

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年5月20日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ
株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 高村 孝

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 中川 祐子

【電話番号】 03 - 4530 - 7409

【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】 AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型
バランス・オープン（ステイブル）

【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】 2兆円を上限とします。

【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】

AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）

（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供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もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）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」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第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、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

（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。

収益分配金の再投資を行う場合は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。

基準価額とは、信託財産の純資産総額を受益権総口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当たりの価額で表示されます。

基準価額は、販売会社（後記「（８）申込取扱場所」をご参照ください。）にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。申込手数料には消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）がかかります。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

申込単位は、販売会社が定める単位とします。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2020年5月21日から2021年5月20日まで

当該申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細については、前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の<照会先>までお問い合わせください。

(9) 【払込期日】

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（詳細については、販売会社にお問い合わせください。）までに、取得申込代金を販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、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】

申込みを受付けた販売会社とします（前記「(8) 申込取扱場所」をご参照ください。）。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12) 【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

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】

当ファンドは、株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、2兆円を限度として信託金を追加できるものとします。また委託会社は、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。

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信 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。

当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	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。
投資対象地域	内外	目論見書又は信託約款において、国内及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。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信及びその他資産のうち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。
補足分類	インデックス型	目論見書又は信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経 225
債券 一般 国債 社債	年2回	日本			
	年4回	北米			
	年6回 (隔月)	欧州			
		アジア			

その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	オセアニア			TOPIX
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(株式、 債券)、資産配分変 更型))	その他 ()	アフリカ			その他 (AMCリスク バジェット型 資産配分モデル 指数)
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		中近東 (中東)			
		エマージング			

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

(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。

当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券)、資産配分変更型))	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を含む)	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産(日本を含む)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は信託約款において、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く。)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	目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他(AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数)	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

ファンドの特色

- 1 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。**
日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。

<株式会社トータルアセットデザインの概要>

1998年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、2015年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。

- 2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果の獲得を目指します。**

※AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数は、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、投資対象とするマザーファンドのベンチマークのリターンを合成した指数であり、当ファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。

投資対象とするマザーファンドのベンチマークについては「マザーファンドの概要」をご参照ください。

- 3 実質的に保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。**

※投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

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・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	・ TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

※TOPIX(東証株価指数配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している株式全銘柄で構成される株価指数で、配当を考慮したものです。

日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	・ NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。 ・ 債券組入比率は原則として高位を維持します。

※NOMURA-BPI総合指数は、日本の国債、事業債(社債)、地方債、政府保証債等の固定利付債券で構成される債券価格指数です。

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、MSCI コクサイ指数(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本を除く世界の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)
投資態度	・ MSCI コクサイ指数(円ベース)をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

※MSCI コクサイ指数は、日本を除く世界の主要先進国の株式で構成される株価指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
投資態度	・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとします。 ・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

※FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、日本を除く世界の主要国の国債で構成される債券価格指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ 株式会社東京証券取引所は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 上記に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

NOMURA-BPI総合指数

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、当該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、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

当ファンドは、MSCI Inc.(以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。))が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数はMSCIが独占的に所有しています。MSCIおよびMSCI指数は、MSCIおよびその関連会社のサービスマークであり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下、「SSGA」といいます。))は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI関係者は、当ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIおよびその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に関わらず、MSCIにより決定、作成、計算されています。MSCI関係者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI関係者は、当ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI関係者は、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入力しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人または法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

FTSE世界国債インデックス(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))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。FTSE Fixed Income LLCは、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。WGBI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。WGBIに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(2) 【ファンドの沿革】

2012年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



各マザーファンドには、当ファンド以外にも、当該各マザーファンドに投資する他のファンド（ベビーファンド）があります。

ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

- 1) ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）

委託会社は、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。

- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

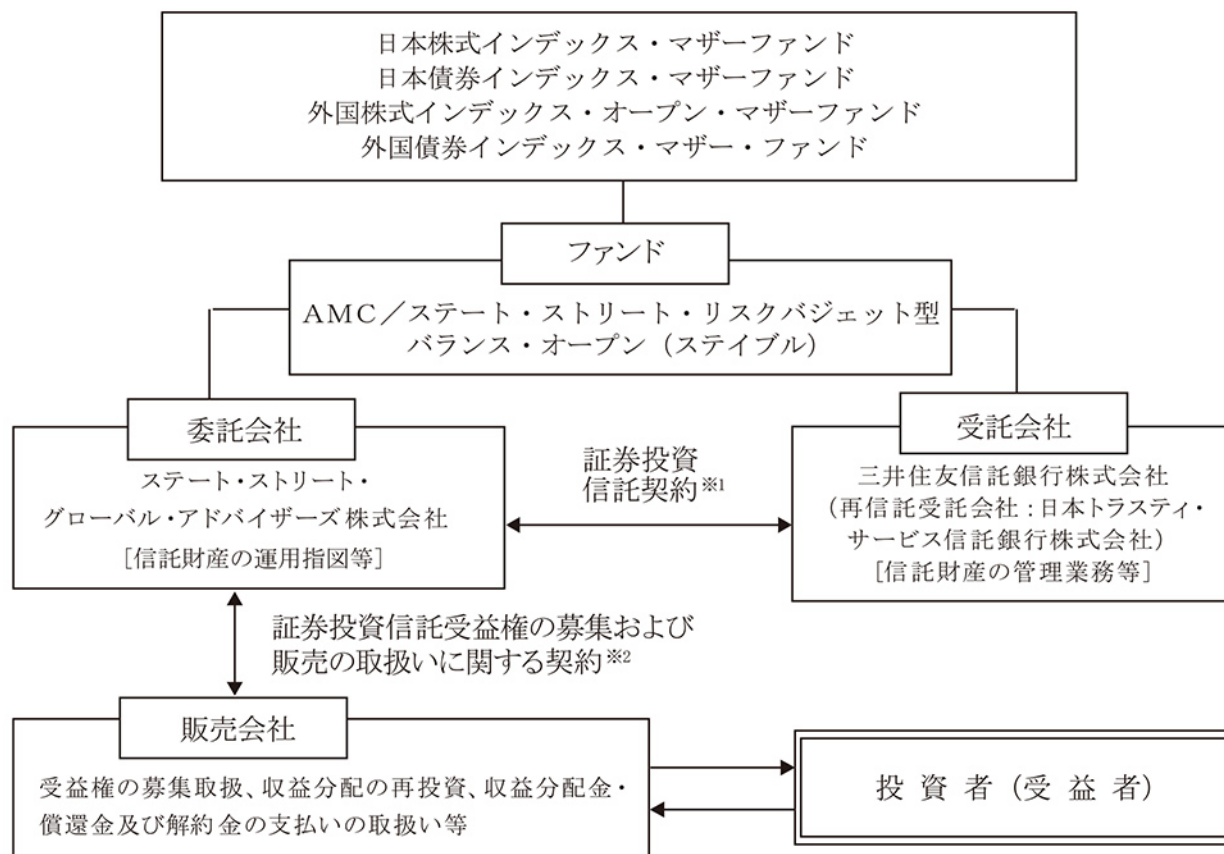
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

- 3) 販売会社

販売会社は、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受け付けならびに収益分配金、一部解約代金および償還金の支払い等を行います。

ファンド関係法人



1 証券投資信託契約

委託会社、受託会社および受益者に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益権に関する事項ならびに信託の元本および収益の管理ならび運営に関する事項等が定められます。

なお、ファンドは、委託会社と受託会社とが証券投資信託契約を締結することにより成立します。証券投資信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出た信託約款の内容に基づいて締結されます。

2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

販売会社の募集の取扱い、換金の取扱い、償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められます。

委託会社の概況（本書提出日現在）

1）資本金の額

3億1千万円

2）沿革

1998年2月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
1998年3月31日	投資顧問業の登録
1998年8月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年9月30日	投資一任契約に係る業務の認可
1998年9月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
2007年9月30日	金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第345号）
2008年7月1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

3）大株主の状況

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

当ファンドは、株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

株式会社トータルアセットデザインが、日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより決定した資産配分に基づき、各資産のベンチマークのリターンを合成した指数で、資産配分は定期的に見直しが行われます。

「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。

「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

各マザーファンド受益証券のベンチマークは下記の通りで、各マザーファンド受益証券においては、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数配当込み）]

日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合指数]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCIコクサイ指数（円ベース）¹]

外国債券インデックス・マザー・ファンド

[ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）²]

¹ MSCIコクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

² FTSE世界国債インデックス（除く日本）の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

マザーファンド受益証券の組入れに伴う実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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ため、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）の3）4）5）に定めるものに限ります。以下同じ。）を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または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。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに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行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて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) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - (a) 有価証券
 - (b) デリバティブ取引に係る権利
 - (c) 金銭債権
 - (d) 約束手形

- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- (a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（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。）に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 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
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 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。）
- 14) 投資証券もしくは投資法人債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。）

- 15) 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。)
- 16) 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。)
- 17) 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。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 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
- 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの
- 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 22) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、1)の証券または証書、12)および17)の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに12)および17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)の証券および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

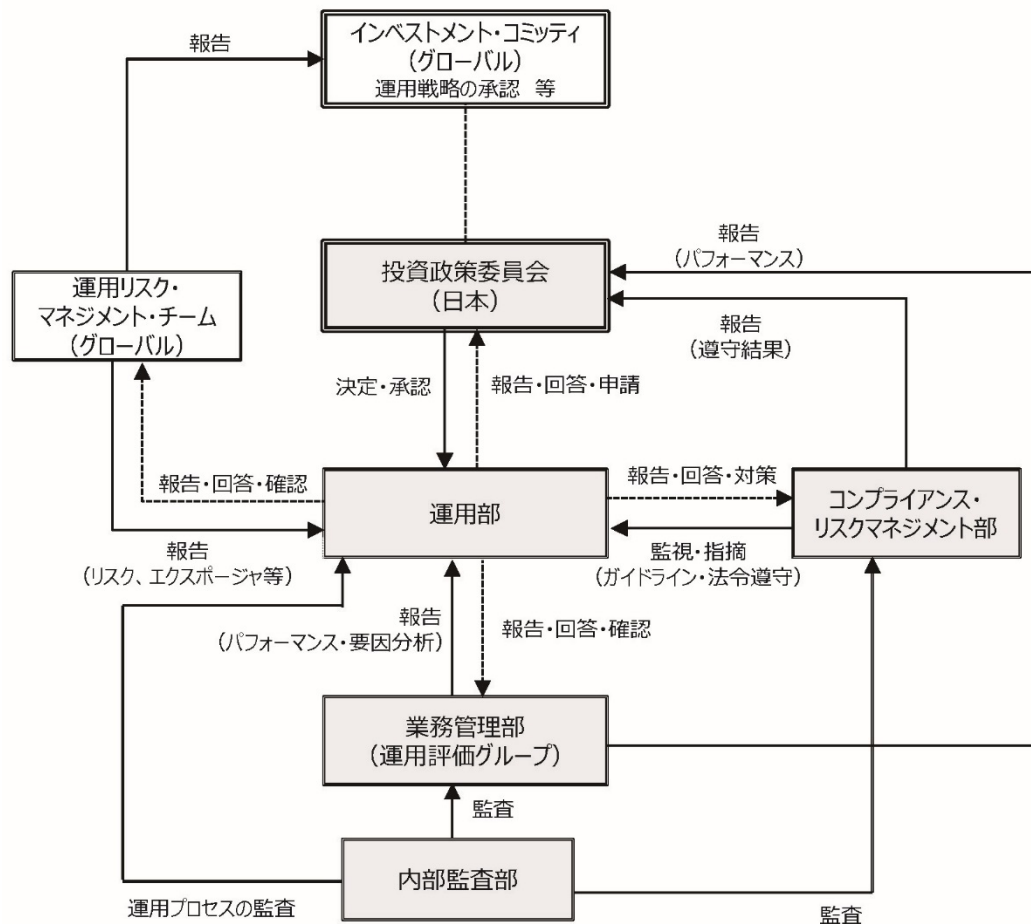
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券(取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券)を除きます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。以下同じ。)の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

上記 において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。運用モデル/プロセスは基本的に、グループ会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー（所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市）を中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

ファンド担当者は、いずれも国内外の有価証券市場に精通した経験豊富な投資運用の専門家であり、資産クラス・運用戦略ごとの運用チームに配置されています。また、チーム・アプローチによって運用を行うため、特定の担当者に依存することない安定した運用体制となっています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部の代表等により構成されています。投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、ガイドラインに対する適合性、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

グローバルには、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ（SSGA）のグローバル組織である運用リスク・マネジメント・チームが、ポートフォリオの運用リスクモニタリングを定期的に行っています。当チームは運用チームとは独立した組織で、SSGAグローバルのチーフ・リスク・オフィサーに直接報告を行っており、ポートフォリオが顧客のガイドラインや運用戦略に即したリスクをとっているか、また目標リターンに見合ったリスクをとっているか、リスクに対する寄与が意図したエクスポージャーによるものか否か等、運用戦略の中身に実質的にフォーカスしたかたちでモニタリングを行い、その結果は継続的に運用担当チームにフィードバックされています。

当チームが行った戦略代表口座の分析結果は、インベストメント・コミッティ（グローバル）およびグローバルの運用戦略責任者によってレビューされています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、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（原則として2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の範囲内とします。

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

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

なお、上記は収益分配方針であり、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。
- ・ 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。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、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小さかった場合も同様です。

（５）【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める主な投資制限

- 1) マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- 2) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）の実質投資割合には制限を設けません。
- 3) 公社債の実質投資割合には制限を設けません。
- 4) 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。
- 5) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 6) デリバティブ取引は、後記の3)4)5)の範囲で行います。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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うこととします。

信託約款上のその他の投資制限

- 1) 投資する株式等の範囲（信託約款第18条）

委託会社が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、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するもの（上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものを含みます。）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。

2) 信用取引の指図範囲（信託約款第19条）

- (a) 委託会社は、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。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。
- (b) 上記(a)の信用取引の指図にあたっては、当該売り付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとしします。
- (d) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売り付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) 委託会社は、上記(a)の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

3) 先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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ため、わが国の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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行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します（以下同じ。）。)
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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ため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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ため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

4) スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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ため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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。）を行うことの指図をすることができます。

- (b) 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可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。
- (d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（信託約款第22条）
- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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ため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 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。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6) 有価証券の貸付の指図および範囲（信託約款第23条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
- (b) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7) 公社債の空売りの指図範囲（信託約款第24条）
- (a) 委託会社は、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。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b) 上記(a)の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係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。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8) 公社債の借入れ（信託約款第25条）

- (a) 委託会社は、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。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図にあたっては、当該借入れに係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。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- 9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）
(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額と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との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、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。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として信託財産に係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額と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との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための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。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (d) 上記(a)および(b)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）
委託会社は、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に定める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ることとなる投資の指図をしません。
法令に基づく投資制限
- 1) 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- 2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定め

た合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

（１）投資方針

この投資信託は、中長期的な観点から、TOPIX（東証株価指数配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り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。）および金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに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えない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において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) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

- (a) 有価証券
- (b) デリバティブ取引に係る権利
- (c) 金銭債権
- (d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- (a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、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。）に投資することを指図します。

- 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) 特定目的会社に係る特定社債券(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) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 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
- 12) 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。)
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券(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。)
- 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) 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
- 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) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、1)の証券または証書、15)の証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券、15)の証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、12)の証券および13)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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。)
- 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

上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、信託約款第16条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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、委託者は、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。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第18条の2）

委託会社は、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に定める合理的方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（参考）「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「日本債券インデックス・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

（1）投資方針

この投資信託は、中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。

債券組入比率は原則として高位を維持します。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り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。）ならびに金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（2）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において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）次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

（a）有価証券

（b）デリバティブ取引に係る権利

（c）金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、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。）に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 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
- 12) 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。）
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（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。）
- 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、）
- 15) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 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
- 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、）
- 18) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、1) の証券または証書、15) の証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券、15) の証書のうち2) から6) までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、12) の証券および13) の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債の転換請求および新株予約権（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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ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め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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うこととします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託会社は、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に定める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ることとなる投資の指図をしません。

（参考）「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

（1）投資方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式を投資対象とし、中長期的に日本を除く世界の主要国の株式市場（MSCIコクサイ指数）の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

日本を除く世界各国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とします。

株式への投資にあたっては、日本を除く世界各国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCIコクサイ指数に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれを行う。以下同じ。）を減じるため、ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実

現するために限定して、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の価格変動および金利変動により生じるリスクを減じるため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(2) 投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において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) 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - (a) 有価証券
 - (b) デリバティブ取引に係る権利
 - (c) 金銭債権
 - (d) 約束手形
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - (a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、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。)に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 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
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)から7)までの証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託又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号定めるものをいいます。)
- 10) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(クローズド・エンド型の会社型外国投資信託証券を除きます。以下同じ。)(金融商品取引法第2条第1項第11号定めるものをいいます。)
- 11) 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。)
- 12) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 13) 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
- 14) 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。)
- 15) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、1)の証券または証書および8)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から5)までの証券および8)の証券または証書のうち2)から5)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。また、9)または10)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 主な投資制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款第17条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

金利先物取引及び為替先渡取引は、信託約款第19条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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うこととします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(信託約款第19条の2)

委託会社は、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に定める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ることとなる投資の指図をしません。

(参考)「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の概要は、以下の通りです。

(1) 投資方針

この投資信託は、主として日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象としFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

公社債への投資は原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。その際の実質投資比率は、原則として信託財産の純資産総額の100%以内とします。また、実質投資比率がこの上限を超過した場合には、速やかに調整するものとします。なお、ここでいう実質投資比率は、現物資産の時価総額と有価証券先物等の買建玉の時価総額の合計額から売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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。）ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

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ことがあります。

（２）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において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) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - (a) 有価証券
 - (b) デリバティブ取引に係る権利
 - (c) 金銭債権
 - (d) 約束手形
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - (a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、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。）に投資することを指図します。

- 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) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 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
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 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。)
- 14) 投資証券もしくは投資法人債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。)
- 15) 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。)
- 16) 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。)
- 17) 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。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 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
- 20) 外国の者に対する権利で19) の有価証券の性質を有するもの。
- 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 22) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、1) の証券または証書、12) および17) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券ならびに12) および17) の証券または証書のうち2) から6) までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13) の証券および14) の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第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(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ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め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の転換による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等は、信託約款15条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款16条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、信託約款17条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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うこととします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託会社は、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に定める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ることとなる投資の指図をしません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本および世界主要国の株式や公社債等に分散投資を行いますが、主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合があります、その運用成果（損益）はすべて投資者の皆さまに帰属します。

したがって、投資者の皆さまの投資元本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、投資元本を割り込むことがあります。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクおよび留意点は以下のとおりですが、当ファンドのリスクおよび留意点を完全に網羅しておりませんのでご注意ください。また、ファンドのリスクは以下に限定されるものではありません。

資産配分リスク

当ファンドは、国内外の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、市場環境に応じて決定した最適な資産配分比率に変更する運用を行います。この資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予期しない値動きをした場合、損失を被る可能性があります。

株価変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式を実質的な投資対象としていることから、株式の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

信用リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式や公社債等を実質的な投資対象としていることから、株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。また公社債等の価格は、公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等、信用状況によって変動し、特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはでき

なくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。したがって、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式や公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、金融商品取引の相手方や受託会社の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。運用資産の規模等によっては、当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。

金利変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の公社債等を実質的な投資対象としていることから、金利変動リスクを伴います。一般に、公社債等の価格は、金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します（価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

当ファンドの実質的な投資対象である世界主要国の株式や公社債等（日本を除く）は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。一般に、主な為替相場の変動要因としては、金利変動、中央銀行等による政策金利の変更または為替介入、政治的要因等があります。

流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければなら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。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって解約金の支払いに対応する場合があります、その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

投資対象国への投資リスク

当ファンドが実質的に保有する有価証券の発行国（投資対象国）における政治不安や社会不安、あるいは他国との外交関係の悪化などの要因により、投資成果に大きく影響することがあります。また、投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送付金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の有価証券への投資に悪影響が及ぶ可能性があります。

デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

パッシブ運用のリスク

当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドはパッシブ運用を採用しています。パッシブ運用とは、ベンチマーク（参考指数）とするインデックスと連動する投資成果を目指す運用手法であり、ファンド・マネージャーが経済情勢、市場分析等に基づき個別銘柄の売買を行うことによりインデックスを上回る投資成果を目指すアクティブ運用とは異なります。

マザーファンドは、投資成果をインデックスにできるだけ連動させるため、原則としてポートフォリオにおける時価構成をインデックスにおける銘柄別時価構成比に近づけるように投資対象銘柄の売買を行います。ただし、インデックス採用銘柄の変更や資本異動等によりポートフォリオの調整が行われる場合等、個別銘柄の売買等にあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があるため、基準価額の変動率がインデックスの変動率に一致せず、ファンドの投資成果がインデックスの投資成果に

連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

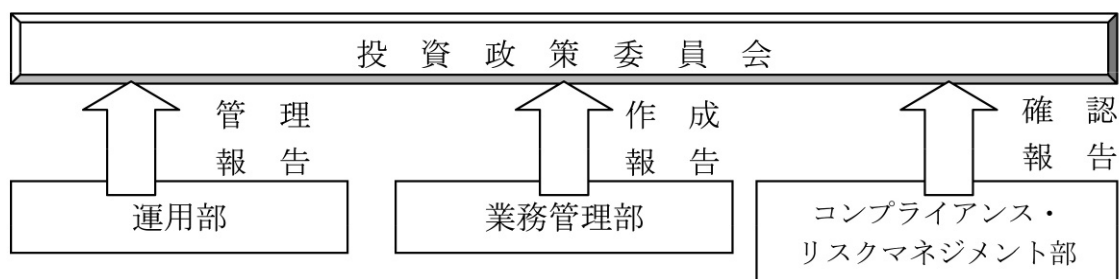
ファミリーファンド方式のリスク

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のファンド（ベビーファンド）に追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあり、これにより、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

（２）その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、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）の適用はありません。

（３）リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは信託約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

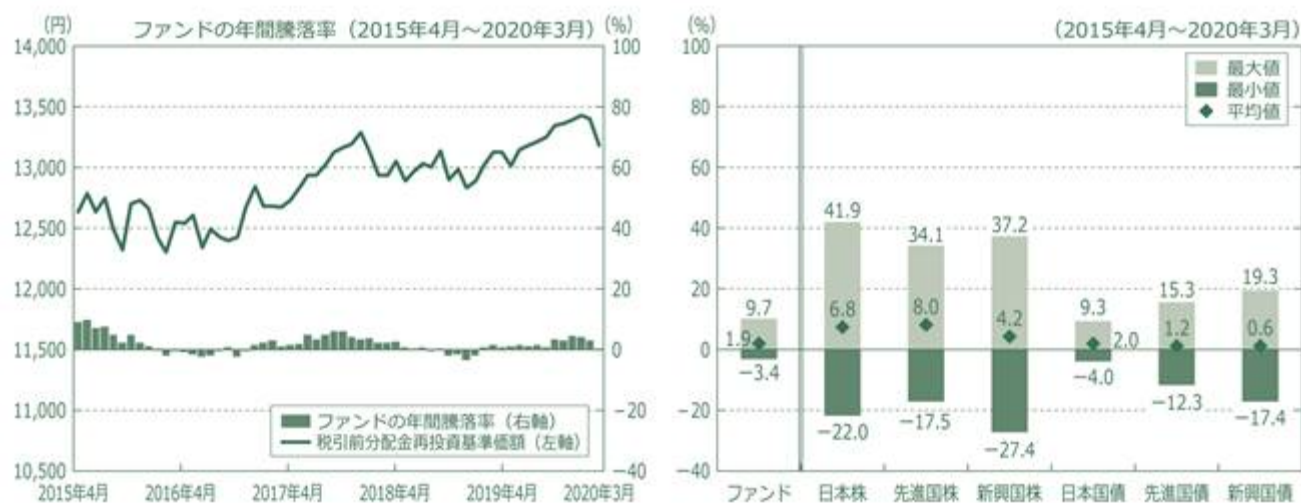
投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

上記リスクに対する管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

＜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＞ ＜ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較＞



- ・上記の左グラフは、各月末における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を表示したものです。
 - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
 - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
 - ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、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。
 - ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
 - ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、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います。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)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、同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。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)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、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。

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)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、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。

日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)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、同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】

申込手数料（購入時手数料）は、取得申込受付日（購入申込受付日）の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合の購入時手数料は、無手数料とします。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

ただし、換金時に信託財産留保額（換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額）が差し引かれます。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率0.825%（税抜0.75%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

ファンドの信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のときに信託財産中から支払います。

< 信託報酬率の配分（税抜）>

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.60%	委託した資金の運用の対価
販売会社	0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	0.05%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

（注）マザーファンドで有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料のうち当ファンドに属するとみなした額の100分の50以内の額を、別途、信託財産から支払います。

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します（信託約款第38条）。

信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

上記に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託会社の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。

ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。

信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。

その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

上記（１）～（４）の当該手数料等の合計額については、投資者の皆さまがファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することはできません。

（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、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により、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場合に限ります。）との損益通算が可能です。また、換金（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場合に限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

少額投資非課税制度（NISA）、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、毎年、一定額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一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資者に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記の内容は、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合等には変更となる場合があります。

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行うつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を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、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は、2020年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(2020年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,829,791,594	84.84
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		684,438,080	15.16
純資産総額		4,514,229,674	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(2020年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	90,742,023,640	96.59
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		3,202,088,051	3.41
純資産総額		93,944,111,691	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

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)

(2020年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	125,414,990,400	81.05
特殊債券	日本	13,308,600,090	8.60
地方債証券	日本	9,528,429,791	6.16
社債券	日本	4,703,935,500	3.04
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,771,914,746	1.15
純資産総額		154,727,870,527	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(2020年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	82,170,966,754	65.56
	イギリス	6,115,581,555	4.88
	スイス	4,492,537,338	3.58
	フランス	4,452,185,793	3.55
	カナダ	3,915,267,086	3.12
	ドイツ	3,451,932,360	2.75
	オーストラリア	2,378,245,629	1.90
	オランダ	1,752,154,158	1.40
	香港	1,477,967,348	1.18
	スウェーデン	1,120,790,434	0.89
	スペイン	1,077,171,497	0.86
	デンマーク	912,047,693	0.73
	イタリア	903,683,982	0.72
	シンガポール	436,792,173	0.35

