.00	8,251,088.04	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-26/12/17	6,900,000.00	6,631,683.15	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	8,680,000.00	10,278,815.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-31/06/20	7,300,000.00	7,705,469.01	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%-32/06/25	4,500,000.00	4,807,579.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-36/06/17	5,750,000.00	5,829,305.15	
タイバーツ小計			82,720,000.00	86,753,249.47	(288,888,320)
フィリピンペソ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES-4.95%-21/01/15	5,000,000.00	4,943,750.00	
フィリピンペソ小計			5,000,000.00	4,943,750.00	(10,184,125)
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-20/11/15	800,000,000.00	866,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-12.8%-21/06/15	500,000,000.00	573,125,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-21/07/15	2,930,000,000.00	3,007,645,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-22/05/15	3,020,000,000.00	2,988,290,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	1,550,000,000.00	1,445,375,000.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	4,250,000,000.00	4,408,312,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	760,000,000.00	895,850,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,790,000,000.00	3,936,862,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	3,400,000,000.00	3,251,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	2,000,000,000.00	1,810,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,650,000,000.00	2,888,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	970,582,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	1,900,000,000.00	1,999,829,610.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	820,000,000.00	910,618,282.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,100,000,000.00	1,101,469,820.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	1,100,000,000.00	1,048,850,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	1,680,000,000.00	1,484,280,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	2,600,000,000.00	2,659,800,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,560,000,000.00	2,572,800,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	1,650,000,000.00	1,563,375,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.25%- 20/09/15	750,000,000.00	782,003,025.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.75%- 23/08/15	500,000,000.00	550,274,850.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%- 31/11/15	1,090,000,000.00	1,158,115,735.00	
		インドネシアルピア小計	42,210,000,000.00	42,873,208,822.00 (334,411,028)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	1,300,000.00	1,295,229.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	1,490,000.00	1,451,513.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	2,050,000.00	2,013,192.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	5,400,000.00	5,923,638.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,930,000.00	2,671,281.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	2,940,000.00	2,434,849.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	2,650,000.00	2,410,002.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	2,000,000.00	1,891,490.00	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	2,590,000.00	1,872,958.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	3,210,000.00	2,912,063.85	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	2,320,000.00	2,184,465.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	2,540,000.00	1,810,499.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	3,080,000.00	2,814,858.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	5,340,000.00	4,865,060.40	
南アフリカランド小計		39,840,000.00	36,551,101.35 (298,256,987)	
合計			3,630,577,694 (3,630,577,694)	

(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
アルゼンチンペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.0%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	2.8%
コロンビアペソ	国債証券 12銘柄	100.0%	7.7%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	2.8%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 19銘柄	100.0%	5.8%
チェココルナ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.4%
ハンガリーフォリント	国債証券 13銘柄	100.0%	4.5%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.3%
ロシアルーブル	国債証券 16銘柄	100.0%	7.6%
ルーマニアレイ	国債証券 10銘柄	100.0%	2.6%
マレーシアリンギット	国債証券 16銘柄	100.0%	5.6%
タイバーツ	国債証券 11銘柄	100.0%	8.0%

フィリピンペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.3%
インドネシアルピア	国債証券	23銘柄	100.0%	9.2%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	8.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 6月29日現在です。

### 【全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	219,618,120円
負債総額	771,705円
純資産総額( - )	218,846,415円
発行済口数	224,293,156口
1口当たり純資産額( / )	0.9757円

(参考)

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	29,201,449,064円
負債総額	191,592,215円
純資産総額( - )	29,009,856,849円
発行済口数	18,701,901,455口
1口当たり純資産額( / )	1.5512円

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

#### 純資産額計算書

資産総額	84,492,478,714円
負債総額	33,448,395円
純資産総額( - )	84,459,030,319円
発行済口数	35,056,767,912口
1口当たり純資産額( / )	2.4092円

### 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	16,300,910,900円
負債総額	89,170,686円
純資産総額（ - ）	16,211,740,214円
発行済口数	9,252,090,312口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7522円

#### 日本債券インデックスマザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	38,187,500,039円
負債総額	270,927,396円
純資産総額（ - ）	37,916,572,643円
発行済口数	27,145,308,593口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3968円

#### 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	149,607,540,641円
負債総額	91,980,615円
純資産総額（ - ）	149,515,560,026円
発行済口数	67,187,881,351口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2253円

#### 海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	3,775,152,061円
負債総額	29,959,931円
純資産総額（ - ）	3,745,192,130円
発行済口数	3,013,027,954口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2430円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （1）名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2018年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2018年6月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

###### ・監査役会

当社の監査役会は5名以内の監査役で構成され、監査役の任期は選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2018年6月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2018年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	810	176,770

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

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
現金・預金	3	16,761	3	14,024
金銭の信託	3	152		-
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	3	2,799	3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	2,3	385	2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	93	1	68
器具備品	1	190	1	122
有形固定資産合計		283		191
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		138		99
無形固定資産合計		138		99
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		11,783		14,103
関係会社株式		23,203		25,769
関係会社長期貸付金		60		-
長期差入保証金		782		490

長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	3 589	3 3,804
未払金	4,043	5,874
未払収益分配金	7	7
未払償還金	91	91
未払手数料	3 3,499	3 5,124
その他未払金	445	651
未払費用	3 4,229	3 4,634
未払法人税等	1,808	2,185
未払消費税等	4 538	4 788
賞与引当金	2,077	2,286
役員賞与引当金	168	198
その他	3 62	41
流動負債合計	13,517	19,813
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,259	1,316
その他	-	318
固定負債合計	1,259	1,634
負債合計	14,777	21,448
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	34,015	39,959
利益剰余金合計	34,015	39,959
自己株式	672	786
株主資本合計	55,926	61,756
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511

負債純資産合計	71,252	83,959
---------	--------	--------

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第58期	第59期
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355
退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175
一般管理費計	14,394	15,664
営業利益	6,380	9,526

	(単位：百万円)	
	第58期	第59期
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						170	170

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926

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

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額 金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036

当期末残高	408	346	754	62,511
-------	-----	-----	-----	--------

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

項目	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>

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>

## (貸借対照表関係)

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

## (損益計算書関係)

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



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

## (株主資本等変動計算書関係)

第58期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	814,100	305,000	-	1,119,100

## 3 新株予約権等に関する事項

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

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,890,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,119,100	182,600	-	1,301,700

## 3 新株予約権等に関する事項

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

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2)108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

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

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

## (金融商品関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

(1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

#### (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

#### (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

#### (8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

##### 1 金融商品の状況に関する事項

###### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

###### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

ております。

#### (8) デリバティブ取引

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

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

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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



## (デリバティブ取引関係)

第58期(平成29年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第59期(平成30年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

## (退職給付関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、213百万円でありました。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

## （2）ストックオプション（新株予約権）の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)



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

## ( 関連当事者情報 )

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

### (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

#### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

#### (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

## 関連情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### （重要な後発事象）

#### 新株予約権（ストックオプション）の付与

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
農林中央金庫	3,480,488百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余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。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

## 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

平成30年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年7月25日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 辻村 和之

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」に掲げられている全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成29年12月26日から平成30年6月25日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型の平成30年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。