	フィンランド	400,794,520	0.32
	ベルギー	357,048,480	0.28
	イスラエル	248,235,295	0.20
	アイルランド	228,362,064	0.18
	ノルウェー	219,401,257	0.18
	ニュージーランド	127,026,451	0.10
	ポルトガル	72,879,879	0.06
	オーストリア	70,738,176	0.06
	小計	116,381,809,922	92.85
投資証券	アメリカ	2,788,115,240	2.23
	オーストラリア	140,670,685	0.11
	フランス	86,477,522	0.07
	イギリス	67,562,000	0.05
	香港	65,642,777	0.05
	シンガポール	59,414,696	0.05
	カナダ	25,630,711	0.02
	小計	3,233,513,631	2.58
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		5,730,019,223	4.57
純資産総額		125,345,342,776	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2020年3月31日現在）

種類	国 / 地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	71,220,265,997	49.96
	フランス	13,390,868,634	9.39
	イタリア	12,112,184,640	8.50
	イギリス	8,818,354,895	6.18
	ドイツ	8,624,876,375	6.05
	スペイン	7,534,221,697	5.28
	ベルギー	3,242,332,782	2.27
	カナダ	2,549,857,093	1.79
	オランダ	2,528,287,685	1.77
	オーストラリア	2,448,760,999	1.72
	オーストリア	1,948,081,643	1.37
	アイルランド	994,440,060	0.70
	メキシコ	954,776,894	0.67
	ポーランド	793,802,227	0.56
	フィンランド	784,358,154	0.55
	デンマーク	679,923,396	0.48
	マレーシア	661,260,971	0.46
	シンガポール	595,587,938	0.42
	南アフリカ	573,127,427	0.40
	スウェーデン	389,319,668	0.27
ノルウェー	307,963,702	0.22	
	小計	141,152,652,877	99.01
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,405,990,653	0.99
純資産総額		142,558,643,530	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（2020年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資 信託受 益証券	外国債券インデック ス・マザー・ファンド		765,983,053	2.4347	1,865,006,979	2.4358	1,865,781,520	41.33
2	日本	親投資 信託受 益証券	日本債券インデック ス・マザーファンド		1,201,682,192	1.3020	1,564,649,782	1.2922	1,552,813,728	34.40
3	日本	親投資 信託受 益証券	日本株式インデック ス・マザーファンド		90,166,542	2.7861	251,221,788	2.3942	215,876,734	4.78
4	日本	親投資 信託受 益証券	外国株式インデック ス・オープン・マザー ファンド		82,787,103	3.1306	259,180,882	2.3593	195,319,612	4.33
									投資比率：合計	84.84

（注1）投資有価証券は4銘柄です。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	84.84
合計		84.84

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2020年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	512,700	7,008.00	3,593,001,600	6,501.00	3,333,062,700	3.55
2	日本	株式	ソニー	電気機器	290,700	6,929.00	2,014,260,300	6,421.00	1,866,584,700	1.99
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	602,700	2,544.00	1,533,268,800	2,575.50	1,552,253,850	1.65
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	41,600	34,220.00	1,423,552,000	34,830.00	1,448,928,000	1.54
5	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通信業	357,700	5,092.00	1,821,408,400	3,788.00	1,354,967,600	1.44
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	382,300	3,896.00	1,489,440,800	3,308.00	1,264,648,400	1.35
7	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	3,099,900	505.90	1,568,239,410	403.00	1,249,259,700	1.33
8	日本	株式	任天堂	その他製品	28,200	37,920.00	1,069,344,000	41,610.00	1,173,402,000	1.25
9	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	333,000	3,026.00	1,007,658,000	3,377.00	1,124,541,000	1.20
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	336,000	3,270.00	1,098,720,000	3,190.00	1,071,840,000	1.14
11	日本	株式	第一三共	医薬品	131,500	6,813.00	895,909,500	7,434.00	977,571,000	1.04
12	日本	株式	花王	化学	110,000	8,186.00	900,460,000	8,830.00	971,300,000	1.03

13	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	314,500	3,888.00	1,222,776,000	2,796.00	879,342,000	0.94
14	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	361,700	2,809.00	1,016,015,300	2,430.00	878,931,000	0.94
15	日本	株式	H O Y A	精密機器	91,700	9,811.00	899,668,700	9,200.00	843,640,000	0.90
16	日本	株式	信越化学工業	化学	77,300	12,000.00	927,600,000	10,730.00	829,429,000	0.88
17	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	313,400	3,309.00	1,037,040,600	2,623.00	822,048,200	0.88
18	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	162,000	5,513.00	893,106,000	4,950.00	801,900,000	0.85
19	日本	株式	ダイキン工業	機械	58,500	14,440.00	844,740,000	13,170.00	770,445,000	0.82
20	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	6,157,400	141.90	873,735,060	123.60	761,054,640	0.81
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	135,000	5,847.00	789,345,000	5,472.00	738,720,000	0.79
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	317,500	2,665.50	846,296,250	2,291.50	727,551,250	0.77
23	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	316,500	2,433.00	770,044,500	2,242.50	709,751,250	0.76
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	220,800	3,692.00	815,193,600	3,143.00	693,974,400	0.74
25	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	398,300	1,711.50	681,690,450	1,671.00	665,559,300	0.71
26	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	38,200	17,960.00	686,072,000	17,320.00	661,624,000	0.70
27	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	80,900	8,357.00	676,081,300	8,176.00	661,438,400	0.70
28	日本	株式	S M C	機械	14,400	43,000.00	619,200,000	45,750.00	658,800,000	0.70
29	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	46,700	13,375.00	624,612,500	13,820.00	645,394,000	0.69
30	日本	株式	ファナック	電気機器	43,700	17,625.00	770,212,500	14,655.00	640,423,500	0.68
投資比率：合計										32.77

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	13.71
	情報・通信業	9.34
	化学	7.29
	輸送用機器	7.05
	医薬品	6.33
	銀行業	4.99
	卸売業	4.80
	機械	4.74
	サービス業	4.73
	小売業	4.63
	陸運業	4.35
	食料品	4.07
	建設業	2.61
	精密機器	2.48
	その他製品	2.39
	保険業	2.13
	不動産業	2.08
	電気・ガス業	1.72
	その他金融業	1.08
	証券、商品先物取引業	0.76
	ガラス・土石製品	0.73
	ゴム製品	0.63
	非鉄金属	0.63
鉄鋼	0.57	
金属製品	0.53	
繊維製品	0.52	

石油・石炭製品	0.45
空運業	0.39
パルプ・紙	0.27
鉱業	0.19
倉庫・運輸関連業	0.17
海運業	0.13
水産・農林業	0.10
合 計	96.59

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先 物取引	TOPIX(先物) (2020年6月限)	大阪取引所	買建	224	3,166,660,340	3,142,720,000	3.35

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として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。

<参考情報>

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）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2020年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	国債証 券	第135回利付国 債(5年)	0.100	2023/03/20	1,900,000,000	101.10	1,920,938,000	100.74	1,914,155,000	1.24
2	日本	国債証 券	第129回利付国 債(5年)	0.100	2021/09/20	1,750,000,000	100.51	1,758,925,000	100.34	1,756,055,000	1.13
3	日本	国債証 券	第9回利付国債 (40年)	0.400	2056/03/20	1,730,000,000	101.43	1,754,739,000	99.06	1,713,824,500	1.11
4	日本	国債証 券	第136回利付国 債(5年)	0.100	2023/06/20	1,700,000,000	101.19	1,720,298,000	100.77	1,713,192,000	1.11
5	日本	国債証 券	第137回利付国 債(5年)	0.100	2023/09/20	1,550,000,000	101.25	1,569,375,000	100.80	1,562,431,000	1.01
6	日本	国債証 券	第351回利付国 債(10年)	0.100	2028/06/20	1,500,000,000	102.70	1,540,530,000	101.57	1,523,595,000	0.98
7	日本	国債証 券	第340回利付国 債(10年)	0.400	2025/09/20	1,480,000,000	103.68	1,534,493,600	102.92	1,523,216,000	0.98
8	日本	国債証 券	第353回利付国 債(10年)	0.100	2028/12/20	1,500,000,000	102.54	1,538,205,000	101.40	1,521,030,000	0.98
9	日本	国債証 券	第134回利付国 債(5年)	0.100	2022/12/20	1,500,000,000	101.01	1,515,180,000	100.68	1,510,230,000	0.98
10	日本	国債証 券	第133回利付国 債(5年)	0.100	2022/09/20	1,500,000,000	100.92	1,513,815,000	100.62	1,509,300,000	0.98
11	日本	国債証 券	第132回利付国 債(5年)	0.100	2022/06/20	1,500,000,000	100.81	1,512,255,000	100.54	1,508,175,000	0.97
12	日本	国債証 券	第341回利付国 債(10年)	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	103.29	1,342,796,000	102.47	1,332,214,000	0.86
13	日本	国債証 券	第140回利付国 債(5年)	0.100	2024/06/20	1,300,000,000	101.49	1,319,435,000	100.93	1,312,116,000	0.85

14	日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	0.100	2027/12/20	1,260,000,000	102.74	1,294,524,000	101.75	1,282,100,400	0.83
15	日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	0.100	2026/09/20	1,200,000,000	102.39	1,228,752,000	101.50	1,218,012,000	0.79
16	日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	0.100	2026/06/20	1,200,000,000	102.30	1,227,624,000	101.41	1,216,920,000	0.79
17	日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	0.100	2024/03/20	1,200,000,000	101.42	1,217,040,000	100.87	1,210,512,000	0.78
18	日本	国債証券	第130回利付国債（5年）	0.100	2021/12/20	1,200,000,000	100.62	1,207,548,000	100.40	1,204,860,000	0.78
19	日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	0.100	2028/09/20	1,160,000,000	102.60	1,190,241,200	101.49	1,177,295,600	0.76
20	日本	国債証券	第131回利付国債（5年）	0.100	2022/03/20	1,100,000,000	100.72	1,107,997,000	100.47	1,105,203,000	0.71
21	日本	国債証券	第154回利付国債（20年）	1.200	2035/09/20	940,000,000	116.74	1,097,403,000	113.98	1,071,412,000	0.69
22	日本	国債証券	第336回利付国債（10年）	0.500	2024/12/20	1,000,000,000	103.66	1,036,620,000	102.99	1,029,920,000	0.67
23	日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	0.300	2024/12/20	1,000,000,000	102.66	1,026,670,000	102.01	1,020,180,000	0.66
24	日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	0.100	2028/03/20	1,000,000,000	102.74	1,027,400,000	101.64	1,016,470,000	0.66
25	日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	0.100	2026/12/20	1,000,000,000	102.48	1,024,880,000	101.59	1,015,930,000	0.66
26	日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	0.100	2029/03/20	1,000,000,000	102.43	1,024,310,000	101.25	1,012,590,000	0.65
27	日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	0.100	2029/09/20	1,000,000,000	102.22	1,022,215,000	100.99	1,009,940,000	0.65
28	日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	0.100	2029/12/20	1,000,000,000	102.12	1,021,290,000	100.87	1,008,730,000	0.65
29	日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	0.100	2021/06/20	1,000,000,000	100.41	1,004,140,000	100.28	1,002,800,000	0.65
30	日本	国債証券	第153回利付国債（20年）	1.300	2035/06/20	850,000,000	118.07	1,003,612,000	115.30	980,126,500	0.63
										投資比率：合計	25.19

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		81.05
特殊債券		8.60
地方債証券		6.16
社債券		3.04
合計		98.85

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2020年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	247,232	16,474.68	4,073,069,420	17,437.83	4,311,189,809	3.44
2	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	151,567	29,084.81	4,408,298,534	27,730.97	4,203,100,278	3.35
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	14,388	195,981.06	2,819,775,548	213,736.67	3,075,243,330	2.45
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	82,052	21,944.48	1,800,588,571	18,060.33	1,481,886,894	1.18
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	10,581	142,018.79	1,502,700,888	124,808.42	1,320,597,898	1.05
6	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	89,725	14,963.03	1,342,558,467	14,475.47	1,298,812,290	1.04
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	10,212	141,924.11	1,449,329,059	124,752.91	1,273,976,791	1.02
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	101,485	11,764.78	1,193,949,023	11,298.35	1,146,613,861	0.91
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	106,990	14,339.44	1,534,176,771	10,175.60	1,088,687,978	0.87
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	85,039	13,283.78	1,129,640,200	12,515.44	1,064,301,352	0.85
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	58,395	20,080.22	1,172,584,639	18,018.98	1,052,218,518	0.84
12	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	148,328	6,317.58	937,074,228	6,038.97	895,749,335	0.71
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	44,834	23,975.24	1,074,906,313	19,935.47	893,787,283	0.71
14	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	32,291	30,458.25	983,527,418	27,346.80	883,055,596	0.70
15	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	30,614	31,803.39	973,629,009	27,561.19	843,758,500	0.67
16	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	140,984	6,555.91	924,279,712	5,960.61	840,351,923	0.67
17	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	23,954	34,891.32	835,786,727	34,959.24	837,413,826	0.67
18	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	249,083	4,068.06	1,013,285,934	3,289.93	819,465,858	0.65
19	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	37,139	23,998.10	891,265,558	21,341.56	792,604,308	0.63
20	アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	86,760	9,487.79	823,161,475	8,374.46	726,568,887	0.58
21	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	291,287	3,626.21	1,056,269,463	2,398.61	698,684,843	0.56
22	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	138,807	5,811.52	806,679,934	4,897.34	679,786,461	0.54
23	アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	188,688	4,192.13	791,004,927	3,555.47	670,875,674	0.54
24	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア・娯楽	61,464	16,496.45	1,013,937,888	10,861.23	667,574,886	0.53
25	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	47,536	14,782.37	702,695,163	13,655.98	649,151,064	0.52
26	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	73,229	10,422.11	763,200,883	8,807.73	644,981,846	0.51

27	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	144,582	4,931.08	712,946,464	4,388.02	634,429,517	0.51
28	アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	48,516	12,960.56	628,794,756	12,536.12	608,202,771	0.49
29	アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	14,907	34,244.44	510,481,983	40,371.57	601,819,095	0.48
30	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	154,712	4,804.84	743,367,102	3,862.37	597,556,024	0.48
									投資比率：合計	28.15

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 2020年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	ソフトウェア・サービス	10.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
	資本財	5.98
	メディア・娯楽	5.97
	銀行	5.85
	ヘルスケア機器・サービス	5.09
	小売	5.07
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.85
	食品・飲料・タバコ	4.84
	各種金融	4.07
	公益事業	3.82
	素材	3.80
	半導体・半導体製造装置	3.50
	エネルギー	3.34
	保険	3.30
	電気通信サービス	2.31
	家庭用品・パーソナル用品	2.25
	運輸	1.76
	耐久消費財・アパレル	1.72
	食品・生活必需品小売り	1.63
消費者サービス	1.41	
商業・専門サービス	1.18	
自動車・自動車部品	0.90	
不動産	0.48	
	小計	92.85
投資証券		2.58
合計		95.43

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

(注2) 2020年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	339	41,413,840.98	44,259,840.00	4,816,798,387	3.84
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	233	5,884,618.54	6,323,620.00	755,988,771	0.60
	FTSE100INDEX	インターコンチネンタル取引所	買建	イギリス・ポンド	54	2,859,589.76	2,999,430.00	399,884,007	0.32
	FSMI INDEX	ユーレックス・チューリッヒ取引所	買建	スイス・フラン	28	2,346,120.18	2,508,520.00	283,989,549	0.23
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	20	3,026,201.73	3,169,600.00	242,791,360	0.19
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	21	2,656,232.00	2,725,275.00	180,113,424	0.14

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（2020年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として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。

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2020年3月31日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/11/30	9,300,000	11,057.21	1,028,321,403	11,382.51	1,058,573,682	0.74
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	8,500,000	11,368.48	966,321,128	11,842.91	1,006,647,736	0.71
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2027/02/15	8,200,000	11,545.19	946,706,218	12,144.74	995,869,320	0.70
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/03/31	8,500,000	11,192.48	951,361,251	11,656.71	990,820,628	0.70
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2021/06/15	8,650,000	11,040.71	955,022,150	11,210.34	969,694,424	0.68
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2021/06/30	8,500,000	10,828.58	920,429,725	11,021.58	936,835,001	0.66
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2026/08/15	8,000,000	10,901.06	872,085,397	11,548.73	923,898,685	0.65
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2026/11/15	7,600,000	11,234.57	853,827,467	11,923.26	906,167,895	0.64
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/05/31	8,100,000	10,950.16	886,963,653	11,121.06	900,806,315	0.63
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/08/15	8,000,000	10,984.60	878,768,242	11,173.35	893,868,405	0.63
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	12,091.60	870,595,788	12,260.80	882,777,943	0.62
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/02/15	7,700,000	11,005.49	847,423,499	11,246.90	866,011,324	0.61
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2021/10/31	7,700,000	10,844.31	835,012,201	11,061.54	851,739,289	0.60

14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2021/05/15	7,500,000	11,097.25	832,294,429	11,257.10	844,282,734	0.59
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/31	7,500,000	10,962.92	822,219,151	11,239.24	842,943,619	0.59
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	7,200,000	10,980.35	790,585,330	11,613.35	836,161,298	0.59
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/09/30	7,200,000	10,994.38	791,595,413	11,195.46	806,073,202	0.57
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	6,700,000	11,380.81	762,514,419	12,016.36	805,096,278	0.56
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/08/31	6,900,000	10,939.54	754,828,297	11,239.24	775,508,129	0.54
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2024/08/15	6,500,000	11,337.45	736,934,265	11,835.68	769,319,693	0.54
21	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.250	2021/10/25	5,900,000	12,736.61	751,460,456	12,689.77	748,696,914	0.53
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2024/11/15	6,200,000	11,297.94	700,472,645	11,817.40	732,679,272	0.51
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2028/11/15	5,500,000	12,280.60	675,433,244	13,154.40	723,492,063	0.51
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	6,000,000	11,263.05	675,783,289	11,824.20	709,452,570	0.50
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2029/05/15	5,600,000	11,640.98	651,895,102	12,537.55	702,103,141	0.49
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2022/12/31	6,000,000	11,102.36	666,141,628	11,435.22	686,113,635	0.48
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/09/30	5,800,000	11,227.34	651,186,000	11,738.33	680,823,475	0.48
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2023/05/15	5,800,000	11,002.03	638,117,903	11,372.30	659,593,974	0.46
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2022/03/15	5,800,000	11,093.04	643,396,430	11,342.55	657,867,994	0.46
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2029/08/15	5,500,000	10,937.41	601,557,825	11,838.66	651,126,489	0.46
										投資比率：合計	17.43

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 2020年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券	-	99.01
合計		99.01

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

(注2) 2020年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2020年3月31日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの 純資産額（円）	
第1期	(2013年 2月20日)	分配付：	213,198,476	分配付：	1.0667
		分配落：	213,198,476	分配落：	1.0667
第2期	(2014年 2月20日)	分配付：	1,623,142,054	分配付：	1.1583
		分配落：	1,616,135,543	分配落：	1.1533
第3期	(2015年 2月20日)	分配付：	1,749,455,838	分配付：	1.2424
		分配落：	1,726,925,712	分配落：	1.2264
第4期	(2016年 2月22日)	分配付：	2,799,520,026	分配付：	1.1999
		分配落：	2,783,188,603	分配落：	1.1929
第5期	(2017年 2月20日)	分配付：	3,353,263,422	分配付：	1.2368
		分配落：	3,315,305,934	分配落：	1.2228
第6期	(2018年 2月20日)	分配付：	4,218,203,352	分配付：	1.2495
		分配落：	4,167,563,611	分配落：	1.2345
第7期	(2019年 2月20日)	分配付：	4,251,424,588	分配付：	1.2434
		分配落：	4,213,813,566	分配落：	1.2324
第8期	(2020年 2月20日)	分配付：	4,636,953,719	分配付：	1.2790
		分配落：	4,582,572,120	分配落：	1.2640
2019年 3月末日			4,279,855,446		1.2420
4月末日			4,274,648,722		1.2422
5月末日			4,242,072,400		1.2311
6月末日			4,293,421,683		1.2437
7月末日			4,503,721,784		1.2471
8月末日			4,516,333,151		1.2496
9月末日			4,529,968,207		1.2531
10月末日			4,564,548,309		1.2620
11月末日			4,566,539,246		1.2638
12月末日			4,578,324,383		1.2673
2020年 1月末日			4,599,649,970		1.2709
2月末日			4,590,110,933		1.2532
3月末日			4,514,229,674		1.2328

【分配の推移】

計算期間	一口当たりの分配金
第1期 自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	0.0000円
第2期 自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	0.0050円
第3期 自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	0.0160円
第4期 自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	0.0070円
第5期 自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期 自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円
第7期 自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円

第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
-----	------------------------------	---------

【収益率の推移】

	計算期間	収益率
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	6.7%
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	8.6%
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	7.7%
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	2.2%
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983

(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

（参考情報）運用実績

（2020年3月31日現在）

基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。分配金再投資基準価額は税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

＜基準価額・純資産総額＞

基準価額	12,328円
純資産総額	4,514百万円

分配の推移

決算期	分配金
第4期（2016年2月22日）	70円
第5期（2017年2月20日）	140円
第6期（2018年2月20日）	150円
第7期（2019年2月20日）	110円
第8期（2020年2月20日）	150円
設定来累計	830円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	41.33%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2022/11/30	0.74%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.500%	2024/05/15	0.71%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.250%	2027/02/15	0.70%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	34.40%	第135回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2023/03/20	1.24%
		第129回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2021/09/20	1.13%
		第9回利付国債(40年)	日本	国債証券	—	0.400%	2056/03/20	1.11%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	4.78%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.55%
		ソニー	日本	株式	電気機器	—	—	1.99%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	—	—	1.65%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	4.33%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	3.44%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	—	—	3.35%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	2.45%

※各マザーファンドの投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する各マザーファンドの評価金額の比率であり、投資銘柄(上位3銘柄)の投資比率は、各マザーファンド純資産総額に対する各投資銘柄の評価金額の比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※ベンチマークは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、組入れマザーファンドの各ベンチマークのリターンを合成したAMCリスクバジェット型資産配分モデル指数です。

※2012年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定日から年末までで算出しています。

※2020年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から3月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

※基準価額と同一基準のデータを取得できないため、設定時以前のベンチマークの収益率は記載していません。

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。なお、確定拠出年金制度のご利用による取得申込みの場合は、確定拠出年金制度にかかる手続き必要となります。
- 2) 当ファンドには「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については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。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます
- 4) 申込単位（購入単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の取得申込みには、制限を設けることがあります。
- 5) 取得申込価額（購入価額）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。基準価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 6) 取得申込代金（購入代金）は、購入価額に取得申込の口数を乗じて得た金額に申込手数料（購入時手数料）および当該手数料に係る消費税等相当額を加えた金額です。
- 7) 購入代金は販売会社が定める期日までにお支払いください。
- 8) 購入時手数料は前記「4 手数料及び税金（1）申込手数料」をご参照ください。
- 9) 購入申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 10) 取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（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、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の取得申込の受付けを取り消すことがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の換金申込みには、制限を設けることがあります。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会

方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。

- 5) 信託財産留保額は、上記4)の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額とします。
上記金額は1口当たりの金額です。換金口数に応じてご負担いただきます。
- 6) 換金代金（換金価額に換金する口数を乗じて得た金額）は、原則として換金申込受付日から起算して5営業日目以降にお支払いします。
- 7) 換金申込不可日は、原則として、米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツ両国の取引所または銀行の休業日に該当する日です。
- 8) 取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（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、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の換金申込の受付を中止することおよび既に受けた受益権の換金申込の受け取りを中止することがあります。
- 9) 換金申込みを行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して、当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

1）基準価額の算出方法

基準価額とは、算出日において、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公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法*により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」）を、算出日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

* 一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。ただし、上場している場合は、原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値） 証券会社、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。

外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の終値等で評価します。

2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は無期限ですが、後記(5)の1)2)3)5)の理由により信託は終了します。

(4) 【計算期間】

1) 当ファンドの計算期間は、毎年2月21日から翌年2月20日までとすることを原則とします。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上記1)の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のときは、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、後記(5)の1)2)3)5)に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

1) 信託契約の解約

(a) 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b) 株式会社トータルアセットデザインがベンチマークである「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」の算出および提供をしないこととなった場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させるものとします。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(c) 委託会社は、上記(a)の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る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發します。

(d) 上記(c)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(d)において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- (e) 上記(c)の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います。
- (f) 上記(c)から上記(e)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係る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には適用しません。また、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あって、上記(c)から上記(e)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。
- 2) 信託契約に関する監督官庁の命令
- (a) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- (b) 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、後記6)の規定にしたがいます。
- 3) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- (a) 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は、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (b) 上記(a)の規定にかかわらず、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投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、後記6)の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- 4) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い
- (a) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- (b) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
- 5) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- (a) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記6)の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- (b) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 6) 信託約款の変更等
- (a) 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、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本6)に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- (b) 委託会社は、上記(a)の事項(信託約款の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、

当ファンドに係る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發します。

- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(c)において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行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います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係る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には適用しません。
- (g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が前記「2 換金（解約）手続等」に規定する一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、上記1)に規定する投資信託の解約または上記6)に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

8) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

- (a) 交付運用報告書は、知っている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。
- (b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（www.ssga.com/jp）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

9) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

委託会社と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」（別の名称で同様の権利義務を規定する契約を含みます。）は、契約期間満了3ヶ月前までに、別段の意思表示のない限り、原則として1年毎に自動的に更新されるものとします。

4 【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次の通りです。

分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を

除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としません。) に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、自動けいぞく投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としません。) に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの信託契約の解約または重大な約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを使用することができます。

帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写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）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2019年2月21日から2020年2月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (2019年 2月20日現在)	第8期 (2020年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,119,066	1,752,015
コール・ローン	643,159,407	714,877,190
親投資信託受益証券	3,620,626,218	3,876,459,431
未収入金	-	63,000,000
流動資産合計	4,268,904,691	4,656,088,636
資産合計		
	4,268,904,691	4,656,088,636
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,611,022	54,381,599
未払解約金	402	12,697
未払受託者報酬	1,149,832	1,257,910
未払委託者報酬	16,097,634	17,610,661
未払利息	1,640	1,973
その他未払費用	230,595	251,676
流動負債合計	55,091,125	73,516,516
負債合計		
	55,091,125	73,516,516
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,419,183,841	1 3,625,439,983
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	794,629,725	957,132,137
(分配準備積立金)	151,281,087	252,048,259
元本等合計	4,213,813,566	4,582,572,120
純資産合計	4,213,813,566	4,582,572,120
負債純資産合計	4,268,904,691	4,656,088,636

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 2018年 2月21日 至 2019年 2月20日	第8期 自 2019年 2月21日 至 2020年 2月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	65,813,953	204,033,213
営業収益合計	65,813,953	204,033,213
営業費用		
支払利息	527,205	642,813
受託者報酬	2,284,230	2,410,833
委託者報酬	31,979,077	33,751,482
その他費用	525,831	493,489
営業費用合計	35,316,343	37,298,617
営業利益又は営業損失（ ）	30,497,610	166,734,596
経常利益又は経常損失（ ）	30,497,610	166,734,596
当期純利益又は当期純損失（ ）	30,497,610	166,734,596
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（ ）	148,538	1,104,368
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	791,580,845	794,629,725
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,346,064	66,494,091
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,346,064	66,494,091
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,035,234	15,240,308
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,035,234	15,240,308
分配金	1 37,611,022	1 54,381,599
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	794,629,725	957,132,137

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第7期 (2019年 2月20日現在)	第8期 (2020年 2月20日現在)
1 期首元本額	3,375,982,766円	3,419,183,841円
期中追加設定元本額	128,819,369円	271,844,830円
期中一部解約元本額	85,618,294円	65,588,688円
2 受益権の総数	3,419,183,841口	3,625,439,983口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期 自 2018年 2月21日 至 2019年 2月20日	第8期 自 2019年 2月21日 至 2020年 2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(38,219,162円)、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)、収益調整金(643,348,638円)及び分配準備積立金(150,672,947円)より分配対象収益は832,240,747円(1万口当たり2,434円)であり、うち37,611,022円(1万口当たり110円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(57,990,427円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(99,914,483円)、収益調整金(705,083,878円)及び分配準備積立金(148,524,948円)より分配対象収益は1,011,513,736円(1万口当たり2,790円)であり、うち54,381,599円(1万口当たり150円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第7期 (2019年 2月20日現在)	第8期 (2020年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、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、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 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

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

	第7期 (2019年 2月20日現在)	第8期 (2020年 2月20日現在)
--	------------------------	------------------------

種 類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	60,413,768	187,249,744
合計	60,413,768	187,249,744

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第7期 (2019年 2月20日現在)	第8期 (2020年 2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2324円 (12,324円)	1.2640円 (12,640円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	75,976,909	240,580,882	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	763,843,839	1,859,806,979	
	日本株式インデックス・マザーファンド	78,934,572	222,721,788	
	日本債券インデックス・マザーファンド	1,193,048,988	1,553,349,782	
合計		2,111,804,308	3,876,459,431	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

<参考>

当ファンドは「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」及び「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		21,413,135	5,512,468
コール・ローン		2,690,346,033	2,249,260,101
株式		87,254,422,410	110,153,135,760
派生商品評価勘定		122,902,528	407,880
未収入金		36,000,000	56,065,000
未収配当金		141,135,756	198,374,640
前払金			76,040,000
差入委託証拠金		85,095,000	72,960,000
流動資産合計		90,351,314,862	112,811,755,849
資産合計		90,351,314,862	112,811,755,849
負債の部			
流動負債			
前受金		108,325,000	
派生商品評価勘定			66,668,200
未払解約金		19,940,000	1,520,000
未払利息		6,862	6,209
その他未払費用		3,070	2,118
流動負債合計		128,274,932	68,196,527
負債合計		128,274,932	68,196,527
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,028,428,491	39,957,438,054
剰余金			
剰余金又は欠損金()		56,194,611,439	72,786,121,268
元本等合計		90,223,039,930	112,743,559,322
純資産合計		90,223,039,930	112,743,559,322
負債純資産合計		90,351,314,862	112,811,755,849

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
---------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 期首元本額	41,667,325,452円	34,028,428,491円
期中追加設定元本額	10,521,493,768円	16,615,151,052円
期中一部解約元本額	18,160,390,729円	10,686,141,489円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン(ステイブル)	81,664,824円	78,934,572円
日本株式インデックス・ファンド(年金1) < 適格機関投資家限定 >	856,940,904円	1,043,143,411円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	4,365,158円	2,410,204円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	141,670,799円	78,349,730円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	121,013円	113,663円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	4,426,507円	4,296,283円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	11,202,501円	8,286,777円
バランスファンドVA50B < 適格機関投資家限定 >	7,241,529,595円	6,359,391,050円
日本株式インデックス・ファンドVA1 < 適格機関投資家限定 >	426,392,515円	351,598,400円
バランスファンドVA50C < 適格機関投資家限定 >	6,648,845円	5,395,183円
バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	1,271,582,169円	1,034,208,209円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	802,871,113円	698,343,954円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	56,116,211円	53,601,698円
日本株式インデックス・ファンドM < 適格機関投資家限定 >	950,217,271円	209,506,257円
日本株式インデックス・ファンドS < 適格機関投資家限定 >	7,344,621,937円	14,021,767,576円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	58,645,273円	202,362,083円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	731,722,264円	2,197,395,012円

4資産バランス30VA<適格機関投資家 限定>	199,034,584円	385,628,566円
バランスファンドVA35A<適格機関投 資家限定>	2,093,887,155円	1,711,718,779円
バランスファンドVA40C<適格機関投 資家限定>	62,460,294円	52,946,881円
世界4資産バランスVA45<適格 機関投資家限定>	162,484,745円	円
日本株式インデックス・ファンドF OF<適格機関投資家限定>	4,801,801,587円	4,582,230,110円
グローバル4資産30VA<適格機 関投資家限定>	17,668,545円	16,719,154円
グローバル4資産45VA<適格機 関投資家限定>	19,453,793円	17,890,351円
4資産バランス30VA2<適格機関 投資家限定>	8,090,499円	10,382,223円
バランスファンドVA25B<適格 機関投資家限定>	580,693,532円	481,080,971円
バランスファンドVA20A<適格 機関投資家限定>	3,343,682円	2,315,027円
バランスファンドVA35B<適格 機関投資家限定>	3,384,173円	3,110,323円
バランスファンドVA10A<適格 機関投資家限定>	38,762,912円	円
日本株式インデックス・ファンドV A2<適格機関投資家限定>	1,339,409,071円	1,543,140,525円
4資産インデックスバランスVA2 0<適格機関投資家限定>	367,591,206円	319,559,278円
世界分散ファンドVA25A<適格 機関投資家限定>	1,683,985,611円	1,409,047,064円
Tadリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド(ステイブル)年金 <適格機関投資家限定>	87,285,437円	82,260,796円
フレックス資産配分戦略ファンド< 適格機関投資家限定>	158,424,927円	210,197,995円
Tadリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド(ステイブル)<適 格機関投資家限定>	77,152,734円	72,629,322円
ステート・ストリート日本株式イン デックス・オープン	1,995,324,541円	2,430,319,428円
グローバルバランス40VA<適格 機関投資家限定>	1,039,453円	564,205円
グローバルバランス40VA2<適 格機関投資家限定>	286,917,026円	249,059,389円
グローバルバランス40VA3<適 格機関投資家限定>	23,221,746円	20,669,489円
グローバルバランス50VA<適格 機関投資家限定>	7,279,937円	6,864,116円
ワールドバランスVA0902<適 格機関投資家限定>	18,992,402円	円
計	34,028,428,491円	39,957,438,054円

2 受益権の総数	34,028,428,491口	39,957,438,054口
----------	-----------------	-----------------

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、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、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>同左</p>

<p>3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p> <p>同左</p>
----------------------------------	---	---

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,320,140,469	2,101,286,772
合計	4,320,140,469	2,101,286,772

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2019年 2月20日現在)			
		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 TOPIX(先物)	2,929,325,000		3,052,350,000	123,025,000
	合 計	2,929,325,000		3,052,350,000	123,025,000

(単位：円)

	(2020年 2月20日現在)
--	-----------------

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 TOPIX(先物)	2,616,720,000		2,550,560,000	66,160,000
	合 計	2,616,720,000		2,550,560,000	66,160,000

(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、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。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6514円 (26,514円)	2.8216円 (28,216円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

銘 柄	株 数	評 価 額		備 考
		単 価 (円)	金 額 (円)	
いすゞ自動車	135,200	1,137.00	153,722,400	
極洋	2,200	2,800.00	6,160,000	
日本水産	63,200	610.00	38,552,000	
マルハニチロ	9,100	2,565.00	23,341,500	
ハウスイ	600	868.00	520,800	
カネコ種苗	2,200	1,325.00	2,915,000	
サカタのタネ	7,500	3,335.00	25,012,500	
ホクト	4,800	1,974.00	9,475,200	
ホクリヨウ	700	763.00	534,100	
ヒノキヤグループ	1,500	2,038.00	3,057,000	
ショーボンドホールディングス	9,900	4,235.00	41,926,500	
ミライト・ホールディングス	18,800	1,510.00	28,388,000	
タマホーム	3,400	1,415.00	4,811,000	
サンヨーホームズ	600	743.00	445,800	
日本アクア	2,500	611.00	1,527,500	
ファーストコーポレーション	1,700	595.00	1,011,500	
ベステラ	1,100	1,110.00	1,221,000	
TATERU	12,500	190.00	2,375,000	
キャンディル	600	664.00	398,400	
スペースバリューホールディングス	8,600	533.00	4,583,800	
住石ホールディングス	11,700	143.00	1,673,100	

日鉄鉱業	1,400	4,230.00	5,922,000
三井松島ホールディングス	2,300	1,120.00	2,576,000
国際石油開発帝石	254,300	1,072.00	272,609,600
石油資源開発	8,200	2,798.00	22,943,600
K & Oエナジーグループ	3,400	1,646.00	5,596,400
ダイセキ環境ソリューション	1,200	991.00	1,189,200
第一カッター興業	800	1,909.00	1,527,200
明豊ファシリティワークス	1,700	749.00	1,273,300
安藤・間	37,600	856.00	32,185,600
東急建設	18,400	749.00	13,781,600
コムシスホールディングス	22,400	2,919.00	65,385,600
ピーアールホールディングス	7,800	492.00	3,837,600
高松コンストラクショングループ	3,900	2,594.00	10,116,600
東建コーポレーション	1,900	8,200.00	15,580,000
ソネック	700	755.00	528,500
ヤマウラ	2,600	939.00	2,441,400
大成建設	48,800	4,070.00	198,616,000
大林組	146,300	1,229.00	179,802,700
清水建設	148,500	1,082.00	160,677,000
飛鳥建設	4,600	1,353.00	6,223,800
長谷工コーポレーション	56,600	1,416.00	80,145,600
松井建設	6,400	714.00	4,569,600
銭高組	600	3,960.00	2,376,000
鹿島建設	114,900	1,278.00	146,842,200
不動テトラ	3,800	1,641.00	6,235,800
大末建設	1,600	952.00	1,523,200
鉄建建設	3,100	2,655.00	8,230,500
西松建設	11,200	2,425.00	27,160,000
三井住友建設	35,200	610.00	21,472,000
大豊建設	3,200	2,627.00	8,406,400
前田建設工業	36,600	1,067.00	39,052,200
佐田建設	2,600	392.00	1,019,200
ナカノフドー建設	3,500	452.00	1,582,000
奥村組	7,900	2,829.00	22,349,100
東鉄工業	6,200	3,070.00	19,034,000
イチケン	1,200	1,691.00	2,029,200
富士ピー・エス	2,200	519.00	1,141,800
浅沼組	1,600	5,150.00	8,240,000
戸田建設	60,600	712.00	43,147,200
熊谷組	6,700	3,190.00	21,373,000
北野建設	900	2,510.00	2,259,000
植木組	800	2,494.00	1,995,200
矢作建設工業	7,200	835.00	6,012,000
ピーエス三菱	4,900	656.00	3,214,400
日本ハウスホールディングス	11,100	442.00	4,906,200
大東建託	17,500	12,420.00	217,350,000
新日本建設	6,900	860.00	5,934,000
N I P P O	12,100	2,680.00	32,428,000
東亜道路工業	900	3,360.00	3,024,000

前田道路	15,500	3,400.00	52,700,000
日本道路	1,400	7,160.00	10,024,000
東亜建設工業	4,500	1,765.00	7,942,500
日本国土開発	9,500	591.00	5,614,500
若築建設	2,900	1,599.00	4,637,100
東洋建設	16,200	502.00	8,132,400
五洋建設	57,900	658.00	38,098,200
世紀東急工業	6,900	883.00	6,092,700
福田組	1,700	4,415.00	7,505,500
日本ドライケミカル	1,100	1,769.00	1,945,900
住友林業	37,000	1,720.00	63,640,000
日本基礎技術	5,200	363.00	1,887,600
巴コーポレーション	7,300	373.00	2,722,900
大和ハウス工業	144,800	3,300.00	477,840,000
ライト工業	8,300	1,465.00	12,159,500
積水ハウス	160,100	2,317.50	371,031,750
日特建設	4,300	844.00	3,629,200
北陸電気工事	2,900	1,069.00	3,100,100
ユアテック	9,300	637.00	5,924,100
四電工	900	2,580.00	2,322,000
中電工	5,900	2,441.00	14,401,900
関電工	20,700	1,003.00	20,762,100
きんでん	34,700	1,793.00	62,217,100
東京エネシス	5,400	836.00	4,514,400
トーエネック	1,600	3,630.00	5,808,000
住友電設	4,100	2,461.00	10,090,100
日本電設工業	8,000	2,224.00	17,792,000
協和エクシオ	22,200	2,629.00	58,363,800
新日本空調	3,800	1,979.00	7,520,200
日本工営	3,000	3,320.00	9,960,000
九電工	10,200	3,130.00	31,926,000
三機工業	10,500	1,369.00	14,374,500
日揮ホールディングス	45,000	1,551.00	69,795,000
中外炉工業	1,800	1,700.00	3,060,000
ヤマト	5,300	726.00	3,847,800
太平電業	3,500	2,533.00	8,865,500
高砂熱学工業	12,700	1,860.00	23,622,000
三晃金属工業	500	2,607.00	1,303,500
NECネットエスアイ	4,300	4,220.00	18,146,000
朝日工業社	1,100	3,135.00	3,448,500
明星工業	9,300	787.00	7,319,100
大気社	7,100	3,440.00	24,424,000
ダイダン	3,500	2,735.00	9,572,500
日比谷総合設備	4,700	1,914.00	8,995,800
日本製粉	13,600	1,649.00	22,426,400
日清製粉グループ本社	52,900	1,956.00	103,472,400
日東富士製粉	300	6,220.00	1,866,000
昭和産業	4,300	3,035.00	13,050,500
鳥越製粉	4,700	826.00	3,882,200

中部飼料	5,700	1,629.00	9,285,300
フィード・ワン	34,900	175.00	6,107,500
東洋精糖	900	1,188.00	1,069,200
日本甜菜製糖	2,700	1,847.00	4,986,900
三井製糖	4,100	2,082.00	8,536,200
塩水港精糖	3,900	226.00	881,400
日新製糖	2,500	2,008.00	5,020,000
L I F U L L	15,400	507.00	7,807,800
ジェイエイシーリクルートメント	3,300	1,615.00	5,329,500
日本M & Aセンター	33,700	3,680.00	124,016,000
メンバーズ	1,300	1,595.00	2,073,500
中広	500	540.00	270,000
U Tグループ	5,200	2,689.00	13,982,800
アイティメディア	1,400	1,124.00	1,573,600
タケエイ	4,700	1,014.00	4,765,800
E・Jホールディングス	500	1,656.00	828,000
ビーネックスグループ	5,400	981.00	5,297,400
コシダカホールディングス	10,700	1,493.00	15,975,100
アルトナー	600	860.00	516,000
パソナグループ	4,800	1,320.00	6,336,000
C D S	1,000	1,383.00	1,383,000
リンクアンドモチベーション	10,900	507.00	5,526,300
G C A	6,000	801.00	4,806,000
エス・エム・エス	13,800	2,349.00	32,416,200
サニーサイドアップグループ	800	910.00	728,000
パーソルホールディングス	44,600	1,743.00	77,737,800
リニカル	1,900	993.00	1,886,700
クックパッド	17,300	311.00	5,380,300
エスクリ	1,200	744.00	892,800
アイ・ケイ・ケイ	2,500	741.00	1,852,500
森永製菓	11,000	4,690.00	51,590,000
中村屋	1,300	4,015.00	5,219,500
江崎グリコ	13,900	4,710.00	65,469,000
名糖産業	2,500	1,390.00	3,475,000
井村屋グループ	2,200	1,900.00	4,180,000
不二家	2,600	2,316.00	6,021,600
山崎製パン	35,100	2,007.00	70,445,700
第一屋製パン	500	953.00	476,500
モロゾフ	900	4,920.00	4,428,000
亀田製菓	2,600	4,775.00	12,415,000
寿スピリッツ	4,500	6,290.00	28,305,000
カルビー	21,300	3,050.00	64,965,000
森永乳業	8,600	4,070.00	35,002,000
六甲バター	3,500	1,545.00	5,407,500
ヤクルト本社	32,200	5,390.00	173,558,000
明治ホールディングス	31,000	7,070.00	219,170,000
雪印メグミルク	11,200	2,470.00	27,664,000
プリマハム	7,300	2,487.00	18,155,100
日本ハム	17,900	4,660.00	83,414,000

林兼産業	1,200	687.00	824,400
丸大食品	4,900	2,001.00	9,804,900
S Foods	3,700	2,635.00	9,749,500
柿安本店	1,800	3,105.00	5,589,000
伊藤ハム米久ホールディングス	30,000	662.00	19,860,000
学情	1,800	2,017.00	3,630,600
スタジオアリス	2,500	1,831.00	4,577,500
クロスキャット	1,200	1,191.00	1,429,200
シミックホールディングス	2,800	1,600.00	4,480,000
エプコ	500	1,147.00	573,500
システナ	16,300	1,654.00	26,960,200
N J S	800	1,793.00	1,434,400
デジタルアーツ	2,200	5,470.00	12,034,000
日鉄ソリューションズ	6,800	3,335.00	22,678,000
総合警備保障	17,700	5,530.00	97,881,000
キューブシステム	2,800	730.00	2,044,000
いちご	58,300	396.00	23,086,800
エイジア	700	1,565.00	1,095,500
日本駐車場開発	49,700	146.00	7,256,200
コア	2,200	1,338.00	2,943,600
カカクコム	33,400	2,858.00	95,457,200
アイロムグループ	1,400	1,518.00	2,125,200
セントケア・ホールディング	2,900	459.00	1,331,100
サイネックス	400	696.00	278,400
ルネサンス	2,800	1,693.00	4,740,400
ディップ	6,300	3,240.00	20,412,000
S B Sホールディングス	4,000	1,816.00	7,264,000
オプトホールディング	2,700	1,939.00	5,235,300
新日本科学	4,800	675.00	3,240,000
ツクイ	10,300	647.00	6,664,100
キャリアデザインセンター	1,300	1,211.00	1,574,300
ベネフィット・ワン	12,100	1,961.00	23,728,100
エムスリー	98,300	3,065.00	301,289,500
ツカダ・グローバルホールディング	2,800	538.00	1,506,400
プラス	200	767.00	153,400
アウトソーシング	25,400	951.00	24,155,400
ウェルネット	4,800	666.00	3,196,800
ワールドホールディングス	1,400	1,953.00	2,734,200
ディー・エヌ・エー	21,800	1,573.00	34,291,400
博報堂D Yホールディングス	62,000	1,443.00	89,466,000
ぐるなび	7,600	845.00	6,422,000
タカミヤ	5,300	596.00	3,158,800
ジャパンベストレスキューシステム	3,400	860.00	2,924,000
ファンコミュニケーションズ	13,600	436.00	5,929,600
ライク	1,400	1,906.00	2,668,400
ビジネス・ブレークスルー	1,800	407.00	732,600
エスプール	8,500	807.00	6,859,500
W D Bホールディングス	2,000	2,638.00	5,276,000
ティア	2,300	600.00	1,380,000

C D G	400	1,410.00	564,000
バリューコマース	2,500	2,432.00	6,080,000
インフォマート	48,800	746.00	36,404,800
サッポロホールディングス	15,900	2,473.00	39,320,700
アサヒグループホールディングス	98,100	4,824.00	473,234,400
麒麟ホールディングス	198,700	2,266.50	450,353,550
宝ホールディングス	35,000	952.00	33,320,000
オエノンホールディングス	13,800	388.00	5,354,400
養命酒製造	1,600	1,931.00	3,089,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	32,900	2,937.00	96,627,300
サントリー食品インターナショナル	31,300	4,655.00	145,701,500
ダイドグループホールディングス	2,400	3,935.00	9,444,000
伊藤園	14,200	5,470.00	77,674,000
キーコーヒー	4,600	2,250.00	10,350,000
ユニカフェ	1,000	951.00	951,000
ジャパンフーズ	800	1,207.00	965,600
日清オイリオグループ	6,000	3,710.00	22,260,000
不二製油グループ本社	11,400	2,748.00	31,327,200
かどや製油	600	3,800.00	2,280,000
J - オイルミルズ	2,400	4,250.00	10,200,000
ローソン	11,600	6,220.00	72,152,000
サンエー	3,800	4,560.00	17,328,000
カワチ薬品	3,500	2,090.00	7,315,000
エービーシー・マート	7,200	6,770.00	48,744,000
ハードオフコーポレーション	1,700	800.00	1,360,000
高千穂交易	2,000	1,121.00	2,242,000
アスクル	4,800	3,365.00	16,152,000
ゲオホールディングス	8,200	1,225.00	10,045,000
アダストリア	6,300	2,106.00	13,267,800
ジーフット	3,200	613.00	1,961,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	660.00	528,000
伊藤忠食品	1,100	4,870.00	5,357,000
くら寿司	2,400	5,400.00	12,960,000
キャンドゥ	2,500	1,631.00	4,077,500
エレマテック	4,800	983.00	4,718,400
バルグループホールディングス	2,300	3,430.00	7,889,000
J A L U X	1,500	2,266.00	3,399,000
エディオン	21,000	1,012.00	21,252,000
あらた	3,600	4,545.00	16,362,000
サーラコーポレーション	10,300	605.00	6,231,500
ワッツ	2,400	608.00	1,459,200
トーマンデバイス	700	3,970.00	2,779,000
ハローズ	1,900	2,734.00	5,194,600
J Pホールディングス	15,600	309.00	4,820,400
フジオフードシステム	4,200	1,663.00	6,984,600
あみやき亭	1,100	3,415.00	3,756,500
東京エレクトロン デバイス	1,900	2,780.00	5,282,000
ひらまつ	7,900	243.00	1,919,700
フィールズ	3,500	476.00	1,666,000

双日	253,600	342.00	86,731,200
アルフレッサ ホールディングス	51,000	2,180.00	111,180,000
大黒天物産	1,200	3,335.00	4,002,000
ハニーズホールディングス	4,500	1,342.00	6,039,000
ファーマライズホールディングス	800	652.00	521,600
キッコーマン	33,700	5,880.00	198,156,000
味の素	103,400	1,987.00	205,455,800
キューピー	26,000	2,152.00	55,952,000
ハウス食品グループ本社	17,500	3,440.00	60,200,000
カゴメ	17,700	2,664.00	47,152,800
焼津水産化学工業	2,600	1,012.00	2,631,200
アリアケジャパン	4,300	7,500.00	32,250,000
ピエトロ	500	1,641.00	820,500
エバラ食品工業	1,300	2,180.00	2,834,000
やまみ	200	2,249.00	449,800
ニチレイ	22,300	2,795.00	62,328,500
横浜冷凍	12,800	937.00	11,993,600
東洋水産	24,100	4,555.00	109,775,500
イートアンド	1,800	1,839.00	3,310,200
大冷	700	1,952.00	1,366,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,500	1,143.00	2,857,500
日清食品ホールディングス	19,900	8,900.00	177,110,000
永谷園ホールディングス	2,500	2,121.00	5,302,500
一正蒲鉾	1,700	951.00	1,616,700
フジッコ	5,000	1,884.00	9,420,000
ロック・フィールド	5,000	1,417.00	7,085,000
日本たばこ産業	270,500	2,267.00	613,223,500
ケンコーマヨネーズ	2,600	2,212.00	5,751,200
わらべや日洋ホールディングス	3,000	1,835.00	5,505,000
なとり	2,900	1,694.00	4,912,600
イフジ産業	700	844.00	590,800
ピクルスコーポレーション	1,000	2,604.00	2,604,000
北の達人コーポレーション	16,200	628.00	10,173,600
ユーグレナ	19,900	824.00	16,397,600
スター・マイカ・ホールディングス	2,700	1,613.00	4,355,100
片倉工業	6,500	1,332.00	8,658,000
ゲンゼ	3,300	4,135.00	13,645,500
ヒューリック	98,200	1,319.00	129,525,800
神栄	400	743.00	297,200
ラサ商事	2,300	903.00	2,076,900
アルペン	3,500	1,900.00	6,650,000
ハブ	1,300	1,010.00	1,313,000
ラクーンホールディングス	2,400	875.00	2,100,000
クオールホールディングス	6,700	1,388.00	9,299,600
アルコニックス	4,800	1,237.00	5,937,600
神戸物産	15,800	4,460.00	70,468,000
ソリトンシステムズ	2,300	1,178.00	2,709,400
ジンズホールディングス	2,400	7,410.00	17,784,000
ビックカメラ	27,200	1,080.00	29,376,000

D C Mホールディングス	24,700	1,044.00	25,786,800
ペッパーフードサービス	4,100	869.00	3,562,900
M o n o t a R O	32,700	2,635.00	86,164,500
東京一番フーズ	700	608.00	425,600
D Dホールディングス	2,100	1,684.00	3,536,400
あい ホールディングス	6,500	1,731.00	11,251,500
ディーブイエックス	1,200	918.00	1,101,600
きちりホールディングス	1,200	713.00	855,600
アークランドサービスホールディングス	3,300	2,010.00	6,633,000
J . フロント リテイリング	54,800	1,285.00	70,418,000
ドトール・日レスホールディングス	7,300	2,085.00	15,220,500
マツモトキヨシホールディングス	19,000	3,875.00	73,625,000
ブロンコビリー	2,400	2,530.00	6,072,000
Z O Z O	31,600	1,723.00	54,446,800
トレジャー・ファクトリー	1,200	848.00	1,017,600
物語コーポレーション	1,200	8,410.00	10,092,000
ココカラファイン	4,800	5,100.00	24,480,000
三越伊勢丹ホールディングス	80,200	801.00	64,240,200
東洋紡	18,000	1,500.00	27,000,000
ユニチカ	14,900	349.00	5,200,100
富士紡ホールディングス	2,200	3,420.00	7,524,000
日清紡ホールディングス	31,000	1,038.00	32,178,000
倉敷紡績	4,500	2,302.00	10,359,000
ダイワボウホールディングス	3,900	6,270.00	24,453,000
シキボウ	2,700	1,260.00	3,402,000
日東紡績	6,900	5,050.00	34,845,000
トヨタ紡織	13,500	1,624.00	21,924,000
マクニカ・富士エレホールディングス	10,900	1,715.00	18,693,500
H a m e e	1,400	1,594.00	2,231,600
ラクト・ジャパン	1,700	3,940.00	6,698,000
ウエルシアホールディングス	13,700	6,250.00	85,625,000
クリエイトSDホールディングス	7,400	2,717.00	20,105,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	8,500	1,047.00	8,899,500
八洲電機	3,400	883.00	3,002,200
メディアスホールディングス	2,300	775.00	1,782,500
レスターホールディングス	4,700	1,844.00	8,666,800
ジュテックホールディングス	800	1,157.00	925,600
丸善C H Iホールディングス	4,600	367.00	1,688,200
大光	1,800	655.00	1,179,000
O C H Iホールディングス	1,500	1,465.00	2,197,500
T O K A Iホールディングス	24,200	986.00	23,861,200
黒谷	700	480.00	336,000
ミサワ	500	774.00	387,000
ティールライフ	500	849.00	424,500
C o m i n i x	800	814.00	651,200
エー・ピーカンパニー	800	592.00	473,600
三洋貿易	4,500	1,205.00	5,422,500
チムニー	1,600	2,225.00	3,560,000
シュッピン	3,000	979.00	2,937,000

ビューティガレージ	700	2,032.00	1,422,400
ウイン・パートナーズ	3,700	1,061.00	3,925,700
ネクステージ	6,500	1,003.00	6,519,500
ジョイフル本田	13,400	1,246.00	16,696,400
鳥貴族	1,700	2,645.00	4,496,500
キリン堂ホールディングス	2,000	1,688.00	3,376,000
ホットランド	3,400	1,292.00	4,392,800
すかいらくホールディングス	51,500	1,853.00	95,429,500
SFPホールディングス	2,200	2,133.00	4,692,600
綿半ホールディングス	1,900	1,830.00	3,477,000
日本毛織	14,900	1,012.00	15,078,800
ダイトウボウ	5,000	226.00	1,130,000
トーア紡コーポレーション	1,400	514.00	719,600
ダイドーリミテッド	5,900	265.00	1,563,500
ヨシックス	900	2,652.00	2,386,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	13,200	959.00	12,658,800
三栄建築設計	2,100	1,490.00	3,129,000
野村不動産ホールディングス	27,900	2,751.00	76,752,900
三重交通グループホールディングス	10,400	581.00	6,042,400
サムティ	6,500	1,861.00	12,096,500
ディア・ライフ	6,700	569.00	3,812,300
コーセーアールイー	1,300	605.00	786,500
エー・ディー・ワークス	81,900	28.00	2,293,200
日本商業開発	3,200	1,771.00	5,667,200
プレサンスコーポレーション	7,500	1,277.00	9,577,500
ユニゾホールディングス	5,900	5,840.00	34,456,000
フィル・カンパニー	700	3,920.00	2,744,000
THEグローバル社	1,700	439.00	746,300
ハウスコム	400	1,535.00	614,000
日本管理センター	3,400	1,408.00	4,787,200
サンセイランディック	1,600	820.00	1,312,000
エストラスト	600	825.00	495,000
フージャースホールディングス	9,000	697.00	6,273,000
オープンハウス	13,300	3,100.00	41,230,000
東急不動産ホールディングス	125,100	782.00	97,828,200
飯田グループホールディングス	38,300	1,626.00	62,275,800
イーグランド	500	808.00	404,000
ムゲンエステート	2,900	594.00	1,722,600
帝国繊維	5,100	2,182.00	11,128,200
日本コークス工業	44,500	76.00	3,382,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,500	694.00	1,735,000
ミタチ産業	1,700	689.00	1,171,300
B E E N O S	1,400	1,111.00	1,555,400
あさひ	3,400	1,265.00	4,301,000
日本調剤	1,400	3,850.00	5,390,000
コスモス薬品	2,000	23,490.00	46,980,000
シップヘルスケアホールディングス	7,300	4,630.00	33,799,000
トーエル	1,900	793.00	1,506,700
ソフトクリエイイトホールディングス	1,900	1,766.00	3,355,400

オンリー	500	778.00	389,000
セブン&アイ・ホールディングス	179,900	3,920.00	705,208,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,300	2,253.00	27,711,900
明治電機工業	1,600	1,440.00	2,304,000
ツルハホールディングス	10,000	12,670.00	126,700,000
デリカフーズホールディングス	1,400	691.00	967,400
スターティアホールディングス	1,000	711.00	711,000
サンマルクホールディングス	3,600	2,169.00	7,808,400
フェリシモ	1,200	942.00	1,130,400
トリドールホールディングス	5,600	2,735.00	15,316,000
帝人	37,200	2,011.00	74,809,200
東レ	330,900	700.00	231,630,000
クラレ	71,900	1,262.00	90,737,800
旭化成	303,000	1,024.00	310,272,000
サカイオーベックス	1,400	1,903.00	2,664,200
T O K Y O B A S E	4,700	457.00	2,147,900
稲葉製作所	2,900	1,334.00	3,868,600
宮地エンジニアリンググループ	1,300	2,043.00	2,655,900
トーカロ	12,700	1,125.00	14,287,500
アルファC o	1,900	1,175.00	2,232,500
S U M C O	55,200	1,869.00	103,168,800
川田テクノロジーズ	1,000	6,190.00	6,190,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,400	2,787.00	3,901,800
信和	1,900	1,055.00	2,004,500
ビーロット	1,200	1,916.00	2,299,200
ファーストブラザーズ	1,000	1,125.00	1,125,000
ハウスドゥ	2,200	1,190.00	2,618,000
シーアールイー	1,200	1,105.00	1,326,000
プロパティエージェント	800	1,011.00	808,800
ケイアイスター不動産	1,400	1,661.00	2,325,400
アグレ都市デザイン	400	517.00	206,800
グッドコムアセット	1,200	1,907.00	2,288,400
ジェイ・エス・ビー	500	5,170.00	2,585,000
テンポイノベーション	1,200	953.00	1,143,600
グローバル・リンク・マネジメント	300	755.00	226,500
住江織物	1,000	2,332.00	2,332,000
日本フェルト	2,000	485.00	970,000
イチカワ	600	1,431.00	858,600
エコナックホールディングス	9,000	136.00	1,224,000
日東製網	400	1,652.00	660,800
芦森工業	800	1,271.00	1,016,800
アツギ	3,600	787.00	2,833,200
ウイルプラスホールディングス	400	756.00	302,400
J Mホールディングス	2,300	2,266.00	5,211,800
コメダホールディングス	10,000	2,141.00	21,410,000
サツドラホールディングス	500	1,815.00	907,500
アレンザホールディングス	2,600	977.00	2,540,200
串カツ田中ホールディングス	600	2,094.00	1,256,400
パロックジャパンリミテッド	3,200	982.00	3,142,400

クスリのアオキホールディングス	4,100	6,560.00	26,896,000
ダイニク	1,400	804.00	1,125,600
共和レザー	2,500	771.00	1,927,500
ピーバンドットコム	400	1,152.00	460,800
力の源ホールディングス	2,400	896.00	2,150,400
スシローグローバルホールディングス	5,000	8,800.00	44,000,000
L I X I L ビバ	4,500	2,345.00	10,552,500
アセンテック	300	2,944.00	883,200
セーレン	11,200	1,585.00	17,752,000
ソトー	1,600	969.00	1,550,400
東海染工	800	1,123.00	898,400
小松マテーレ	7,400	790.00	5,846,000
ワコールホールディングス	11,900	2,800.00	33,320,000
ホギメディカル	5,200	3,305.00	17,186,000
レナウン	11,900	104.00	1,237,600
クラウディアホールディングス	1,300	459.00	596,700
T S Iホールディングス	15,100	495.00	7,474,500
マツオカコーポレーション	1,500	2,049.00	3,073,500
ワールド	6,400	2,324.00	14,873,600
T I S	15,300	7,120.00	108,936,000
ネオス	2,100	669.00	1,404,900
電算システム	1,900	2,602.00	4,943,800
グリー	27,900	457.00	12,750,300
コーエーテクモホールディングス	9,300	3,080.00	28,644,000
三菱総合研究所	1,900	4,120.00	7,828,000
ボルテージ	900	507.00	456,300
電算	400	2,251.00	900,400
A G S	3,000	792.00	2,376,000
ファインデックス	4,300	885.00	3,805,500
ブレインパッド	1,000	5,090.00	5,090,000
K L a b	8,700	759.00	6,603,300
ポルトゥウイン・ピットクルーホールディングス	6,100	978.00	5,965,800
イーブックイニシアティブジャパン	600	1,634.00	980,400
ネクソン	130,400	1,823.00	237,719,200
アイスタイル	13,000	350.00	4,550,000
エムアップ	1,400	2,730.00	3,822,000
エイチーム	3,500	888.00	3,108,000
エニグモ	3,700	829.00	3,067,300
テクノスジャパン	3,700	496.00	1,835,200
e n i s h	2,000	509.00	1,018,000
コロブラ	14,900	947.00	14,110,300
オルトプラス	3,800	916.00	3,480,800
ブロードリーフ	22,500	523.00	11,767,500
クロス・マーケティンググループ	1,200	430.00	516,000
デジタルハーツホールディングス	2,800	965.00	2,702,000
システム情報	2,600	836.00	2,173,600
メディアドゥホールディングス	1,600	3,080.00	4,928,000
じげん	11,100	438.00	4,861,800
バイキューブ	3,300	666.00	2,197,800

エンカレッジ・テクノロジー	500	882.00	441,000
サイバーリンクス	500	1,040.00	520,000
ディー・エル・イー	1,500	164.00	246,000
フィクスターズ	4,800	1,349.00	6,475,200
CARTA HOLDINGS	2,500	1,099.00	2,747,500
オプティム	1,300	4,650.00	6,045,000
セレス	1,700	1,280.00	2,176,000
SHIFT	1,200	7,220.00	8,664,000
特種東海製紙	2,900	3,995.00	11,585,500
ティーガイア	4,000	2,314.00	9,256,000
セック	600	3,670.00	2,202,000
日本アジアグループ	4,500	352.00	1,584,000
豆蔵ホールディングス	3,100	1,881.00	5,831,100
テクマトリックス	3,200	2,830.00	9,056,000
プロシップ	1,500	1,388.00	2,082,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11,000	1,839.00	20,229,000
GMOペイメントゲートウェイ	7,500	7,550.00	56,625,000
ザッパラス	1,600	355.00	568,000
システムリサーチ	1,400	2,017.00	2,823,800
インターネットイニシアティブ	6,700	3,340.00	22,378,000
さくらインターネット	4,800	615.00	2,952,000
ヴィンクス	1,400	990.00	1,386,000
GMOクラウド	800	2,479.00	1,983,200
SRAホールディングス	2,400	2,579.00	6,189,600
システムインテグレータ	1,500	926.00	1,389,000
朝日ネット	3,600	713.00	2,566,800
eBASE	2,700	1,705.00	4,603,500
アバント	3,700	961.00	3,555,700
アドソル日進	1,800	2,442.00	4,395,600
フリービット	2,400	803.00	1,927,200
コムチュア	5,100	2,258.00	11,515,800
サイバーコム	900	1,900.00	1,710,000
アステリア	2,600	529.00	1,375,400
アイル	1,800	1,826.00	3,286,800
王子ホールディングス	191,000	597.00	114,027,000
日本製紙	20,200	1,721.00	34,764,200
三菱製紙	6,100	440.00	2,684,000
北越コーポレーション	30,100	491.00	14,779,100
中越パルプ工業	2,200	1,478.00	3,251,600
巴川製紙所	1,200	848.00	1,017,600
大王製紙	20,000	1,441.00	28,820,000
阿波製紙	1,000	518.00	518,000
マークライNZ	2,600	1,998.00	5,194,800
メディカル・データ・ビジョン	3,900	925.00	3,607,500
gumi	6,500	726.00	4,719,000
ショーケース	600	671.00	402,600
モバイルファクトリー	1,100	1,850.00	2,035,000
テラスカイ	1,600	3,245.00	5,192,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,700	1,655.00	2,813,500

PCIホールディングス	800	2,250.00	1,800,000
パイブドHD	400	1,669.00	667,600
アイビーシー	800	1,100.00	880,000
ネオジャパン	700	1,395.00	976,500
PR TIMES	400	2,581.00	1,032,400
ランドコンピュータ	400	1,197.00	478,800
ダブルスタンダード	600	4,020.00	2,412,000
オープンドア	2,500	1,210.00	3,025,000
マイネット	900	554.00	498,600
アカツキ	1,600	4,730.00	7,568,000
ベネフィットジャパン	200	1,572.00	314,400
Ubicomホールディングス	800	1,319.00	1,055,200
LINE	10,500	5,370.00	56,385,000
カナミックネットワーク	2,400	687.00	1,648,800
ノムラシステムコーポレーション	600	466.00	279,600
レンゴー	43,100	819.00	35,298,900
トーモク	3,100	1,706.00	5,288,600
ザ・バック	3,400	4,165.00	14,161,000
チェンジ	1,000	4,260.00	4,260,000
シンクロ・フード	1,800	429.00	772,200
オークネット	3,200	1,191.00	3,811,200
セグエグループ	600	920.00	552,000
エイトレッド	400	1,376.00	550,400
AOI TYO Holdings	5,200	741.00	3,853,200
マクロミル	9,000	1,038.00	9,342,000
ビーグリー	1,100	1,506.00	1,656,600
オロ	1,300	3,335.00	4,335,500
ユーザーローカル	300	3,400.00	1,020,000
テモナ	500	699.00	349,500
ニーズウェル	500	724.00	362,000
サインポスト	600	1,998.00	1,198,800
昭和電工	32,500	2,655.00	86,287,500
住友化学	335,700	442.00	148,379,400
住友精化	2,200	3,165.00	6,963,000
日産化学	25,500	5,050.00	128,775,000
ラサ工業	1,500	1,430.00	2,145,000
クレハ	3,900	5,950.00	23,205,000
多木化学	1,300	4,425.00	5,752,500
テイカ	3,300	1,631.00	5,382,300
石原産業	8,100	823.00	6,666,300
片倉コープアグリ	1,000	1,231.00	1,231,000
日本曹達	6,700	3,175.00	21,272,500
東ソー	70,600	1,641.00	115,854,600
トクヤマ	13,100	2,715.00	35,566,500
セントラル硝子	9,300	2,275.00	21,157,500
東亜合成	28,600	1,225.00	35,035,000
大阪ソーダ	4,600	2,730.00	12,558,000
関東電化工業	10,700	1,000.00	10,700,000
デンカ	16,600	2,943.00	48,853,800

イビデン	28,500	2,736.00	77,976,000
信越化学工業	78,500	13,745.00	1,078,982,500
日本カーバイド工業	1,800	1,271.00	2,287,800
堺化学工業	2,900	2,186.00	6,339,400
第一稀元素化学工業	5,500	851.00	4,680,500
エア・ウォーター	42,500	1,529.00	64,982,500
大陽日酸	43,900	2,194.00	96,316,600
日本化学工業	1,600	2,656.00	4,249,600
東邦アセチレン	700	1,335.00	934,500
日本パーカライジング	23,000	1,102.00	25,346,000
高圧ガス工業	8,000	752.00	6,016,000
チタン工業	500	2,181.00	1,090,500
四国化成工業	7,000	1,212.00	8,484,000
戸田工業	1,200	2,055.00	2,466,000
ステラ ケミファ	2,500	3,230.00	8,075,000
保土谷化学工業	1,700	4,345.00	7,386,500
日本触媒	7,100	6,050.00	42,955,000
大日精化工業	4,000	2,629.00	10,516,000
カネカ	11,800	3,310.00	39,058,000
協和キリン	46,900	2,710.00	127,099,000
三菱瓦斯化学	43,100	1,821.00	78,485,100
三井化学	41,500	2,541.00	105,451,500
J S R	42,600	2,122.00	90,397,200
東京応化工業	7,800	4,420.00	34,476,000
大阪有機化学工業	4,200	1,715.00	7,203,000
三菱ケミカルホールディングス	305,500	787.30	240,520,150
K Hネオケム	8,000	2,434.00	19,472,000
ダイセル	62,400	1,003.00	62,587,200
住友ベークライト	7,200	3,595.00	25,884,000
積水化学工業	98,300	1,807.00	177,628,100
日本ゼオン	41,100	1,209.00	49,689,900
アイカ工業	13,700	3,475.00	47,607,500
宇部興産	23,000	2,166.00	49,818,000
積水樹脂	8,200	2,373.00	19,458,600
タキロンシーアイ	9,700	625.00	6,062,500
旭有機材	2,700	1,604.00	4,330,800
日立化成	19,400	4,605.00	89,337,000
ニチバン	2,700	1,680.00	4,536,000
リケンテクノス	12,700	464.00	5,892,800
大倉工業	2,400	1,630.00	3,912,000
積水化成品工業	6,800	677.00	4,603,600
群栄化学工業	1,200	2,449.00	2,938,800
タイガースポリマー	2,100	554.00	1,163,400
ミライアル	1,800	1,177.00	2,118,600
ダイキアクシス	1,900	816.00	1,550,400
ダイキョーニシカワ	9,500	725.00	6,887,500
竹本容器	1,400	855.00	1,197,000
森六ホールディングス	2,700	2,149.00	5,802,300
日本化薬	28,200	1,286.00	36,265,200

カーリットホールディングス	5,500	555.00	3,052,500
E P Sホールディングス	6,600	1,260.00	8,316,000
ソルクシーズ	2,200	862.00	1,896,400
レグス	1,300	1,377.00	1,790,100
プレステージ・インターナショナル	16,600	987.00	16,384,200
フェイス	1,700	779.00	1,324,300
プロトコーポレーション	4,000	1,339.00	5,356,000
ハイマックス	600	1,950.00	1,170,000
アミューズ	2,400	2,637.00	6,328,800
野村総合研究所	64,900	2,640.00	171,336,000
ドリームインキュベータ	1,300	1,475.00	1,917,500
サイバネットシステム	3,300	778.00	2,567,400
クイック	3,100	1,444.00	4,476,400
T A C	2,500	198.00	495,000
C Eホールディングス	3,100	476.00	1,475,600
ケネディクス	41,400	672.00	27,820,800
日本システム技術	500	1,247.00	623,500
電通グループ	46,000	3,380.00	155,480,000
インテージホールディングス	6,300	836.00	5,266,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	1,029.00	1,646,400
東邦システムサイエンス	1,300	907.00	1,179,100
ぴあ	1,400	3,885.00	5,439,000
イオンファンタジー	1,900	2,222.00	4,221,800
ソースネクスト	21,500	402.00	8,643,000
シーティーエス	5,600	726.00	4,065,600
ネクシィーズグループ	1,500	1,564.00	2,346,000
インフォコム	5,000	2,801.00	14,005,000
メディカルシステムネットワーク	4,100	484.00	1,984,400
日本精化	4,100	1,362.00	5,584,200
扶桑化学工業	4,600	3,420.00	15,732,000
トリケミカル研究所	1,000	9,550.00	9,550,000
H E R O Z	600	5,000.00	3,000,000
ラクスル	2,400	3,445.00	8,268,000
F I G	4,900	288.00	1,411,200
システムサポート	300	3,270.00	981,000
A D E K A	21,000	1,547.00	32,487,000
日油	17,200	3,710.00	63,812,000
ミヨシ油脂	1,600	1,072.00	1,715,200
新日本理化	6,200	198.00	1,227,600
ハリマ化成グループ	4,200	1,051.00	4,414,200
イーソル	1,800	1,878.00	3,380,400
アルテリア・ネットワークス	5,000	1,899.00	9,495,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,000	1,552.00	1,552,000
花王	111,800	8,525.00	953,095,000
第一工業製薬	1,700	4,290.00	7,293,000
石原ケミカル	1,400	1,829.00	2,560,600
日華化学	1,800	777.00	1,398,600
ニイタカ	500	2,605.00	1,302,500
三洋化成工業	2,700	4,835.00	13,054,500

武田薬品工業	388,400	4,163.00	1,616,909,200
アステラス製薬	410,600	1,913.00	785,477,800
大日本住友製薬	34,500	1,722.00	59,409,000
塩野義製薬	59,700	6,459.00	385,602,300
わかもと製薬	6,500	279.00	1,813,500
あすか製薬	5,200	1,111.00	5,777,200
日本新薬	12,200	9,220.00	112,484,000
ビオフェルミン製薬	700	2,374.00	1,661,800
中外製薬	48,700	12,085.00	588,539,500
科研製薬	8,000	5,820.00	46,560,000
エーザイ	55,900	8,968.00	501,311,200
理研ビタミン	2,200	3,965.00	8,723,000
ロート製薬	23,900	3,270.00	78,153,000
小野薬品工業	107,200	2,541.00	272,395,200
久光製薬	12,300	5,530.00	68,019,000
有機合成薬品工業	3,000	418.00	1,254,000
持田製薬	6,500	4,260.00	27,690,000
参天製薬	86,900	1,954.00	169,802,600
扶桑薬品工業	1,600	1,955.00	3,128,000
日本ケミファ	700	2,616.00	1,831,200
ツムラ	14,400	2,803.00	40,363,200
日医工	13,100	1,316.00	17,239,600
テルモ	132,100	3,844.00	507,792,400
みらかホールディングス	12,400	2,806.00	34,794,400
キッセイ薬品工業	8,200	2,858.00	23,435,600
生化学工業	9,000	1,219.00	10,971,000
栄研化学	8,200	2,171.00	17,802,200
日水製薬	2,200	1,319.00	2,901,800
鳥居薬品	2,900	3,605.00	10,454,500
JCRファーマ	3,300	11,030.00	36,399,000
東和薬品	5,900	2,388.00	14,089,200
富士製薬工業	3,500	1,239.00	4,336,500
沢井製薬	9,600	7,040.00	67,584,000
ゼリア新薬工業	8,400	1,950.00	16,380,000
第一三共	133,600	7,715.00	1,030,724,000
キョーリン製薬ホールディングス	10,200	2,129.00	21,715,800
大幸薬品	1,900	5,230.00	9,937,000
ダイト	2,700	3,400.00	9,180,000
大塚ホールディングス	88,900	4,491.00	399,249,900
大正製薬ホールディングス	9,900	7,240.00	71,676,000
ペプチドリーム	23,600	5,190.00	122,484,000
大日本塗料	5,700	1,071.00	6,104,700
日本ペイントホールディングス	37,700	5,010.00	188,877,000
関西ペイント	51,300	2,531.00	129,840,300
神東塗料	2,000	200.00	400,000
中国塗料	12,900	933.00	12,035,700
日本特殊塗料	3,800	1,189.00	4,518,200
藤倉化成	6,900	530.00	3,657,000
太陽ホールディングス	3,300	4,750.00	15,675,000

D I C	19,300	2,927.00	56,491,100
サカティンクス	9,900	1,156.00	11,444,400
東洋インキS Cホールディングス	9,600	2,392.00	22,963,200
T & K T O K A	4,000	920.00	3,680,000
アルプス技研	3,900	1,962.00	7,651,800
サニックス	7,100	384.00	2,726,400
ダイオーズ	700	1,320.00	924,000
日本空調サービス	4,500	753.00	3,388,500
オリエンタルランド	47,400	13,795.00	653,883,000
フォーカスシステムズ	2,700	892.00	2,408,400
ダスキン	11,400	2,999.00	34,188,600
パーク24	24,700	2,629.00	64,936,300
明光ネットワークジャパン	5,800	916.00	5,312,800
ファルコホールディングス	2,700	1,931.00	5,213,700
クレスコ	3,000	1,943.00	5,829,000
フジ・メディア・ホールディングス	44,100	1,421.00	62,666,100
秀英予備校	1,000	443.00	443,000
田谷	800	620.00	496,000
ラウンドワン	12,300	933.00	11,475,900
リゾートトラスト	20,400	1,613.00	32,905,200
オービック	15,900	14,630.00	232,617,000
ジャストシステム	7,400	5,130.00	37,962,000
T D Cソフト	4,500	929.00	4,180,500
Zホールディングス	628,900	423.00	266,024,700
ビー・エム・エル	5,700	3,305.00	18,838,500
ワタベウェディング	400	519.00	207,600
トレンドマイクロ	20,300	5,890.00	119,567,000
りらいあコミュニケーションズ	8,000	1,445.00	11,560,000
I Dホールディングス	2,000	1,629.00	3,258,000
リソー教育	20,100	382.00	7,678,200
日本オラクル	9,300	9,560.00	88,908,000
早稲田アカデミー	1,700	1,042.00	1,771,400
アルファシステムズ	1,600	2,829.00	4,526,400
フューチャー	5,500	1,768.00	9,724,000
C A C H o l d i n g s	3,300	1,275.00	4,207,500
S Bテクノロジー	1,700	2,363.00	4,017,100
トーセ	1,300	888.00	1,154,400
ユー・エス・エス	49,900	1,884.00	94,011,600
オービックビジネスコンサルタント	4,700	4,165.00	19,575,500
伊藤忠テクノソリューションズ	20,800	3,325.00	69,160,000
アイティフォー	6,200	749.00	4,643,800
東京個別指導学院	1,200	687.00	824,400
東計電算	700	4,530.00	3,171,000
サイバーエージェント	25,600	4,410.00	112,896,000
楽天	207,800	948.00	196,994,400
エクスネット	500	971.00	485,500
クリーク・アンド・リバー社	2,300	1,005.00	2,311,500
テー・オー・ダブリュー	3,400	859.00	2,920,600
大塚商会	24,800	4,850.00	120,280,000

サイボウズ	5,300	2,249.00	11,919,700
ソフトブレン	2,200	507.00	1,115,400
山田コンサルティンググループ	2,400	1,550.00	3,720,000
セントラルスポーツ	1,800	2,976.00	5,356,800
バラカ	1,400	1,975.00	2,765,000
電通国際情報サービス	2,800	4,955.00	13,874,000
デジタルガレージ	8,200	4,075.00	33,415,000
EMシステムズ	7,000	899.00	6,293,000
ウェザーニューズ	1,700	3,845.00	6,536,500
C I J	3,300	823.00	2,715,900
ビジネスエンジニアリング	500	3,180.00	1,590,000
日本エンタープライズ	4,000	256.00	1,024,000
WOWOW	2,400	2,663.00	6,391,200
スカラ	2,900	709.00	2,056,100
インテリジェント ウェイブ	1,400	740.00	1,036,000
フルキャストホールディングス	4,400	2,463.00	10,837,200
エン・ジャパン	7,900	3,485.00	27,531,500
富士フイルムホールディングス	89,500	5,364.00	480,078,000
コニカミノルタ	101,800	654.00	66,577,200
資生堂	92,800	6,985.00	648,208,000
ライオン	60,600	1,999.00	121,139,400
高砂香料工業	2,900	2,309.00	6,696,100
マンダム	10,500	2,551.00	26,785,500
ミルボン	6,200	5,880.00	36,456,000
ファンケル	18,900	3,070.00	58,023,000
コーセー	8,800	14,280.00	125,664,000
コタ	2,700	1,479.00	3,993,300
シーボン	700	2,455.00	1,718,500
ポーラ・オルビスホールディングス	19,900	2,263.00	45,033,700
ノエビアホールディングス	4,400	5,090.00	22,396,000
アジュバンコスメジャパン	800	987.00	789,600
エステー	3,300	1,601.00	5,283,300
アグロ カネショウ	1,700	1,409.00	2,395,300
コニシ	7,600	1,529.00	11,620,400
長谷川香料	6,100	2,177.00	13,279,700
星光PMC	3,000	884.00	2,652,000
小林製薬	13,100	8,570.00	112,267,000
荒川化学工業	4,600	1,491.00	6,858,600
メック	3,100	1,542.00	4,780,200
日本高純度化学	1,400	2,661.00	3,725,400
タカラバイオ	12,200	2,249.00	27,437,800
J C U	5,600	2,962.00	16,587,200
新田ゼラチン	2,500	640.00	1,600,000
O A Tアグリオ	800	1,363.00	1,090,400
デクセリアルズ	11,900	915.00	10,888,500
アース製薬	3,500	6,060.00	21,210,000
北興化学工業	4,600	625.00	2,875,000
大成ラミック	1,700	2,804.00	4,766,800
クミアイ化学工業	19,200	833.00	15,993,600

日本農薬	9,300	552.00	5,133,600
富士興産	1,400	677.00	947,800
ニチレキ	5,400	1,393.00	7,522,200
ユシロ化学工業	2,900	1,335.00	3,871,500
ビービー・カストロール	1,900	1,372.00	2,606,800
富士石油	11,900	232.00	2,760,800
MORESCO	1,900	1,336.00	2,538,400
出光興産	52,500	2,903.00	152,407,500
JXTGホールディングス	702,100	468.30	328,793,430
コスモエネルギーホールディングス	13,500	2,000.00	27,000,000
横浜ゴム	27,000	2,017.00	54,459,000
TOYO TIRE	26,700	1,620.00	43,254,000
ブリヂストン	143,500	3,983.00	571,560,500
住友ゴム工業	41,800	1,246.00	52,082,800
藤倉コンポジット	4,700	455.00	2,138,500
オカモト	2,800	3,660.00	10,248,000
アキレス	3,200	1,949.00	6,236,800
フコク	1,700	688.00	1,169,600
ニッタ	5,200	2,881.00	14,981,200
クリエートメディック	1,800	1,104.00	1,987,200
住友理工	8,900	832.00	7,404,800
三ツ星ベルト	6,100	1,727.00	10,534,700
バンドー化学	8,100	817.00	6,617,700
AGC	46,100	3,480.00	160,428,000
日本板硝子	22,100	567.00	12,530,700
石塚硝子	1,000	2,646.00	2,646,000
有沢製作所	7,300	910.00	6,643,000
日本山村硝子	2,200	1,190.00	2,618,000
日本電気硝子	18,700	2,059.00	38,503,300
オハラ	2,100	1,274.00	2,675,400
住友大阪セメント	8,800	4,170.00	36,696,000
太平洋セメント	29,400	2,946.00	86,612,400
リソルホールディングス	600	4,145.00	2,487,000
日本ヒューム	5,200	762.00	3,962,400
日本コンクリート工業	11,400	288.00	3,283,200
三谷セキサン	2,100	3,790.00	7,959,000
アジアパイルホールディングス	7,400	528.00	3,907,200
東海カーボン	48,800	1,016.00	49,580,800
日本カーボン	2,400	4,000.00	9,600,000
東洋炭素	3,000	2,013.00	6,039,000
ノリタケカンパニーリミテド	2,600	4,170.00	10,842,000
TOTO	33,300	4,600.00	153,180,000
日本碍子	56,900	1,882.00	107,085,800
日本特殊陶業	36,300	1,933.00	70,167,900
ダントーホールディングス	3,000	113.00	339,000
MARUWA	1,800	7,760.00	13,968,000
品川リフラクトリーズ	1,200	2,926.00	3,511,200
黒崎播磨	1,000	6,320.00	6,320,000
ヨータイ	3,600	673.00	2,422,800

イソライト工業	2,100	556.00	1,167,600
東京窯業	5,300	310.00	1,643,000
ニッカトー	1,900	673.00	1,278,700
フジミインコーポレーテッド	4,100	3,055.00	12,525,500
クニミネ工業	1,900	1,205.00	2,289,500
エーアンドエーマテリアル	800	1,371.00	1,096,800
ニチアス	12,700	2,546.00	32,334,200
日本製鉄	206,600	1,358.00	280,562,800
神戸製鋼所	84,300	455.00	38,356,500
中山製鋼所	7,200	452.00	3,254,400
合同製鐵	2,700	2,754.00	7,435,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	124,600	1,108.00	138,056,800
東京製鐵	22,300	799.00	17,817,700
共英製鋼	5,100	1,879.00	9,582,900
大和工業	9,800	2,499.00	24,490,200
東京鐵鋼	1,800	1,391.00	2,503,800
大阪製鐵	2,700	1,587.00	4,284,900
淀川製鋼所	6,200	1,977.00	12,257,400
丸一鋼管	15,000	2,859.00	42,885,000
モリ工業	1,300	2,621.00	3,407,300
大同特殊鋼	7,500	4,255.00	31,912,500
日本高周波鋼業	1,400	405.00	567,000
日本冶金工業	3,800	2,015.00	7,657,000
山陽特殊製鋼	3,100	1,449.00	4,491,900
愛知製鋼	2,600	3,350.00	8,710,000
日立金属	49,700	1,695.00	84,241,500
日本金属	1,000	805.00	805,000
大平洋金属	3,100	2,386.00	7,396,600
新日本電工	33,000	171.00	5,643,000
栗本鐵工所	2,200	2,111.00	4,644,200
虹技	500	1,309.00	654,500
日本鑄鐵管	300	1,549.00	464,700
日本製鋼所	13,900	1,820.00	25,298,000
三菱製鋼	3,800	980.00	3,724,000
日亜鋼業	7,700	309.00	2,379,300
日本精線	700	3,590.00	2,513,000
エンビプロ・ホールディングス	1,700	687.00	1,167,900
大紀アルミニウム工業所	8,400	661.00	5,552,400
日本輕金属ホールディングス	116,300	215.00	25,004,500
三井金属鉱業	12,400	2,921.00	36,220,400
東邦亜鉛	2,600	1,839.00	4,781,400
三菱マテリアル	30,500	2,763.00	84,271,500
住友金属鉱山	59,000	3,063.00	180,717,000
DOWAホールディングス	11,700	3,940.00	46,098,000
古河機械金属	8,100	1,336.00	10,821,600
エス・サイエンス	19,300	49.00	945,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,700	1,293.00	6,077,100
東邦チタニウム	8,100	845.00	6,844,500
UACJ	7,000	2,115.00	14,805,000

C Kサンエツ	1,100	3,355.00	3,690,500
古河電気工業	14,300	2,572.00	36,779,600
住友電気工業	172,600	1,458.50	251,737,100
フジクラ	55,500	385.00	21,367,500
昭和電線ホールディングス	5,300	1,302.00	6,900,600
東京特殊電線	600	2,574.00	1,544,400
タツタ電線	10,200	579.00	5,905,800
カナレ電気	700	1,785.00	1,249,500
平河ヒューテック	1,800	1,317.00	2,370,600
リョービ	5,600	1,665.00	9,324,000
アーレスティ	5,700	500.00	2,850,000
アサヒホールディングス	8,000	2,703.00	21,624,000
東洋製罐グループホールディングス	29,300	1,987.00	58,219,100
ホッカンホールディングス	2,800	1,814.00	5,079,200
コロナ	2,900	991.00	2,873,900
横河ブリッジホールディングス	8,500	2,218.00	18,853,000
O S J Bホールディングス	22,700	264.00	5,992,800
駒井ハルテック	800	1,674.00	1,339,200
高田機工	300	2,795.00	838,500
三和ホールディングス	44,200	1,106.00	48,885,200
文化シャッター	13,500	836.00	11,286,000
三協立山	5,900	1,308.00	7,717,200
アルインコ	3,700	1,091.00	4,036,700
東洋シャッター	1,500	655.00	982,500
L I X I Lグループ	68,100	1,907.00	129,866,700
日本ファイルコン	3,200	510.00	1,632,000
ノーリツ	9,500	1,306.00	12,407,000
長府製作所	4,600	2,241.00	10,308,600
リンナイ	9,000	8,170.00	73,530,000
ユニプレス	9,000	1,296.00	11,664,000
ダイニチ工業	2,000	664.00	1,328,000
日東精工	7,100	526.00	3,734,600
三洋工業	700	1,977.00	1,383,900
岡部	9,200	852.00	7,838,400
ジーテクト	5,700	1,460.00	8,322,000
東プレ	8,500	1,605.00	13,642,500
高周波熱錬	8,800	814.00	7,163,200
東京製綱	3,700	946.00	3,500,200
サンコール	2,100	548.00	1,150,800
モリテック スチール	2,800	333.00	932,400
パイオラックス	6,800	1,807.00	12,287,600
エイチワン	5,100	667.00	3,401,700
日本発條	49,400	910.00	44,954,000
中央発條	600	2,810.00	1,686,000
アドバネクス	600	1,487.00	892,200
三浦工業	20,000	3,840.00	76,800,000
タクマ	15,500	1,240.00	19,220,000
テクノプロ・ホールディングス	8,900	7,730.00	68,797,000
アトラ	700	325.00	227,500

インターワークス	700	538.00	376,600
アイ・アールジャパンホールディングス	1,800	7,370.00	13,266,000
KeepEr 技研	1,900	1,120.00	2,128,000
ファーストロジック	400	591.00	236,400
三機サービス	800	995.00	796,000
Gunosy	2,700	1,159.00	3,129,300
デザインワン・ジャパン	600	282.00	169,200
イー・ガーディアン	2,500	1,914.00	4,785,000
リブセンス	2,500	281.00	702,500
ジャパンマテリアル	13,600	1,517.00	20,631,200
ベクトル	5,500	1,199.00	6,594,500
ウチヤマホールディングス	2,400	447.00	1,072,800
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	938.00	3,001,600
ライクキッズ	800	891.00	712,800
キャリアリンク	1,200	584.00	700,800
I B J	2,900	1,221.00	3,540,900
アサンテ	2,000	1,875.00	3,750,000
N・フィールド	3,000	562.00	1,686,000
バリューHR	1,000	3,445.00	3,445,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,100	3,750.00	11,625,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,700	1,665.00	2,830,500
ERIホールディングス	900	766.00	689,400
アビスト	800	2,533.00	2,026,400
シグマクシス	3,000	1,665.00	4,995,000
ウィルグループ	3,300	995.00	3,283,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,000	212.00	1,060,000
リクルートホールディングス	319,600	4,552.00	1,454,819,200
エラン	2,900	1,644.00	4,767,600
ツガミ	9,500	978.00	9,291,000
オークマ	5,400	5,000.00	27,000,000
東芝機械	5,200	3,180.00	16,536,000
アマダホールディングス	58,600	1,086.00	63,639,600
アイダエンジニアリング	12,000	878.00	10,536,000
滝澤鉄工所	1,600	1,285.00	2,056,000
F U J I	19,800	1,909.00	37,798,200
牧野フライス製作所	5,400	4,065.00	21,951,000
オーエスジー	21,300	1,779.00	37,892,700
ダイジェット工業	400	1,379.00	551,600
旭ダイヤモンド工業	11,900	571.00	6,794,900
D M G 森精機	29,100	1,528.00	44,464,800
ソディック	10,700	817.00	8,741,900
ディスコ	6,200	24,740.00	153,388,000
日東工器	2,500	2,440.00	6,100,000
日進工具	1,500	2,818.00	4,227,000
パンチ工業	4,000	409.00	1,636,000
富士ダイス	2,400	629.00	1,509,600
土木管理総合試験所	1,200	417.00	500,400
ネットマーケティング	1,300	801.00	1,041,300
日本郵政	365,600	1,005.00	367,428,000

ベルシステム24ホールディングス	7,400	1,508.00	11,159,200
鎌倉新書	3,700	1,648.00	6,097,600
SMN	400	807.00	322,800
一蔵	400	623.00	249,200
LITALICO	1,700	2,476.00	4,209,200
グローバルキッズCOMPANY	400	731.00	292,400
エアトリ	2,200	1,328.00	2,921,600
アトラエ	1,300	2,805.00	3,646,500
ストライク	1,700	4,730.00	8,041,000
ソラスト	12,200	1,060.00	12,932,000
セラク	1,300	1,226.00	1,593,800
インソース	2,100	2,893.00	6,075,300
豊田自動織機	37,800	6,340.00	239,652,000
豊和工業	2,900	769.00	2,230,100
OKK	2,200	600.00	1,320,000
石川製作所	1,200	1,473.00	1,767,600
東洋機械金属	2,800	501.00	1,402,800
津田駒工業	800	1,003.00	802,400
エンシュウ	1,100	1,112.00	1,223,200
島精機製作所	7,400	1,928.00	14,267,200
オプトラン	5,100	3,265.00	16,651,500
NCホールディングス	1,100	648.00	712,800
イワキポンプ	2,100	1,069.00	2,244,900
フリュー	5,000	1,158.00	5,790,000
ヤマシンフィルタ	9,900	692.00	6,850,800
日阪製作所	6,300	936.00	5,896,800
やまびこ	8,800	1,004.00	8,835,200
平田機工	2,200	5,830.00	12,826,000
ベガサスミシン製造	4,500	456.00	2,052,000
マルマエ	1,700	896.00	1,523,200
タツモ	2,400	1,310.00	3,144,000
ナブテスコ	27,200	3,245.00	88,264,000
三井海洋開発	4,800	1,990.00	9,552,000
レオン自動機	4,400	1,340.00	5,896,000
SMC	14,600	49,230.00	718,758,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	3,900	748.00	2,917,200
ホソカワミクロン	1,600	5,380.00	8,608,000
ユニオンツール	1,900	2,986.00	5,673,400
オイレス工業	5,900	1,544.00	9,109,600
日精エー・エス・ビー機械	1,500	4,110.00	6,165,000
サトーホールディングス	6,500	2,744.00	17,836,000
技研製作所	4,000	4,415.00	17,660,000
日本エアテック	1,400	1,031.00	1,443,400
カワタ	1,300	1,004.00	1,305,200
日精樹脂工業	4,300	929.00	3,994,700
オカダアイヨン	1,200	1,080.00	1,296,000
ワイエイシイホールディングス	1,700	601.00	1,021,700
小松製作所	211,400	2,300.00	486,220,000
住友重機械工業	26,700	2,666.00	71,182,200

日立建機	18,700	2,952.00	55,202,400
日工	7,100	776.00	5,509,600
巴工業	2,200	2,125.00	4,675,000
井関農機	4,600	1,359.00	6,251,400
TOWA	5,200	1,111.00	5,777,200
丸山製作所	1,200	1,614.00	1,936,800
北川鉄工所	2,300	1,981.00	4,556,300
シンニッタン	8,100	392.00	3,175,200
ローツェ	2,000	3,965.00	7,930,000
タカキタ	1,300	528.00	686,400
クボタ	247,600	1,607.00	397,893,200
荏原実業	1,100	2,002.00	2,202,200
東洋エンジニアリング	6,900	575.00	3,967,500
三菱化工機	1,800	1,913.00	3,443,400
月島機械	8,500	1,347.00	11,449,500
帝国電機製作所	3,800	1,462.00	5,555,600
東京機械製作所	1,300	337.00	438,100
新東工業	11,000	900.00	9,900,000
澁谷工業	4,000	2,735.00	10,940,000
アイチ コーポレーション	8,900	695.00	6,185,500
小森コーポレーション	11,700	923.00	10,799,100
鶴見製作所	3,600	1,879.00	6,764,400
住友精密工業	700	2,995.00	2,096,500
日本ギア工業	1,200	385.00	462,000
酒井重工業	800	2,620.00	2,096,000
荏原製作所	19,300	2,830.00	54,619,000
石井鐵工所	500	2,861.00	1,430,500
西島製作所	5,200	841.00	4,373,200
北越工業	4,700	1,297.00	6,095,900
ダイキン工業	59,500	15,445.00	918,977,500
オルガノ	1,700	6,890.00	11,713,000
トーヨーカネツ	2,300	2,454.00	5,644,200
栗田工業	25,200	3,235.00	81,522,000
椿本チエイン	6,600	3,220.00	21,252,000
大同工業	2,600	772.00	2,007,200
日機装	13,900	1,109.00	15,415,100
木村化工機	3,700	557.00	2,060,900
レイズネクスト	7,800	1,286.00	10,030,800
アネスト岩田	7,200	1,024.00	7,372,800
ダイフク	23,800	6,970.00	165,886,000
サムコ	1,500	1,920.00	2,880,000
加藤製作所	2,800	1,455.00	4,074,000
油研工業	800	1,676.00	1,340,800
タダノ	22,400	1,014.00	22,713,600
フジテック	16,900	1,700.00	28,730,000
C K D	12,900	1,966.00	25,361,400
キトー	3,900	1,682.00	6,559,800
平和	13,000	2,250.00	29,250,000
理想科学工業	4,100	1,928.00	7,904,800

SANKYO	10,400	3,895.00	40,508,000
日本金銭機械	5,700	780.00	4,446,000
マースグループホールディングス	2,900	1,992.00	5,776,800
フクシマガリレイ	2,900	4,025.00	11,672,500
オーイズミ	2,000	543.00	1,086,000
ダイコク電機	2,400	1,383.00	3,319,200
竹内製作所	7,800	1,911.00	14,905,800
アマノ	12,200	2,881.00	35,148,200
JUKI	7,200	802.00	5,774,400
サンデンホールディングス	6,800	624.00	4,243,200
蛇の目ミシン工業	4,900	390.00	1,911,000
ブラザー工業	57,000	2,142.00	122,094,000
マックス	7,100	2,007.00	14,249,700
モリタホールディングス	8,100	1,766.00	14,304,600
グローリー	12,000	3,160.00	37,920,000
新晃工業	4,300	1,664.00	7,155,200
大和冷機工業	6,600	1,071.00	7,068,600
セガサミーホールディングス	46,200	1,660.00	76,692,000
日本ピストンリング	1,900	1,432.00	2,720,800
リケン	2,100	3,405.00	7,150,500
T P R	6,200	1,649.00	10,223,800
ツバキ・ナカシマ	9,400	1,198.00	11,261,200
ホシザキ	13,600	10,480.00	142,528,000
大豊工業	3,600	678.00	2,440,800
日本精工	87,800	908.00	79,722,400
NTN	107,700	294.00	31,663,800
ジェイテクト	44,700	1,159.00	51,807,300
不二越	4,300	4,020.00	17,286,000
ミネベアミツミ	86,600	2,172.00	188,095,200
日本トムソン	13,600	429.00	5,834,400
THK	27,100	2,762.00	74,850,200
ユーシン精機	4,100	899.00	3,685,900
前澤給装工業	1,900	2,198.00	4,176,200
イーグル工業	6,400	934.00	5,977,600
前澤工業	2,700	386.00	1,042,200
日本ピラー工業	4,600	1,509.00	6,941,400
キッツ	18,800	712.00	13,385,600
日立製作所	224,300	4,189.00	939,592,700
三菱電機	466,800	1,566.50	731,242,200
富士電機	28,100	3,385.00	95,118,500
東洋電機製造	2,100	1,393.00	2,925,300
安川電機	50,200	3,735.00	187,497,000
シンフォニアテクノロジー	6,000	1,185.00	7,110,000
明電舎	8,500	1,981.00	16,838,500
オリジン	1,100	1,486.00	1,634,600
山洋電気	2,200	5,140.00	11,308,000
デンヨー	3,900	2,041.00	7,959,900
ベイカレント・コンサルティング	2,700	7,880.00	21,276,000
Orchestra Holdings	500	1,014.00	507,000

アイモバイル	800	739.00	591,200
キャリアインデックス	1,400	335.00	469,000
MS - J a p a n	1,600	1,263.00	2,020,800
船場	500	1,076.00	538,000
グレイステクノロジー	2,200	3,205.00	7,051,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,700	2,216.00	10,415,200
フルテック	400	1,130.00	452,000
グリーンズ	1,500	861.00	1,291,500
ツナググループ・ホールディングス	400	584.00	233,600
GameWith	700	736.00	515,200
ソウルドアウト	700	1,834.00	1,283,800
MS&Consulting	500	1,060.00	530,000
ミダック	500	1,207.00	603,500
日総工産	3,300	818.00	2,699,400
キュービーネットホールディングス	1,800	2,280.00	4,104,000
RPAホールディングス	2,400	1,091.00	2,618,400
三櫻工業	6,500	1,014.00	6,591,000
マキタ	60,900	4,130.00	251,517,000
東芝テック	5,800	4,160.00	24,128,000
芝浦メカトロニクス	900	3,390.00	3,051,000
マブチモーター	12,900	4,160.00	53,664,000
日本電産	56,200	14,075.00	791,015,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,200	388.00	853,600
トレックス・セミコンダクター	3,000	1,487.00	4,461,000
東光高岳	2,900	1,142.00	3,311,800
ダブル・スコープ	7,800	745.00	5,811,000
宮越ホールディングス	1,800	841.00	1,513,800
ダイヘン	5,100	3,305.00	16,855,500
ヤーマン	7,500	627.00	4,702,500
JVCケンウッド	37,600	252.00	9,475,200
ミマキエンジニアリング	4,800	499.00	2,395,200
第一精工	2,100	2,435.00	5,113,500
日新電機	10,800	1,121.00	12,106,800
大崎電気工業	10,300	602.00	6,200,600
オムロン	41,800	6,720.00	280,896,000
日東工業	6,800	2,146.00	14,592,800
I D E C	6,700	1,853.00	12,415,100
正興電機製作所	700	1,313.00	919,100
不二電機工業	600	1,205.00	723,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	15,500	2,137.00	33,123,500
サクサホールディングス	1,100	1,839.00	2,022,900
メルコホールディングス	1,600	2,537.00	4,059,200
テクノメディカ	1,000	2,055.00	2,055,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	874.00	437,000
日本電気	56,600	4,795.00	271,397,000
富士通	45,000	12,630.00	568,350,000
沖電気工業	18,900	1,330.00	25,137,000
岩崎通信機	2,400	814.00	1,953,600
電気興業	2,200	3,295.00	7,249,000

サンケン電気	5,100	2,903.00	14,805,300
ナカヨ	800	1,624.00	1,299,200
アイホン	2,900	1,676.00	4,860,400
ルネサスエレクトロニクス	223,000	779.00	173,717,000
セイコーエプソン	57,900	1,691.00	97,908,900
ワコム	31,100	388.00	12,066,800
アルバック	8,600	3,615.00	31,089,000
アクセル	2,300	885.00	2,035,500
E I Z O	3,600	3,730.00	13,428,000
ジャパンディスプレイ	133,400	71.00	9,471,400
日本信号	11,800	1,358.00	16,024,400
京三製作所	10,700	555.00	5,938,500
能美防災	6,100	2,334.00	14,237,400
ホーチキ	3,700	1,375.00	5,087,500
星和電機	2,300	618.00	1,421,400
エレコム	5,100	3,950.00	20,145,000
パナソニック	533,300	1,189.00	634,093,700
シャープ	53,900	1,491.00	80,364,900
アンリツ	30,000	2,023.00	60,690,000
富士通ゼネラル	12,600	2,434.00	30,668,400
ソニー	295,200	7,522.00	2,220,494,400
T D K	22,500	11,450.00	257,625,000
帝国通信工業	2,300	1,230.00	2,829,000
タムラ製作所	15,400	574.00	8,839,600
アルプスアルパイン	41,300	1,836.00	75,826,800
池上通信機	1,300	1,015.00	1,319,500
日本電波工業	3,700	480.00	1,776,000
鈴木	2,200	873.00	1,920,600
日本トリム	700	3,865.00	2,705,500
ローランド ディー . ジー .	2,800	1,835.00	5,138,000
フォスター電機	4,800	1,545.00	7,416,000
S M K	1,300	2,832.00	3,681,600
ヨコオ	3,000	2,954.00	8,862,000
ティアック	3,000	182.00	546,000
ホシデン	12,700	1,094.00	13,893,800
ヒロセ電機	7,200	12,890.00	92,808,000
日本航空電子工業	10,600	1,921.00	20,362,600
T O A	5,600	1,025.00	5,740,000
マクセルホールディングス	10,000	1,413.00	14,130,000
古野電気	5,900	1,059.00	6,248,100
ユニデンホールディングス	1,200	2,050.00	2,460,000
スミダコーポレーション	4,000	1,114.00	4,456,000
アイコム	2,500	2,579.00	6,447,500
リオン	1,900	2,821.00	5,359,900
本多通信工業	3,800	513.00	1,949,400
船井電機	4,500	707.00	3,181,500
横河電機	42,800	1,939.00	82,989,200
新電元工業	1,800	3,420.00	6,156,000
アズビル	29,400	2,937.00	86,347,800

東亜ディーケーケー	2,600	977.00	2,540,200
日本光電工業	19,300	3,510.00	67,743,000
チノー	1,800	1,270.00	2,286,000
共和電業	4,600	433.00	1,991,800
日本電子材料	2,100	999.00	2,097,900
堀場製作所	9,200	6,840.00	62,928,000
アドバンテスト	34,700	5,610.00	194,667,000
小野測器	1,600	583.00	932,800
エスベック	4,100	2,184.00	8,954,400
キーエンス	42,300	38,350.00	1,622,205,000
日置電機	2,400	3,695.00	8,868,000
シスメックス	33,300	7,444.00	247,885,200
日本マイクロニクス	8,000	1,087.00	8,696,000
メガチップス	4,300	1,800.00	7,740,000
OBARA GROUP	2,400	3,090.00	7,416,000
IMAGICA GROUP	3,400	461.00	1,567,400
澤藤電機	400	1,951.00	780,400
デンソー	102,800	4,467.00	459,207,600
原田工業	2,500	957.00	2,392,500
コーセル	6,300	1,143.00	7,200,900
イリソ電子工業	3,900	4,060.00	15,834,000
オプテックスグループ	7,600	1,513.00	11,498,800
千代田インテグレ	2,400	2,118.00	5,083,200
アイ・オー・データ機器	1,700	909.00	1,545,300
レーザーテック	20,500	5,630.00	115,415,000
スタンレー電気	32,800	2,920.00	95,776,000
岩崎電気	2,100	1,634.00	3,431,400
ウシオ電機	27,000	1,475.00	39,825,000
岡谷電機産業	3,100	363.00	1,125,300
ヘリオス テクノ ホールディングス	3,900	395.00	1,540,500
エノモト	1,400	1,209.00	1,692,600
日本セラミック	4,700	2,463.00	11,576,100
遠藤照明	1,900	686.00	1,303,400
古河電池	3,800	700.00	2,660,000
双信電機	1,800	412.00	741,600
山一電機	3,300	1,877.00	6,194,100
函研	3,000	2,426.00	7,278,000
日本電子	9,200	3,365.00	30,958,000
カシオ計算機	41,200	2,100.00	86,520,000
ファナック	44,400	20,470.00	908,868,000
日本シイエムケイ	10,800	560.00	6,048,000
エンブラス	2,300	2,993.00	6,883,900
大真空	1,900	1,714.00	3,256,600
ローム	20,700	8,230.00	170,361,000
浜松ホトニクス	33,500	4,615.00	154,602,500
三井ハイテック	5,100	1,611.00	8,216,100
新光電気工業	15,600	1,361.00	21,231,600
京セラ	65,700	7,472.00	490,910,400
協栄産業	600	1,379.00	827,400

太陽誘電	20,700	3,485.00	72,139,500
村田製作所	137,100	6,289.00	862,221,900
双葉電子工業	7,300	1,185.00	8,650,500
日東電工	32,200	6,000.00	193,200,000
北陸電気工業	2,100	1,041.00	2,186,100
東海理化電機製作所	12,200	1,818.00	22,179,600
ニチコン	15,700	877.00	13,768,900
日本ケミコン	3,900	1,786.00	6,965,400
K O A	7,000	1,185.00	8,295,000
三井E & Sホールディングス	16,700	878.00	14,662,600
日立造船	36,700	424.00	15,560,800
三菱重工業	78,200	3,762.00	294,188,400
川崎重工業	36,300	2,219.00	80,549,700
I H I	33,600	2,737.00	91,963,200
名村造船所	16,800	243.00	4,082,400
サノヤスホールディングス	4,800	172.00	825,600
スプリックス	1,300	980.00	1,274,000
マネジメントソリューションズ	400	3,615.00	1,446,000
日本車輛製造	1,900	2,870.00	5,453,000
三菱ロジスネクスト	6,100	1,679.00	10,241,900
近畿車輛	600	1,357.00	814,200
F P G	14,100	970.00	13,677,000
島根銀行	700	609.00	426,300
じもとホールディングス	29,500	103.00	3,038,500
全国保証	13,000	4,550.00	59,150,000
めぶきフィナンシャルグループ	238,800	234.00	55,879,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	6,100	1,205.00	7,350,500
九州フィナンシャルグループ	75,300	410.00	30,873,000
かんぽ生命保険	16,200	1,821.00	29,500,200
ゆうちょ銀行	130,300	1,008.00	131,342,400
富山第一銀行	12,300	308.00	3,788,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	270,600	420.00	113,652,000
ジェイリース	800	330.00	264,000
西日本フィナンシャルホールディングス	31,200	682.00	21,278,400
マーキュリアインベストメント	1,600	705.00	1,128,000
イントラスト	1,600	779.00	1,246,400
日本モーゲージサービス	900	2,225.00	2,002,500
C a s a	1,800	1,483.00	2,669,400
アルヒ	7,300	1,808.00	13,198,400
プレミアグループ	2,400	2,059.00	4,941,600
日産自動車	550,400	504.40	277,621,760
トヨタ自動車	520,900	7,752.00	4,038,016,800
日野自動車	58,200	1,010.00	58,782,000
三菱自動車工業	172,600	405.00	69,903,000
エフテック	3,700	738.00	2,730,600
レシップホールディングス	1,800	616.00	1,108,800
G M B	700	809.00	566,300
ファルテック	700	984.00	688,800
武蔵精密工業	10,300	1,343.00	13,832,900

日産車体	9,000	1,073.00	9,657,000
新明和工業	12,500	1,286.00	16,075,000
極東開発工業	8,600	1,385.00	11,911,000
日信工業	9,400	2,240.00	21,056,000
トピー工業	4,200	1,720.00	7,224,000
ティラド	1,600	1,770.00	2,832,000
曙ブレーキ工業	25,200	238.00	5,997,600
タチエス	7,600	1,252.00	9,515,200
N O K	25,000	1,564.00	39,100,000
フタバ産業	12,800	620.00	7,936,000
K Y B	5,200	2,725.00	14,170,000
市光工業	7,700	716.00	5,513,200
大同メタル工業	9,900	668.00	6,613,200
プレス工業	22,800	352.00	8,025,600
ミクニ	6,800	320.00	2,176,000
太平洋工業	9,700	1,293.00	12,542,100
ケーヒン	10,700	2,587.00	27,680,900
河西工業	7,000	740.00	5,180,000
アイシン精機	38,400	3,905.00	149,952,000
マツダ	137,200	898.00	123,205,600
今仙電機製作所	4,800	854.00	4,099,200
本田技研工業	367,600	3,041.00	1,117,871,600
スズキ	92,500	4,850.00	448,625,000
S U B A R U	144,900	2,922.50	423,470,250
安永	2,500	1,142.00	2,855,000
ヤマハ発動機	60,800	1,946.00	118,316,800
ショーワ	11,000	2,286.00	25,146,000
小糸製作所	27,900	4,655.00	129,874,500
T B K	6,300	427.00	2,690,100
エクセディ	6,300	2,227.00	14,030,100
ミツバ	8,400	726.00	6,098,400
豊田合成	15,000	2,501.00	37,515,000
愛三工業	8,100	693.00	5,613,300
盟和産業	500	1,056.00	528,000
日本プラスト	4,100	656.00	2,689,600
ヨロズ	4,800	1,446.00	6,940,800
エフ・シー・シー	7,600	2,134.00	16,218,400
新家工業	900	1,398.00	1,258,200
シマノ	17,500	15,550.00	272,125,000
テイ・エス テック	10,800	3,090.00	33,372,000
関西みらいフィナンシャルグループ	26,800	566.00	15,168,800
三十三フィナンシャルグループ	4,200	1,526.00	6,409,200
第四北越フィナンシャルグループ	7,900	2,546.00	20,113,400
ジャムコ	2,600	1,297.00	3,372,200
小野建	4,000	1,273.00	5,092,000
はるやまホールディングス	2,500	842.00	2,105,000
南陽	1,200	1,793.00	2,151,600
ノジマ	8,100	2,137.00	17,309,700
佐鳥電機	3,800	861.00	3,271,800

カップ・クリエイト	6,400	1,448.00	9,267,200
エコートレーディング	1,000	562.00	562,000
伯東	3,100	1,194.00	3,701,400
コンドーテック	4,000	1,166.00	4,664,000
中山福	2,300	509.00	1,170,700
ライトオン	3,200	570.00	1,824,000
ナガイレーベン	6,600	2,343.00	15,463,800
ジーンズメイト	1,300	277.00	360,100
三菱食品	5,000	2,932.00	14,660,000
良品計画	61,000	1,741.00	106,201,000
三城ホールディングス	4,900	309.00	1,514,100
松田産業	3,700	1,499.00	5,546,300
第一興商	6,800	4,795.00	32,606,000
メディカルホールディングス	49,600	2,205.00	109,368,000
アドヴァン	6,900	1,246.00	8,597,400
S P K	1,100	2,623.00	2,885,300
萩原電気ホールディングス	1,900	2,525.00	4,797,500
アルビス	2,000	2,152.00	4,304,000
アズワン	3,000	9,070.00	27,210,000
スズデン	1,500	1,415.00	2,122,500
尾家産業	1,500	1,402.00	2,103,000
シモジマ	3,200	1,104.00	3,532,800
ドウシシャ	4,300	1,568.00	6,742,400
小津産業	1,000	1,689.00	1,689,000
コナカ	6,200	400.00	2,480,000
高速	3,100	1,202.00	3,726,200
ハウス オブ ローゼ	600	1,691.00	1,014,600
G - 7ホールディングス	2,700	2,512.00	6,782,400
たけびし	1,800	1,437.00	2,586,600
イオン北海道	4,400	831.00	3,656,400
コジマ	8,800	490.00	4,312,000
ヒマラヤ	1,900	833.00	1,582,700
コーナン商事	6,500	2,410.00	15,665,000
ネットワークシステムズ	17,400	2,467.00	42,925,800
エコス	1,900	1,671.00	3,174,900
ワタミ	5,400	1,178.00	6,361,200
マルシェ	700	766.00	536,200
リックス	1,000	1,719.00	1,719,000
システムソフト	9,500	94.00	893,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	101,000	1,962.00	198,162,000
丸文	4,600	596.00	2,741,600
西松屋チェーン	10,000	906.00	9,060,000
ゼンショーホールディングス	22,000	2,462.00	54,164,000
ハピネット	4,300	1,274.00	5,478,200
幸楽苑ホールディングス	3,200	1,849.00	5,916,800
ハークスレイ	800	1,135.00	908,000
橋本総業ホールディングス	1,100	1,734.00	1,907,400
日本ライフライン	13,500	1,403.00	18,940,500

サイゼリヤ	7,500	2,282.00	17,115,000
タカショー	1,900	455.00	864,500
エクセル	1,600	1,595.00	2,552,000
V Tホールディングス	18,800	414.00	7,783,200
マルカ	1,800	2,069.00	3,724,200
アルゴグラフィックス	3,900	3,675.00	14,332,500
魚力	1,500	1,600.00	2,400,000
I D O M	12,200	630.00	7,686,000
日本エム・ディ・エム	3,000	1,918.00	5,754,000
ポプラ	700	489.00	342,300
フジ・コーポレーション	1,400	2,010.00	2,814,000
ユナイテッドアローズ	4,800	2,755.00	13,224,000
進和	3,000	2,181.00	6,543,000
エスケイジャパン	900	423.00	380,700
ダイترون	2,200	1,930.00	4,246,000
ハイデイ日高	6,600	1,907.00	12,586,200
シークス	5,800	1,358.00	7,876,400
京都きもの友禅	2,200	325.00	715,000
コロワイド	15,200	2,204.00	33,500,800
ピーシーデポコーポレーション	6,900	583.00	4,022,700
田中商事	1,600	708.00	1,132,800
オーハシテクニカ	2,900	1,482.00	4,297,800
壱番屋	3,200	5,430.00	17,376,000
白銅	1,500	1,408.00	2,112,000
トップカルチャー	1,700	329.00	559,300
P L A N T	700	551.00	385,700
スギホールディングス	9,200	5,430.00	49,956,000
薬王堂ホールディングス	2,200	2,180.00	4,796,000
島津製作所	55,800	2,877.00	160,536,600
J M S	4,400	840.00	3,696,000
クボテック	1,100	388.00	426,800
長野計器	3,200	976.00	3,123,200
バイ・テクノロジー	2,200	4,460.00	9,812,000
スター精密	7,100	1,328.00	9,428,800
東京計器	3,400	898.00	3,053,200
愛知時計電機	700	4,340.00	3,038,000
インターアクション	2,500	2,761.00	6,902,500
オーバル	4,300	231.00	993,300
東京精密	8,400	3,875.00	32,550,000
マニー	18,600	2,548.00	47,392,800
ニコン	75,500	1,195.00	90,222,500
トプコン	23,400	1,227.00	28,711,800
オリンパス	258,300	2,110.00	545,013,000
理研計器	4,100	2,230.00	9,143,000
S C R E E Nホールディングス	8,100	6,210.00	50,301,000
キヤノン電子	4,800	2,027.00	9,729,600
タムロン	3,700	2,698.00	9,982,600
H O Y A	93,200	10,195.00	950,174,000
シード	2,300	961.00	2,210,300

ノーリツ鋼機	3,200	1,510.00	4,832,000
エー・アンド・デイ	4,700	1,008.00	4,737,600
朝日インテック	39,600	2,830.00	112,068,000
キヤノン	251,300	2,787.50	700,498,750
リコー	118,700	1,111.00	131,875,700
シチズン時計	54,500	487.00	26,541,500
リズム時計工業	1,200	880.00	1,056,000
大研医器	3,300	678.00	2,237,400
メニコン	6,400	5,030.00	32,192,000
シンシア	400	555.00	222,000
中本パックス	1,100	1,582.00	1,740,200
スノーピーク	2,400	851.00	2,042,400
パラマウントベッドホールディングス	4,900	4,570.00	22,393,000
トランザクション	3,400	1,073.00	3,648,200
粧美堂	1,600	391.00	625,600
ニホンフラッシュ	2,400	2,549.00	6,117,600
前田工織	5,100	2,131.00	10,868,100
永大産業	7,000	326.00	2,282,000
アートネイチャー	5,600	733.00	4,104,800
バンダイナムコホールディングス	48,300	5,910.00	285,453,000
アイフィスジャパン	900	707.00	636,300
共立印刷	6,000	167.00	1,002,000
S H O E I	2,200	5,370.00	11,814,000
フランスベッドホールディングス	6,500	917.00	5,960,500
マーベラス	7,800	672.00	5,241,600
パイロットコーポレーション	7,600	4,195.00	31,882,000
萩原工業	2,900	1,642.00	4,761,800
エイベックス	7,800	1,241.00	9,679,800
トッパン・フォームズ	9,900	1,155.00	11,434,500
フジシールインターナショナル	10,400	2,108.00	21,923,200
タカラトミー	20,800	1,059.00	22,027,200
廣済堂	3,700	869.00	3,215,300
エステールホールディングス	1,000	682.00	682,000
アーク	16,800	90.00	1,512,000
レック	5,500	1,165.00	6,407,500
タカノ	1,700	741.00	1,259,700
三光合成	4,700	335.00	1,574,500
プロネクサス	4,500	1,132.00	5,094,000
ホクシン	3,100	145.00	449,500
ウッドワン	1,400	1,068.00	1,495,200
大建工業	3,100	1,895.00	5,874,500
きもと	6,100	160.00	976,000
凸版印刷	65,800	2,038.00	134,100,400
大日本印刷	61,100	2,936.00	179,389,600
共同印刷	1,600	2,859.00	4,574,400
N I S S H A	9,500	988.00	9,386,000
光村印刷	300	1,656.00	496,800
藤森工業	4,200	3,285.00	13,797,000
ヴィア・ホールディングス	6,300	656.00	4,132,800

TAKARA & COMPANY	2,500	1,655.00	4,137,500
前澤化成工業	3,300	1,122.00	3,702,600
未来工業	2,800	2,029.00	5,681,200
アシックス	38,500	1,336.00	51,436,000
ツツミ	1,600	1,973.00	3,156,800
ウェーブロックホールディングス	1,900	693.00	1,316,700
J S P	3,000	1,784.00	5,352,000
ニチハ	6,500	2,529.00	16,438,500
エフビコ	5,100	6,890.00	35,139,000
小松ウオール工業	1,600	2,073.00	3,316,800
ヤマハ	27,700	5,880.00	162,876,000
河合楽器製作所	1,600	3,015.00	4,824,000
クリナップ	4,100	600.00	2,460,000
ビジョン	28,200	3,930.00	110,826,000
天馬	3,400	1,915.00	6,511,000
オリバー	1,100	3,725.00	4,097,500
兼松サステック	400	1,825.00	730,000
キングジム	4,400	840.00	3,696,000
象印マホービン	13,600	1,916.00	26,057,600
リンテック	11,100	2,544.00	28,238,400
信越ポリマー	8,300	950.00	7,885,000
東リ	13,000	292.00	3,796,000
イトーキ	11,000	422.00	4,642,000
任天堂	28,600	40,100.00	1,146,860,000
三菱鉛筆	7,600	1,590.00	12,084,000
松風	2,400	1,959.00	4,701,600
タカラスタンダード	9,600	1,716.00	16,473,600
コクヨ	22,300	1,589.00	35,434,700
ナカバヤシ	5,200	603.00	3,135,600
ニフコ	17,100	2,852.00	48,769,200
立川ブラインド工業	2,300	1,213.00	2,789,900
グローブライド	2,300	2,208.00	5,078,400
オカムラ	16,200	1,006.00	16,297,200
バルカー	3,700	2,318.00	8,576,600
MUTOHホールディングス	500	1,688.00	844,000
伊藤忠商事	321,600	2,604.50	837,607,200
丸紅	478,500	789.50	377,775,750
スクロール	8,000	344.00	2,752,000
高島	700	1,894.00	1,325,800
ヨンドシーホールディングス	4,600	2,297.00	10,566,200
三陽商会	2,300	1,523.00	3,502,900
長瀬産業	25,800	1,437.00	37,074,600
ナイガイ	1,200	422.00	506,400
蝶理	3,200	2,100.00	6,720,000
豊田通商	51,300	3,690.00	189,297,000
オンワードホールディングス	27,300	612.00	16,707,600
三共生興	6,900	549.00	3,788,100
兼松	17,100	1,286.00	21,990,600
美津濃	4,200	2,505.00	10,521,000

ツカモトコーポレーション	900	1,132.00	1,018,800
ファミリーマート	36,700	2,508.00	92,043,600
ルックホールディングス	1,300	1,022.00	1,328,600
三井物産	404,100	1,929.50	779,710,950
日本紙パルプ商事	2,600	3,860.00	10,036,000
東京エレクトロン	31,100	25,165.00	782,631,500
日立ハイテク	16,000	8,020.00	128,320,000
カメイ	5,900	1,097.00	6,472,300
東都水産	500	2,856.00	1,428,000
OU Gホールディングス	600	2,601.00	1,560,600
スターゼン	1,700	4,405.00	7,488,500
セイコーホールディングス	6,600	2,287.00	15,094,200
山善	17,800	1,006.00	17,906,800
椿本興業	900	3,990.00	3,591,000
住友商事	290,100	1,649.50	478,519,950
日本ユニシス	14,300	3,750.00	53,625,000
内田洋行	1,900	6,020.00	11,438,000
三菱商事	322,600	2,852.00	920,055,200
第一実業	2,200	3,530.00	7,766,000
キャノンマーケティングジャパン	13,100	2,731.00	35,776,100
西華産業	2,900	1,300.00	3,770,000
佐藤商事	4,200	919.00	3,859,800
菱洋エレクトロ	4,600	1,923.00	8,845,800
東京産業	4,700	585.00	2,749,500
ユアサ商事	4,300	3,320.00	14,276,000
神鋼商事	1,100	2,391.00	2,630,100
小林産業	2,600	285.00	741,000
阪和興業	8,500	2,496.00	21,216,000
正栄食品工業	2,900	3,730.00	10,817,000
カナデン	4,100	1,307.00	5,358,700
菱電商事	3,200	1,644.00	5,260,800
ニプロ	32,200	1,240.00	39,928,000
フルサト工業	2,800	1,623.00	4,544,400
岩谷産業	10,200	3,650.00	37,230,000
すてきなイスグループ	2,200	1,136.00	2,499,200
昭光通商	1,300	680.00	884,000
ニチモウ	700	1,983.00	1,388,100
極東貿易	1,500	1,895.00	2,842,500
イワキ	5,700	503.00	2,867,100
兼松エレクトロニクス	2,500	3,390.00	8,475,000
三愛石油	11,200	1,064.00	11,916,800
稲畑産業	10,100	1,439.00	14,533,900
G S Iクレオス	900	1,209.00	1,088,100
明和産業	4,100	570.00	2,337,000
クワザワ	1,300	621.00	807,300
キムラタン	14,500	27.00	391,500
ゴールドウイン	8,300	7,170.00	59,511,000
ユニ・チャーム	90,000	3,945.00	355,050,000
デサント	9,800	1,633.00	16,003,400

キング	1,700	561.00	953,700
ワキタ	9,700	1,020.00	9,894,000
ヤマトインターナショナル	2,200	405.00	891,000
東邦ホールディングス	14,700	2,242.00	32,957,400
サンゲツ	12,600	1,795.00	22,617,000
ミツウロコグループホールディングス	6,700	1,143.00	7,658,100
シナネンホールディングス	1,800	2,154.00	3,877,200
伊藤忠エネクス	10,000	920.00	9,200,000
サンリオ	12,900	1,967.00	25,374,300
サンワテクノス	3,600	891.00	3,207,600
リョーサン	5,000	2,413.00	12,065,000
新光商事	7,100	792.00	5,623,200
トーヨー	2,300	1,748.00	4,020,400
三信電気	2,800	1,616.00	4,524,800
東陽テクニカ	5,200	1,038.00	5,397,600
モスフードサービス	6,000	2,988.00	17,928,000
加賀電子	4,500	2,285.00	10,282,500
三益半導体工業	3,600	2,226.00	8,013,600
ソーダニッカ	5,400	582.00	3,142,800
立花エレテック	3,300	1,721.00	5,679,300
木曽路	6,000	2,847.00	17,082,000
S R Sホールディングス	6,000	1,038.00	6,228,000
千趣会	9,300	518.00	4,817,400
タカキュー	3,300	181.00	597,300
ケーヨー	10,500	546.00	5,733,000
上新電機	5,400	2,017.00	10,891,800
日本瓦斯	7,200	3,730.00	26,856,000
ロイヤルホールディングス	8,000	2,128.00	17,024,000
東天紅	300	1,251.00	375,300
いなげや	5,600	1,357.00	7,599,200
島忠	8,600	3,005.00	25,843,000
チヨダ	4,700	1,459.00	6,857,300
ライフコーポレーション	3,400	2,589.00	8,802,600
リンガーハット	5,600	2,407.00	13,479,200
Mr Max HD	7,100	473.00	3,358,300
テンアライド	4,900	435.00	2,131,500
A O K Iホールディングス	9,100	1,019.00	9,272,900
オークワ	7,100	1,464.00	10,394,400
コメリ	7,000	2,209.00	15,463,000
青山商事	9,400	1,286.00	12,088,400
しまむら	5,300	7,720.00	40,916,000
はせがわ	2,100	395.00	829,500
高島屋	33,400	1,116.00	37,274,400
松屋	9,100	776.00	7,061,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	21,700	936.00	20,311,200
近鉄百貨店	1,900	3,420.00	6,498,000
丸井グループ	42,100	2,371.00	99,819,100
クレディセゾン	32,200	1,834.00	59,054,800
アクシアル リテイリング	3,800	3,695.00	14,041,000

井筒屋	1,700	232.00	394,400
イオン	176,900	2,300.00	406,870,000
イズミ	9,300	3,325.00	30,922,500
フォーバル	1,900	1,133.00	2,152,700
平和堂	9,300	1,859.00	17,288,700
フジ	5,500	1,824.00	10,032,000
ヤオコー	5,200	5,800.00	30,160,000
ゼビオホールディングス	6,100	1,100.00	6,710,000
ケーズホールディングス	44,300	1,316.00	58,298,800
PALTAC	7,300	5,020.00	36,646,000
三谷産業	5,900	353.00	2,082,700
Olympicグループ	1,900	586.00	1,113,400
日産東京販売ホールディングス	5,900	257.00	1,516,300
新生銀行	33,700	1,690.00	56,953,000
あおぞら銀行	27,400	3,030.00	83,022,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,169,700	562.80	1,783,907,160
りそなホールディングス	505,100	439.30	221,890,430
三井住友トラスト・ホールディングス	87,000	4,001.00	348,087,000
三井住友フィナンシャルグループ	318,400	3,751.00	1,194,318,400
千葉銀行	158,200	605.00	95,711,000
群馬銀行	90,200	357.00	32,201,400
武蔵野銀行	6,800	1,657.00	11,267,600
千葉興業銀行	14,100	332.00	4,681,200
筑波銀行	21,300	196.00	4,174,800
七十七銀行	15,500	1,566.00	24,273,000
青森銀行	3,500	2,573.00	9,005,500
秋田銀行	2,900	1,888.00	5,475,200
山形銀行	5,100	1,367.00	6,971,700
岩手銀行	3,000	2,543.00	7,629,000
東邦銀行	40,700	243.00	9,890,100
東北銀行	2,500	1,016.00	2,540,000
みちのく銀行	3,300	1,333.00	4,398,900
ふくおかフィナンシャルグループ	38,700	1,846.00	71,440,200
静岡銀行	113,900	751.00	85,538,900
十六銀行	5,700	2,071.00	11,804,700
スルガ銀行	46,900	436.00	20,448,400
八十二銀行	110,900	403.00	44,692,700
山梨中央銀行	5,900	917.00	5,410,300
大垣共立銀行	9,000	2,232.00	20,088,000
福井銀行	4,300	1,550.00	6,665,000
北國銀行	4,700	3,130.00	14,711,000
清水銀行	2,100	1,947.00	4,088,700
富山銀行	1,000	1,968.00	1,968,000
滋賀銀行	9,200	2,624.00	24,140,800
南都銀行	7,600	2,475.00	18,810,000
百五銀行	41,100	316.00	12,987,600
京都銀行	16,500	4,200.00	69,300,000
紀陽銀行	16,200	1,589.00	25,741,800
ほくほくフィナンシャルグループ	30,500	1,008.00	30,744,000

広島銀行	67,800	520.00	35,256,000
山陰合同銀行	27,100	609.00	16,503,900
中国銀行	39,500	947.00	37,406,500
鳥取銀行	1,800	1,311.00	2,359,800
伊予銀行	65,500	535.00	35,042,500
百十四銀行	4,800	2,002.00	9,609,600
四国銀行	6,900	917.00	6,327,300
阿波銀行	7,500	2,372.00	17,790,000
大分銀行	2,900	2,273.00	6,591,700
宮崎銀行	3,000	2,351.00	7,053,000
佐賀銀行	3,100	1,501.00	4,653,100
沖縄銀行	4,200	3,320.00	13,944,000
琉球銀行	10,500	1,051.00	11,035,500
セブン銀行	153,500	319.00	48,966,500
みずほフィナンシャルグループ	6,256,600	158.70	992,922,420
高知銀行	1,300	786.00	1,021,800
山口フィナンシャルグループ	57,300	647.00	37,073,100
芙蓉総合リース	4,800	6,920.00	33,216,000
みずほリース	7,100	3,220.00	22,862,000
東京センチュリー	9,300	5,130.00	47,709,000
SBIホールディングス	51,400	2,462.00	126,546,800
日本証券金融	20,100	498.00	10,009,800
アイフル	69,900	302.00	21,109,800
日本アジア投資	4,000	264.00	1,056,000
長野銀行	1,700	1,466.00	2,492,200
名古屋銀行	3,700	3,380.00	12,506,000
北洋銀行	68,900	227.00	15,640,300
愛知銀行	1,800	3,395.00	6,111,000
中京銀行	2,100	2,202.00	4,624,200
大光銀行	1,500	1,598.00	2,397,000
愛媛銀行	6,300	1,076.00	6,778,800
トマト銀行	2,000	1,038.00	2,076,000
京葉銀行	19,400	570.00	11,058,000
栃木銀行	24,700	194.00	4,791,800
北日本銀行	1,600	2,065.00	3,304,000
東和銀行	7,900	774.00	6,114,600
福島銀行	3,400	212.00	720,800
大東銀行	2,800	617.00	1,727,600
リコーリース	3,600	4,215.00	15,174,000
イオンフィナンシャルサービス	28,100	1,819.00	51,113,900
アコム	92,300	522.00	48,180,600
ジャックス	5,000	2,470.00	12,350,000
オリエントコーポレーション	123,900	160.00	19,824,000
日立キャピタル	10,800	3,085.00	33,318,000
アプラスフィナンシャル	19,900	82.00	1,631,800
オリックス	288,000	1,925.00	554,400,000
三菱UFJリース	116,700	699.00	81,573,300
ジャフコ	7,100	4,680.00	33,228,000
九州リースサービス	1,700	604.00	1,026,800

トモニホールディングス	35,300	340.00	12,002,000
大和証券グループ本社	369,300	537.20	198,387,960
野村ホールディングス	810,000	564.40	457,164,000
岡三証券グループ	39,000	393.00	15,327,000
丸三証券	13,500	505.00	6,817,500
東洋証券	18,700	149.00	2,786,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	52,600	322.00	16,937,200
光世証券	900	591.00	531,900
水戸証券	12,700	222.00	2,819,400
いちよし証券	9,600	615.00	5,904,000
松井証券	26,200	897.00	23,501,400
S O M P Oホールディングス	86,600	4,367.00	378,182,200
だいこう証券ビジネス	2,600	669.00	1,739,400
日本取引所グループ	132,100	1,980.00	261,558,000
マネックスグループ	34,300	251.00	8,609,300
極東証券	6,900	755.00	5,209,500
岩井コスモホールディングス	4,800	1,267.00	6,081,600
藍澤證券	8,100	693.00	5,613,300
フィデアホールディングス	49,500	121.00	5,989,500
池田泉州ホールディングス	52,400	188.00	9,851,200
アニコム ホールディングス	3,800	3,910.00	14,858,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	120,400	3,738.00	450,055,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	37,800	2,387.00	90,228,600
マネーパートナーズグループ	4,400	227.00	998,800
スパークス・グループ	17,800	262.00	4,663,600
小林洋行	1,300	264.00	343,200
第一生命ホールディングス	260,500	1,629.50	424,484,750
東京海上ホールディングス	164,600	6,126.00	1,008,339,600
アドバンテッジリスクマネジメント	2,200	870.00	1,914,000
イー・ギャランティ	4,800	1,295.00	6,216,000
アサックス	2,800	710.00	1,988,000
N E Cキャピタルソリューション	2,100	2,435.00	5,113,500
T & Dホールディングス	137,500	1,215.00	167,062,500
アドバンスクリエイト	1,200	1,816.00	2,179,200
三井不動産	227,100	2,943.00	668,355,300
三菱地所	322,600	2,140.00	690,364,000
平和不動産	8,400	3,430.00	28,812,000
東京建物	50,300	1,724.00	86,717,200
ダイビル	11,800	1,382.00	16,307,600
京阪神ビルディング	7,400	1,475.00	10,915,000
住友不動産	103,500	3,990.00	412,965,000
太平洋興発	1,500	762.00	1,143,000
テーオーシー	8,900	844.00	7,511,600
東京楽天地	800	5,590.00	4,472,000
レオバレス2 1	60,000	404.00	24,240,000
スターツコーポレーション	6,200	2,587.00	16,039,400
フジ住宅	5,200	658.00	3,421,600
空港施設	4,200	523.00	2,196,600
明和地所	2,100	625.00	1,312,500

ゴールドクレスト	3,600	1,896.00	6,825,600
リログループ	24,300	2,587.00	62,864,100
エスリード	2,000	1,880.00	3,760,000
日神グループホールディングス	7,600	533.00	4,050,800
日本エスコン	8,200	896.00	7,347,200
タカラレーベン	20,800	490.00	10,192,000
A V A N T I A	2,900	950.00	2,755,000
イオンモール	23,000	1,826.00	41,998,000
毎日コムネット	600	906.00	543,600
ファースト住建	1,900	1,248.00	2,371,200
ランド	239,500	10.00	2,395,000
カチタス	5,700	3,975.00	22,657,500
東祥	2,700	1,978.00	5,340,600
トーセイ	6,300	1,358.00	8,555,400
穴吹興産	1,000	1,637.00	1,637,000
サンフロンティア不動産	6,300	1,264.00	7,963,200
エフ・ジェー・ネクスト	4,500	1,109.00	4,990,500
インテリックス	1,300	666.00	865,800
ランドビジネス	1,700	738.00	1,254,600
日本社宅サービス	1,000	1,025.00	1,025,000
グランディハウス	3,400	441.00	1,499,400
東武鉄道	49,200	3,590.00	176,628,000
相鉄ホールディングス	14,900	2,707.00	40,334,300
東急	117,700	1,856.00	218,451,200
京浜急行電鉄	59,900	1,814.00	108,658,600
小田急電鉄	69,400	2,304.00	159,897,600
京王電鉄	24,200	5,840.00	141,328,000
京成電鉄	32,500	3,915.00	127,237,500
富士急行	6,300	3,380.00	21,294,000
新京成電鉄	1,400	2,391.00	3,347,400
東日本旅客鉄道	82,200	9,014.00	740,950,800
西日本旅客鉄道	41,600	8,732.00	363,251,200
東海旅客鉄道	38,800	20,725.00	804,130,000
西武ホールディングス	62,600	1,675.00	104,855,000
鴻池運輸	7,400	1,471.00	10,885,400
西日本鉄道	12,900	2,600.00	33,540,000
ハマキョウレックス	3,500	3,170.00	11,095,000
サカイ引越センター	2,400	6,060.00	14,544,000
近鉄グループホールディングス	44,200	5,170.00	228,514,000
阪急阪神ホールディングス	58,900	4,005.00	235,894,500
南海電気鉄道	20,900	2,655.00	55,489,500
京阪ホールディングス	19,700	4,755.00	93,673,500
神戸電鉄	1,200	3,955.00	4,746,000
名古屋鉄道	36,300	3,065.00	111,259,500
山陽電気鉄道	3,100	2,108.00	6,534,800
トランコム	1,200	7,780.00	9,336,000
日本通運	15,600	5,890.00	91,884,000
ヤマトホールディングス	77,500	1,927.00	149,342,500
山九	12,300	5,100.00	62,730,000

日新	3,800	1,688.00	6,414,400
丸運	2,800	308.00	862,400
丸全昭和運輸	3,500	2,763.00	9,670,500
センコーグループホールディングス	24,200	867.00	20,981,400
トナミホールディングス	1,000	4,855.00	4,855,000
ニッコンホールディングス	15,800	2,404.00	37,983,200
日本石油輸送	400	3,095.00	1,238,000
福山通運	5,600	3,595.00	20,132,000
セイノーホールディングス	33,000	1,341.00	44,253,000
エスライン	1,100	985.00	1,083,500
神奈川中央交通	1,200	3,925.00	4,710,000
日立物流	8,100	3,110.00	25,191,000
丸和運輸機関	4,600	1,992.00	9,163,200
C & F ロジホールディングス	4,900	1,265.00	6,198,500
日本郵船	36,900	1,746.00	64,427,400
商船三井	27,900	2,565.00	71,563,500
川崎汽船	13,500	1,486.00	20,061,000
N S ユナイテッド海運	2,700	1,844.00	4,978,800
明治海運	5,400	355.00	1,917,000
飯野海運	20,600	357.00	7,354,200
共栄タンカー	600	922.00	553,200
九州旅客鉄道	39,400	3,620.00	142,628,000
S G ホールディングス	46,400	2,229.00	103,425,600
日本航空	79,600	2,998.50	238,680,600
A N A ホールディングス	80,800	3,272.00	264,377,600
バスコ	1,000	1,932.00	1,932,000
西本W i s m e t t a c ホールディングス	900	3,145.00	2,830,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,097.00	838,800
Genky Drug Stores	2,000	1,947.00	3,894,000
国際紙パルプ商事	12,200	288.00	3,513,600
ナルミヤ・インターナショナル	600	1,165.00	699,000
総合メディカルホールディングス	4,000	2,547.00	10,188,000
ブックオフグループホールディングス	2,600	926.00	2,407,600
三菱倉庫	14,000	2,908.00	40,712,000
三井倉庫ホールディングス	5,000	1,738.00	8,690,000
住友倉庫	16,200	1,440.00	23,328,000
澁澤倉庫	2,700	2,071.00	5,591,700
ヤマタネ	2,600	1,476.00	3,837,600
東陽倉庫	9,000	310.00	2,790,000
乾汽船	2,400	1,191.00	2,858,400
日本トランスシティ	10,800	477.00	5,151,600
ケイヒン	600	1,348.00	808,800
中央倉庫	3,000	1,131.00	3,393,000
川西倉庫	700	1,035.00	724,500
安田倉庫	4,100	1,003.00	4,112,300
ファイズホールディングス	500	808.00	404,000
東洋埠頭	1,200	1,373.00	1,647,600
宇徳	4,300	510.00	2,193,000
上組	25,300	2,266.00	57,329,800

サンリツ	1,200	665.00	798,000
キムラユニティー	1,400	1,098.00	1,537,200
キューソー流通システム	1,300	1,883.00	2,447,900
近鉄エクスプレス	9,300	1,897.00	17,642,100
東海運	2,700	282.00	761,400
エーアイティー	3,500	960.00	3,360,000
内外トランスライン	1,500	1,205.00	1,807,500
ショーエイコーポレーション	200	856.00	171,200
日本コンセプト	1,400	1,402.00	1,962,800
東京放送ホールディングス	27,800	1,898.00	52,764,400
日本テレビホールディングス	38,200	1,458.00	55,695,600
朝日放送グループホールディングス	4,300	720.00	3,096,000
テレビ朝日ホールディングス	12,500	2,027.00	25,337,500
スカパーJ S A Tホールディングス	29,900	469.00	14,023,100
テレビ東京ホールディングス	3,700	2,365.00	8,750,500
日本BS放送	1,800	1,234.00	2,221,200
ビジョン	4,700	1,115.00	5,240,500
スマートバリュー	1,600	869.00	1,390,400
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	1,684.00	2,862,800
ワイヤレスゲート	2,200	582.00	1,280,400
コネクシオ	2,600	1,531.00	3,980,600
日本通信	35,200	215.00	7,568,000
クロップス	800	725.00	580,000
日本電信電話	612,400	2,776.00	1,700,022,400
KDDI	341,400	3,409.00	1,163,832,600
ソフトバンク	416,300	1,484.50	617,997,350
光通信	4,700	23,170.00	108,899,000
NTTドコモ	338,400	3,131.00	1,059,530,400
エムティーアイ	5,000	648.00	3,240,000
GMOインターネット	18,000	2,076.00	37,368,000
ファイバーゲート	800	1,256.00	1,004,800
アйдママーケティングコミュニケーション	1,400	568.00	795,200
KADOKAWA	12,300	1,645.00	20,233,500
学研ホールディングス	1,500	7,160.00	10,740,000
ゼンリン	9,100	1,460.00	13,286,000
昭文社	1,500	367.00	550,500
インプレスホールディングス	3,200	166.00	531,200
東京電力ホールディングス	372,500	436.00	162,410,000
中部電力	142,800	1,521.00	217,198,800
関西電力	176,800	1,268.00	224,182,400
中国電力	64,500	1,470.00	94,815,000
北陸電力	42,600	831.00	35,400,600
東北電力	116,500	1,021.00	118,946,500
四国電力	41,900	876.00	36,704,400
九州電力	96,100	853.00	81,973,300
北海道電力	43,500	519.00	22,576,500
沖縄電力	8,600	2,009.00	17,277,400
電源開発	37,100	2,526.00	93,714,600
エフオン	2,200	657.00	1,445,400

イーレックス	6,600	1,480.00	9,768,000
レノバ	7,600	1,132.00	8,603,200
東京瓦斯	89,700	2,379.00	213,396,300
大阪瓦斯	90,500	1,875.00	169,687,500
東邦瓦斯	22,900	4,090.00	93,661,000
北海道瓦斯	2,800	1,600.00	4,480,000
広島ガス	9,100	339.00	3,084,900
西部瓦斯	5,200	2,360.00	12,272,000
静岡ガス	13,100	954.00	12,497,400
メタウォーター	2,200	4,100.00	9,020,000
アイネット	2,300	1,468.00	3,376,400
松竹	3,000	13,870.00	41,610,000
東宝	27,400	3,870.00	106,038,000
エイチ・アイ・エス	6,900	2,485.00	17,146,500
東映	1,700	13,960.00	23,732,000
ラックランド	1,200	2,129.00	2,554,800
エヌ・ティ・ティ・データ	121,900	1,455.00	177,364,500
共立メンテナンス	7,400	4,040.00	29,896,000
イチネンホールディングス	4,900	1,375.00	6,737,500
建設技術研究所	3,000	2,220.00	6,660,000
スペース	3,200	1,154.00	3,692,800
長大	1,600	1,078.00	1,724,800
アインホールディングス	5,600	6,780.00	37,968,000
燦ホールディングス	1,800	1,564.00	2,815,200
ピー・シー・エー	700	4,120.00	2,884,000
スバル興業	300	8,640.00	2,592,000
東京テアトル	1,600	1,316.00	2,105,600
タナベ経営	700	1,294.00	905,800
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,804.00	1,962,800
ナガワ	1,400	6,620.00	9,268,000
よみうりランド	1,100	4,095.00	4,504,500
東京都競馬	2,900	3,675.00	10,657,500
常磐興産	1,700	1,621.00	2,755,700
カナモト	7,300	2,654.00	19,374,200
東京ドーム	18,000	967.00	17,406,000
D T S	10,200	2,190.00	22,338,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	19,500	4,960.00	96,720,000
シーイーシー	4,900	1,938.00	9,496,200
カプコン	21,600	3,455.00	74,628,000
西尾レントオール	4,500	2,926.00	13,167,000
アイ・エス・ビー	1,000	2,322.00	2,322,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	30.00	870,000
日本空港ビルデング	14,700	5,170.00	75,999,000
トランス・コスモス	4,200	2,652.00	11,138,400
乃村工藝社	19,000	1,181.00	22,439,000
ジャステック	2,800	1,044.00	2,923,200
S C S K	10,600	6,240.00	66,144,000
藤田観光	1,900	2,467.00	4,687,300
K N T - C Tホールディングス	3,100	1,146.00	3,552,600

日本管財	4,700	1,901.00	8,934,700
トーカイ	4,300	2,462.00	10,586,600
白洋舎	400	2,766.00	1,106,400
セコム	47,300	9,641.00	456,019,300
日本システムウエア	1,700	2,289.00	3,891,300
セントラル警備保障	2,100	5,460.00	11,466,000
アイネス	4,400	1,680.00	7,392,000
丹青社	8,300	1,149.00	9,536,700
メイテック	5,500	5,640.00	31,020,000
T K C	3,900	5,300.00	20,670,000
富士ソフト	5,800	4,115.00	23,867,000
応用地質	4,700	1,418.00	6,664,600
船井総研ホールディングス	9,200	2,981.00	27,425,200
N S D	14,700	1,894.00	27,841,800
進学会ホールディングス	1,400	510.00	714,000
丸紅建材リース	400	1,829.00	731,600
オオバ	3,900	714.00	2,784,600
コナミホールディングス	16,600	4,375.00	72,625,000
いであ	800	1,934.00	1,547,200
学究社	1,300	1,350.00	1,755,000
ベネッセホールディングス	14,800	2,952.00	43,689,600
イオンディライト	5,500	3,760.00	20,680,000
ナック	2,400	995.00	2,388,000
福井コンピュータホールディングス	2,000	3,130.00	6,260,000
ニチイ学館	6,300	1,334.00	8,404,200
ダイセキ	7,400	2,923.00	21,630,200
ステップ	1,900	1,648.00	3,131,200
日鉄物産	3,300	4,575.00	15,097,500
泉州電業	1,600	2,976.00	4,761,600
元気寿司	1,100	2,906.00	3,196,600
トラスコ中山	9,500	2,357.00	22,391,500
ヤマダ電機	139,900	594.00	83,100,600
オートバックスセブン	17,000	1,539.00	26,163,000
モリト	3,800	792.00	3,009,600
アークランドサカモト	7,100	1,181.00	8,385,100
ニトリホールディングス	19,900	16,560.00	329,544,000
グルメ杵屋	3,700	1,161.00	4,295,700
愛眼	3,800	242.00	919,600
ケーユーホールディングス	2,700	881.00	2,378,700
吉野家ホールディングス	15,100	2,529.00	38,187,900
加藤産業	7,200	3,465.00	24,948,000
北恵	700	925.00	647,500
イノテック	2,600	1,086.00	2,823,600
イエローハット	8,600	1,645.00	14,147,000
松屋フーズホールディングス	2,200	4,460.00	9,812,000
J B C Cホールディングス	3,400	1,927.00	6,551,800
J Kホールディングス	4,700	743.00	3,492,100
サガミホールディングス	6,100	1,323.00	8,070,300
日伝	4,100	1,942.00	7,962,200

関西スーパーマーケット	4,300	1,001.00	4,304,300
ミロク情報サービス	4,000	2,650.00	10,600,000
北沢産業	4,000	255.00	1,020,000
杉本商事	2,800	1,892.00	5,297,600
因幡電機産業	13,000	2,615.00	33,995,000
王将フードサービス	3,400	6,430.00	21,862,000
ブレナス	5,100	1,930.00	9,843,000
ミニストップ	3,800	1,522.00	5,783,600
アークス	9,300	1,915.00	17,809,500
パローホールディングス	10,100	1,801.00	18,190,100
東テク	1,700	2,453.00	4,170,100
ミスミグループ本社	57,600	2,661.00	153,273,600
藤久	500	689.00	344,500
アルテック	2,400	252.00	604,800
ベルク	2,300	5,590.00	12,857,000
大庄	2,700	1,626.00	4,390,200
タキヒヨー	1,600	1,825.00	2,920,000
ファーストリテイリング	6,100	59,640.00	363,804,000
ソフトバンクグループ	363,500	5,531.00	2,010,518,500
蔵王産業	1,000	1,450.00	1,450,000
スズケン	19,400	4,005.00	77,697,000
サンドラッグ	17,300	3,295.00	57,003,500
サクスパー ホールディングス	4,400	802.00	3,528,800
ジェコス	3,000	1,034.00	3,102,000
ヤマザワ	1,200	1,667.00	2,000,400
やまや	1,100	2,206.00	2,426,600
グローセル	4,400	441.00	1,940,400
ベルーナ	9,700	614.00	5,955,800
合計	55,267,000		110,153,135,760

株式以外の有価証券
該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当する事項はありません。

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関係に関する注記）」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」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		6,348,210	2,193,267
コール・ローン		765,794,398	808,902,078
国債証券		126,300,082,900	135,081,132,800

地方債証券		9,741,616,281	9,700,662,103
特殊債証券		13,775,783,507	13,708,471,504
社債証券		5,250,780,400	4,978,917,600
未収利息		425,665,291	411,280,355
前払費用		4,497,000	4,045,662
流動資産合計		156,270,567,987	164,695,605,369
資産合計		156,270,567,987	164,695,605,369
負債の部			
流動負債			
未払金		355,226,000	
未払解約金		26,530,212	127,274,325
未払利息		1,953	2,233
その他未払費用		1,342	463
流動負債合計		381,759,507	127,277,021
負債合計		381,759,507	127,277,021
純資産の部			
元本等			
元本	1	121,137,400,893	126,399,340,034
剰余金			
剰余金又は欠損金()		34,751,407,587	38,168,988,314
元本等合計		155,888,808,480	164,568,328,348
純資産合計		155,888,808,480	164,568,328,348
負債純資産合計		156,270,567,987	164,695,605,369

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

(2) 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、地方債証券、特殊債証券、社債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 期首元本額	99,715,707,801円	121,137,400,893円
期中追加設定元本額	55,349,194,064円	31,973,219,496円
期中一部解約元本額	33,927,500,972円	26,711,280,355円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン(ステイブル)	1,020,195,393円	1,193,048,988円
日本債券インデックス・ファンド(年金1) < 適格機関投資家限定 >	3,615,695,748円	3,652,715,270円

バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	21,900,440円	13,498,572円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	663,477,977円	409,816,976円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	437,092円	455,834円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	13,505,890円	13,844,979円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	29,841,502円	24,333,460円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	14,495,610,506円	13,849,417,700円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	12,865,543円	11,829,829円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	6,841,375,099円	6,149,913,498円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	2,419,966,112円	2,302,327,332円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	15,921,237円	16,955,879円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	474,719,901円	1,778,372,272円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,221,078,550円	7,173,592,737円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	939,989,765円	2,012,903,862円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	7,361,808,915円	6,628,702,462円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	188,030,514円	173,169,953円
世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	578,297,898円	円
日本債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	155,553,273円	135,809,695円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	70,703,672円	72,808,304円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	39,696,976円	39,196,026円
日本債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	6,792,854,941円	9,967,102,172円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	49,375,605円	68,580,632円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	3,874,480,652円	3,557,977,951円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	28,932,161円	21,916,306円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	13,388,464円	13,785,032円
バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	1,436,495,240円	円

日本債券インデックス・ファンドVA 3 <適格機関投資家限定>	7,123,113,299円	9,561,789,554円
日本債券インデックス・ファンド<適 格機関投資家限定>	1,810,746,155円	187,968,773円
4資産インデックスバランスVA20 <適格機関投資家限定>	3,001,698,395円	2,813,649,761円
世界分散ファンドVA25A <適格機 関投資家限定>	11,140,648,736円	10,275,351,870円
4資産インデックスバランスVA50 <適格機関投資家限定>	15,375,763円	14,633,603円
Tadリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド(ステイブル)年金<適 格機関投資家限定>	401,942,513円	494,605,521円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド (年金)<適格機関投資家限定>	935,906,250円	719,264,443円
Tadリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド(ステイブル)<適格機 関投資家限定>	355,242,299円	429,392,051円
ステート・ストリート日本債券イン デックス・オープン	1,536,983,302円	1,733,364,130円
日本債券インデックス・ファンドF< 適格機関投資家限定>	37,553,578,731円	38,562,909,056円
グローバルバランス40VA<適格機 関投資家限定>	5,252,354円	2,958,334円
グローバルバランス40VA2<適格 機関投資家限定>	2,310,346,637円	2,159,488,345円
グローバルバランス40VA3<適格 機関投資家限定>	118,121,700円	116,609,472円
グローバルバランス50VA<適格機 関投資家限定>	44,733,785円	45,279,400円
ワールドバランスVA0902<適格 機関投資家限定>	89,088,574円	円
世界株式VCファンド<適格機関投資 家限定>	1,318,423,334円	円
計	121,137,400,893円	126,399,340,034円
2 受益権の総数	121,137,400,893口	126,399,340,034口

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引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。
----------------	---

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	<p>貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ</p> <p>ん。</p>	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、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、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 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
---------------------------	---	----

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	945,190,300	924,499,900
地方債証券	4,122,583	2,888,315
特殊債券	2,697,583	3,120,658
社債券	9,510,600	29,488,900
合計	942,499,866	954,221,143

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	1.2869円	1.3020円
(1万口当たり純資産額)	(12,869円)	(13,020円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第100回利付国債(20年)	200,000,000	237,732,000	
	第101回利付国債(20年)	100,000,000	120,496,000	
	第102回利付国債(20年)	200,000,000	242,080,000	
	第103回利付国債(20年)	200,000,000	240,400,000	
	第104回利付国債(20年)	150,000,000	177,780,000	
	第105回利付国債(20年)	100,000,000	118,983,000	
	第106回利付国債(20年)	200,000,000	239,696,000	
	第107回利付国債(20年)	200,000,000	238,866,000	
	第108回利付国債(20年)	100,000,000	117,654,000	
	第109回利付国債(20年)	200,000,000	235,978,000	

第10回利付国債(40年)	100,000,000	118,242,000	
第110回利付国債(20年)	200,000,000	239,632,000	
第111回利付国債(20年)	200,000,000	242,390,000	
第112回利付国債(20年)	200,000,000	240,514,000	
第113回利付国債(20年)	200,000,000	241,500,000	
第114回利付国債(20年)	300,000,000	363,519,000	
第115回利付国債(20年)	500,000,000	610,800,000	
第116回利付国債(20年)	500,000,000	612,970,000	
第118回利付国債(20年)	300,000,000	362,892,000	
第11回利付国債(40年)	330,000,000	379,252,500	
第122回利付国債(20年)	500,000,000	596,460,000	
第123回利付国債(20年)	300,000,000	368,610,000	
第126回利付国債(20年)	600,000,000	733,290,000	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	484,428,000	
第128回利付国債(20年)	600,000,000	728,700,000	
第128回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,003,380,000	
第129回利付国債(5年)	1,750,000,000	1,757,052,500	
第12回利付国債(30年)	300,000,000	381,654,000	
第12回利付国債(40年)	480,000,000	500,448,000	
第130回利付国債(20年)	400,000,000	482,524,000	
第130回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,205,604,000	
第131回利付国債(5年)	1,100,000,000	1,105,951,000	
第132回利付国債(20年)	400,000,000	479,292,000	
第132回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,509,105,000	
第133回利付国債(20年)	500,000,000	605,015,000	
第133回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,510,095,000	
第134回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,511,070,000	
第135回利付国債(20年)	400,000,000	480,360,000	
第135回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,915,257,000	
第136回利付国債(20年)	450,000,000	534,991,500	
第136回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,715,062,000	
第137回利付国債(20年)	400,000,000	481,440,000	
第137回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,564,492,500	
第139回利付国債(20年)	200,000,000	238,268,000	
第139回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,526,125,000	
第13回利付国債(30年)	300,000,000	378,774,000	
第140回利付国債(20年)	200,000,000	241,398,000	
第140回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,314,144,000	
第141回利付国債(20年)	300,000,000	362,859,000	
第141回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,517,280,000	
第142回利付国債(20年)	600,000,000	733,356,000	
第143回利付国債(20年)	300,000,000	359,931,000	
第144回利付国債(20年)	400,000,000	474,716,000	
第145回利付国債(20年)	450,000,000	546,840,000	
第146回利付国債(20年)	320,000,000	389,891,200	
第147回利付国債(20年)	560,000,000	676,407,200	
第148回利付国債(20年)	500,000,000	597,980,000	
第149回利付国債(20年)	400,000,000	479,428,000	
第14回利付国債(30年)	200,000,000	264,392,000	

第150回利付国債(20年)	370,000,000	438,794,100	
第151回利付国債(20年)	550,000,000	637,461,000	
第152回利付国債(20年)	650,000,000	754,494,000	
第153回利付国債(20年)	650,000,000	765,427,000	
第154回利付国債(20年)	940,000,000	1,094,404,400	
第155回利付国債(20年)	600,000,000	680,424,000	
第156回利付国債(20年)	620,000,000	644,831,000	
第157回利付国債(20年)	700,000,000	705,012,000	
第158回利付国債(20年)	670,000,000	706,783,000	
第159回利付国債(20年)	800,000,000	856,976,000	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	268,172,000	
第160回利付国債(20年)	550,000,000	598,361,500	
第161回利付国債(20年)	550,000,000	589,303,000	
第162回利付国債(20年)	100,000,000	107,156,000	
第163回利付国債(20年)	500,000,000	535,810,000	
第164回利付国債(20年)	700,000,000	737,268,000	
第165回利付国債(20年)	450,000,000	473,863,500	
第166回利付国債(20年)	410,000,000	446,719,600	
第167回利付国債(20年)	600,000,000	631,512,000	
第168回利付国債(20年)	400,000,000	413,180,000	
第169回利付国債(20年)	570,000,000	577,917,300	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	268,968,000	
第170回利付国債(20年)	770,000,000	780,094,700	
第171回利付国債(20年)	100,000,000	101,231,000	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	267,014,000	
第18回利付国債(30年)	300,000,000	397,419,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	265,814,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	382,101,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	248,286,400	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	136,499,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	267,512,000	
第22回利付国債(30年)	200,000,000	274,630,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	137,778,000	
第24回利付国債(30年)	320,000,000	441,996,800	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	135,288,000	
第26回メキシコ合衆国円貨債券(2018)	100,000,000	100,552,000	
第26回利付国債(30年)	150,000,000	206,013,000	
第27回利付国債(30年)	320,000,000	448,022,400	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	422,568,000	
第29回利付国債(30年)	200,000,000	279,816,000	
第2回利付国債(30年)	380,000,000	472,826,400	
第2回利付国債(40年)	500,000,000	755,050,000	
第30回利付国債(30年)	350,000,000	485,933,000	
第313回利付国債(10年)	600,000,000	609,354,000	
第314回利付国債(10年)	900,000,000	912,096,000	
第315回利付国債(10年)	750,000,000	763,447,500	
第316回利付国債(10年)	500,000,000	508,300,000	
第317回利付国債(10年)	600,000,000	611,862,000	
第318回利付国債(10年)	250,000,000	254,547,500	

第319回利付国債(10年)	300,000,000	306,870,000	
第31回利付国債(30年)	400,000,000	550,720,000	
第320回利付国債(10年)	700,000,000	714,749,000	
第321回利付国債(10年)	300,000,000	307,209,000	
第322回利付国債(10年)	700,000,000	715,365,000	
第323回利付国債(10年)	200,000,000	204,924,000	
第324回利付国債(10年)	400,000,000	408,916,000	
第325回利付国債(10年)	500,000,000	512,355,000	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	307,326,000	
第327回利付国債(10年)	700,000,000	719,082,000	
第328回利付国債(10年)	500,000,000	511,735,000	
第329回利付国債(10年)	500,000,000	516,050,000	
第32回利付国債(30年)	500,000,000	701,960,000	
第330回利付国債(10年)	800,000,000	827,632,000	
第331回利付国債(10年)	500,000,000	513,675,000	
第332回利付国債(10年)	600,000,000	617,556,000	
第333回利付国債(10年)	900,000,000	928,044,000	
第334回利付国債(10年)	700,000,000	723,170,000	
第335回利付国債(10年)	800,000,000	824,344,000	
第336回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,032,610,000	
第337回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,022,620,000	
第338回利付国債(10年)	650,000,000	668,616,000	
第339回利付国債(10年)	900,000,000	927,072,000	
第33回利付国債(30年)	400,000,000	540,700,000	
第340回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,526,634,800	
第341回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,335,165,000	
第342回利付国債(10年)	800,000,000	812,504,000	
第343回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,219,548,000	
第344回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,219,920,000	
第345回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,017,240,000	
第346回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,425,018,000	
第347回利付国債(10年)	750,000,000	763,605,000	
第348回利付国債(10年)	900,000,000	916,542,000	
第349回利付国債(10年)	1,460,000,000	1,487,141,400	
第34回利付国債(30年)	550,000,000	769,323,500	
第350回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,435,873,500	
第351回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,526,460,000	
第352回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,180,068,000	
第353回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,525,350,000	
第354回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,015,980,000	
第355回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,249,040,400	
第356回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,283,570,000	
第357回利付国債(10年)	300,000,000	304,293,000	
第35回利付国債(30年)	520,000,000	709,212,400	
第36回利付国債(30年)	480,000,000	657,787,200	
第37回利付国債(30年)	430,000,000	582,877,900	
第38回利付国債(30年)	400,000,000	535,840,000	
第399回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,002,820,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	450,506,100	

第3回利付国債(30年)	300,000,000	371,805,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	381,027,500	
第401回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,304,225,000	
第402回利付国債(2年)	600,000,000	602,076,000	
第404回利付国債(2年)	900,000,000	903,510,000	
第406回利付国債(2年)	400,000,000	401,728,000	
第40回利付国債(30年)	350,000,000	470,788,500	
第41回利付国債(30年)	300,000,000	397,374,000	
第42回利付国債(30年)	410,000,000	544,373,400	
第43回利付国債(30年)	400,000,000	531,780,000	
第44回利付国債(30年)	350,000,000	466,431,000	
第45回利付国債(30年)	320,000,000	412,060,800	
第46回利付国債(30年)	400,000,000	515,540,000	
第47回利付国債(30年)	500,000,000	657,635,000	
第48回利付国債(30年)	400,000,000	507,536,000	
第49回利付国債(20年)	100,000,000	102,438,000	
第49回利付国債(30年)	440,000,000	559,363,200	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	385,015,000	
第50回利付国債(20年)	50,000,000	51,110,500	
第50回利付国債(30年)	350,000,000	392,791,000	
第51回利付国債(20年)	350,000,000	360,041,500	
第51回利付国債(30年)	450,000,000	448,357,500	
第52回利付国債(20年)	100,000,000	103,573,000	
第52回利付国債(30年)	400,000,000	418,660,000	
第53回利付国債(30年)	400,000,000	428,728,000	
第54回利付国債(30年)	410,000,000	460,753,900	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	522,445,000	
第55回利付国債(30年)	390,000,000	438,141,600	
第56回利付国債(30年)	320,000,000	359,833,600	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	838,472,000	
第57回利付国債(30年)	240,000,000	269,779,200	
第58回利付国債(30年)	480,000,000	539,347,200	
第59回利付国債(30年)	450,000,000	493,767,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	124,730,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	194,376,000	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	731,115,000	
第60回利付国債(30年)	340,000,000	391,632,400	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	362,596,500	
第61回利付国債(30年)	120,000,000	131,514,000	
第62回利付国債(30年)	250,000,000	260,237,500	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	532,855,000	
第63回利付国債(30年)	250,000,000	253,322,500	
第64回利付国債(30年)	560,000,000	566,742,400	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	431,812,000	
第65回利付国債(30年)	300,000,000	303,639,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	548,500,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	327,867,000	
第6回利付国債(30年)	180,000,000	230,198,400	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	221,545,500	

第70回利付国債(20年)	600,000,000	666,906,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	662,532,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	332,982,000	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	221,018,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	333,063,000	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	277,590,000	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	382,821,000	
第7回利付国債(40年)	160,000,000	228,188,800	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	112,110,000	
第81回利付国債(20年)	200,000,000	224,250,000	
第83回利付国債(20年)	300,000,000	339,780,000	
第85回利付国債(20年)	200,000,000	227,652,000	
第88回利付国債(20年)	400,000,000	462,736,000	
第89回利付国債(20年)	400,000,000	460,180,000	
第8回利付国債(30年)	300,000,000	366,516,000	
第8回利付国債(40年)	50,000,000	66,923,000	
第90回利付国債(20年)	300,000,000	346,836,000	
第91回利付国債(20年)	300,000,000	348,828,000	
第92回利付国債(20年)	340,000,000	392,632,000	
第93回利付国債(20年)	300,000,000	345,990,000	
第94回利付国債(20年)	300,000,000	348,135,000	
第95回利付国債(20年)	150,000,000	177,090,000	
第96回利付国債(20年)	100,000,000	116,580,000	
第97回利付国債(20年)	150,000,000	176,815,500	
第98回利付国債(20年)	100,000,000	117,112,000	
第99回利付国債(20年)	200,000,000	235,176,000	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	117,131,000	
第9回利付国債(40年)	1,930,000,000	1,948,412,200	
国債証券 小計	123,190,000,000	135,081,132,800	
地方債証券			
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,703,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,570,000	
第10回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	120,248,000	
第10回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	118,970,000	
第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,060,000	
第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,127,000	
第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,394,000	
第11回川崎市公募公債(30年)	100,000,000	110,274,000	
第120回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	102,324,000	
第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,690,000	
第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,188,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,946,000	
第135回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	101,757,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,656,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,500,000	
第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,563,000	
第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,818,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,388,000	
第14回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,371,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,338,000	

第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,182,000	
第184回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,176,000	
第188回共同発行市場公募地方債	30,000,000	30,599,700	
第188回神奈川県公募公債	100,000,000	102,153,000	
第24回千葉県公募公債	100,000,000	105,085,000	
第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,162,000	
第2回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	133,606,000	
第2回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	120,835,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	139,135,000	
第30回2号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	102,434,000	
第346回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,177,000	
第368回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,441,000	
第36回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	106,399,000	
第374回大阪府公募公債(10年)	134,000,000	138,306,760	
第387回大阪府公募公債(10年)	44,040,000	45,063,049	
第392回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,746,000	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	139,379,000	
第3回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,265,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,668,000	
第480回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,117,000	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	137,646,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	104,546,000	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	120,842,000	
第6回京都市公募公債(20年)	200,000,000	235,434,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,032,000	
第739回東京都公募公債	100,000,000	101,351,000	
第746回東京都公募公債	100,000,000	102,550,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	102,037,000	
第759回東京都公募公債	100,000,000	100,328,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	101,060,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,925,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,019,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,130,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,251,000	
第90回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,667,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,401,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	12,000,000	12,092,160	
平成23年度第2回北九州市公募公債	11,000,000	11,211,860	
平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,603,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,251,000	
平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,399,000	
平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	10,000,000	13,718,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	110,004,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,265,000	
平成24年度第1回滋賀県公募公債	30,600,000	31,266,468	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	102,131,000	
平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	102,370,000	
平成24年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,096,000	
平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	30,630,900	

	平成24年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,090,000	
	平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	30,614,700	
	平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	102,084,000	
	平成24年度第9回北海道公募公債	7,400,000	7,556,436	
	平成25年度第1回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	102,918,000	
	平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,834,000	
	平成25年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,920,000	
	平成26年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	116,873,000	
	平成26年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	102,663,000	
	平成26年度第9回静岡県公募公債	20,000,000	20,507,600	
	平成27年度第13回北海道公募公債	100,000,000	102,531,000	
	平成27年度第1回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	102,225,000	
	平成27年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	106,443,000	
	平成27年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,608,000	
	平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	102,561,000	
	平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,343,000	
	平成28年度第5回広島市公募公債	100,000,000	101,470,000	
	平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,023,000	
	平成29年度第1回秋田県公募公債	145,900,000	147,840,470	
	平成29年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	101,224,000	
	平成29年度第3回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,425,000	
	平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,134,000	
	平成29年度第5回広島県公募公債	100,000,000	101,700,000	
	平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,371,000	
	平成30年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	102,003,000	
	平成30年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,532,000	
	平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	109,177,000	
	平成30年度第6回広島市公募公債	100,000,000	100,919,000	
地方債証券	小計	9,104,940,000	9,700,662,103	
特殊債券	F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,211,000	
	F181回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,825,000	
	F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,626,000	
	F308回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	114,861,000	
	い第787号農林債	200,000,000	200,322,000	
	第101回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,679,000	74,633,608	
	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,105,000	
	第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,547,000	80,227,905	
	第108回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,822,000	
	第10回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	120,319,000	
	第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,910,000	168,366,715	
	第112回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,615,000	
	第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,172,000	87,350,832	
	第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,362,000	
	第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,497,000	88,973,949	
	第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	110,534,000	
	第11回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,675,000	
	第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,676,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,748,000	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,142,000	91,531,989	

第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,646,000	
第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,578,000	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,212,000	93,524,176	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,887,000	94,344,397	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,223,000	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,987,000	95,244,546	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,804,000	96,628,028	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,343,000	97,387,153	
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,470,000	97,237,149	
第13回公営企業債券（20年）	10,000,000	11,133,400	
第146回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,921,000	
第149回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,826,000	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,019,000	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,658,000	15,983,373	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,908,000	
第172回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,031,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,807,000	16,143,372	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,143,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,820,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,153,000	
第18回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,461,000	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,895,000	16,219,258	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	160,208,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,083,000	
第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,133,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,908,000	35,442,790	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,029,800	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,339,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,622,000	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,768,000	
第20回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	119,005,000	
第215回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,193,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2,000,000	2,058,200	
第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,405,000	
第22回公営企業債券（20年）	100,000,000	116,484,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	155,622,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,483,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,309,790	
第236号商工債（3年）	100,000,000	100,012,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	111,920,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	140,583,600	
第240回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,089,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,668,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,182,000	51,145,288	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,053,000	
第26回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	14,038,800	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,581,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,559,000	27,419,439	
第28回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	115,066,000	

第28回道路債券	200,000,000	269,688,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	24,500,000	24,934,875	
第29回西日本高速道路株式会社債(一般担保付、独立行政法人)	200,000,000	202,856,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,044,000	13,435,711	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,473,000	30,691,331	
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	101,599,000	
第2回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	23,614,000	24,037,635	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,514,000	30,904,109	
第303回信金中金債(5年)	100,000,000	100,002,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,935,000	
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	74,000,000	75,374,180	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,927,000	30,084,919	
第312回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,918,000	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,297,220	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,832,000	30,989,498	
第321回信金中金債(5年)	100,000,000	100,022,000	
第326回信金中金債(5年)	100,000,000	100,067,000	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,469,000	29,357,768	
第331回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,737,000	
第337回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,311,000	
第338回信金中金債(5年)	100,000,000	100,293,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	100,330,000	
第342回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,168,740	
第342回東京交通債券	30,000,000	31,631,100	
第343回信金中金債(5年)	100,000,000	100,336,000	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,998,000	16,697,592	
第352回信金中金債(5年)	100,000,000	100,204,000	
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,824,000	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,294,000	32,168,592	
第36回中日本高速道路株式会社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	101,652,000	
第379回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,894,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,137,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,413,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,546,000	14,060,612	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,160,000	35,075,984	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,070,000	34,847,843	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,621,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	80,513,000	80,546,010	
第3回都市再生債券	100,000,000	112,353,000	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,182,000	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,317,000	43,668,350	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,816,000	84,861,169	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,530,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,988,000	35,164,218	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	33,000,000	33,707,190	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,809,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,800,000	

第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,971,000	
第4回公営企業債券(30年)	100,000,000	137,033,000	
第50回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,983,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,966,000	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	162,000,000	165,112,020	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,457,000	47,071,960	
第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,097,000	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	118,498,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,911,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,266,000	47,782,336	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,888,000	
第65回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,816,000	
第66回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,467,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,646,000	50,938,685	
第68回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,237,440	
第68回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	103,915,000	
第68回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,540,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,158,000	52,957,819	
第6回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,279,000	
第6回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	12,667,000	13,093,624	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,156,000	46,425,618	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,651,000	44,487,552	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,505,000	
第78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)	100,000,000	101,236,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,420,000	47,408,941	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	110,787,000	
第7回道路債券	50,000,000	53,132,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,687,000	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,586,000	50,776,742	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,865,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	153,724,000	
第89回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,233,000	
第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	13,384,900	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,082,000	15,725,850	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,883,000	
第96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)	100,000,000	100,916,000	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,766,000	74,092,653	
第96回都市再生債券	100,000,000	102,692,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,296,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,272,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,159,000	
第9回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	26,616,000	27,654,024	
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,531,000	16,231,137	
特殊債券 小計	12,832,736,000	13,708,471,504	
社債券 第107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)	200,000,000	242,996,000	

第10回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債 (201)	100,000,000	100,246,000	
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円 貨社債	100,000,000	104,073,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特 約付)	100,000,000	109,352,000	
第127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)	100,000,000	104,776,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順 位特約)	100,000,000	100,020,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	116,780,000	
第14回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(20 17)	100,000,000	100,640,000	
第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同 等特約付)	100,000,000	102,725,000	
第15回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債 (社債間)	100,000,000	101,273,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,300,000	
第18回イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順 位特約)	100,000,000	103,061,000	
第18回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2 018)	100,000,000	99,919,000	
第1回エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエル シー円貨	100,000,000	100,372,000	
第20回大阪瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順)	100,000,000	101,020,000	
第245回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,595,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特 約付)	100,000,000	111,982,000	
第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保 付)	100,000,000	103,020,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債(社 債間限)	100,000,000	102,640,000	
第28回リコーリース株式会社無担保社債(社債間限定同順 位特約)	100,000,000	100,432,000	
第28回東京瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特 約付)	100,000,000	115,282,000	
第298回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,498,000	
第30回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債 (201)	100,000,000	99,700,000	
第323回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,544,000	
第32回ANAホールディングス株式会社無担保社債(社債 間限定)	100,000,000	104,875,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債 間限定)	100,000,000	108,742,000	
第350回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,012,000	
第3回GLP投資法人無担保投資法人債(特定投資法人債間 限定同)	100,000,000	100,206,000	
第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定 同順位)	100,000,000	101,782,000	
第3回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債 (社債間)	100,000,000	102,195,000	

第400回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,303,000	
第45回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位）	100,000,000	119,098,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位）	100,000,000	136,143,000	
第4回東京地下鉄株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	11,397,600	
第506回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,795,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,720,000	
第52回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特）	100,000,000	115,835,000	
第54回日立キャピタル株式会社無担保社債（社債間限定同順位特）	100,000,000	100,512,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（特定）	100,000,000	105,784,000	
第58回電源開発株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,637,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	101,825,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約）	100,000,000	120,057,000	
第69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）	100,000,000	100,500,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,066,000	
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,578,000	
第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,755,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,854,000	
社債券 小計	4,710,000,000	4,978,917,600	
合計	149,837,676,000	163,469,184,007	

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		566,996,968	1,695,227,576
金銭信託		11,241,281	6,626,223
コール・ローン		1,412,354,372	2,703,707,060
株式		144,448,525,789	168,473,154,465
投資証券		3,851,568,208	4,770,696,178
派生商品評価勘定		118,424,625	143,206,165
未収入金		2,197,698	4,618,949
未収配当金		186,951,328	216,759,376

差入委託証拠金		667,590,932	1,220,044,411
流動資産合計		151,265,851,201	179,234,040,403
資産合計		151,265,851,201	179,234,040,403
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,927,395	8,225,934
未払解約金		215,519,000	238,282,000
未払利息		3,602	7,464
その他未払費用		1,705	576
流動負債合計		217,451,702	246,515,974
負債合計		217,451,702	246,515,974
純資産の部			
元本等			
元本	1	57,955,317,361	56,526,014,844
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		93,093,082,138	122,461,509,585
元本等合計		151,048,399,499	178,987,524,429
純資産合計		151,048,399,499	178,987,524,429
負債純資産合計		151,265,851,201	179,234,040,403

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年12月1日から、翌年11月30日までであります。

(2) 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、投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として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。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引</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。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
---------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2019年 2月20日現在）	（2020年 2月20日現在）
1 期首元本額	64,427,801,459円	57,955,317,361円
期中追加設定元本額	13,291,705,497円	15,995,619,384円
期中一部解約元本額	19,764,189,595円	17,424,921,901円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	6,351,967,197円	6,003,611,958円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	6,834,819,365円	6,551,816,920円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	54,493,281円	57,521,321円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	84,890,489円	75,976,909円
外国株式インデックス・ファンドVA1（適格機関投資家専用）	1,783,752,639円	1,612,608,652円
外国株式インデックス・ファンドVA2（適格機関投資家専用）	63,262,650円	46,274,788円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	2,283,581円	1,176,058円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	143,505,321円	73,800,114円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	75,948円	65,804円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	4,704,169円	4,161,936円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	7,784,215円	5,385,473円
バランスファンドVA50B < 適格機関投資家限定 >	7,434,532,177円	5,917,163,909円
バランスファンドVA50C < 適格機関投資家限定 >	3,012,858円	2,223,731円
バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	857,697,908円	645,087,295円

バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	715,814,160円	568,566,840円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	65,951,557円	58,822,589円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	62,169,274円	190,621,273円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	750,531,735円	2,075,091,527円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	204,167,933円	366,889,020円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	1,593,945,296円	1,192,714,226円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	64,403,370円	49,541,493円
世界4資産バランスVA45 < 適格機関投資家限定 >	205,784,567円	円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	36,739,533円	31,508,730円
グローバル4資産45VA < 適格機関投資家限定 >	41,602,412円	34,662,062円
4資産バランス30VA2 < 適格機関投資家限定 >	16,904,300円	19,838,550円
バランスファンドVA25B < 適格機関投資家限定 >	254,008,190円	195,969,409円
バランスファンドVA20A < 適格機関投資家限定 >	1,163,655円	760,778円
バランスファンドVA35B < 適格機関投資家限定 >	1,387,236円	1,190,738円
バランスファンドVA10A < 適格機関投資家限定 >	41,185,183円	円
外国株式インデックス・ファンドVA3 < 適格機関投資家限定 >	7,729,137,849円	8,368,955,146円
4資産インデックスバランスVA20 < 適格機関投資家限定 >	252,574,108円	201,790,544円
4資産インデックスバランスVA50 < 適格機関投資家限定 >	34,281,699円	30,227,266円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機関投資家限定 >	30,226,231円	26,391,279円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル） < 適格機関投資家限定 >	26,728,893円	23,311,813円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン	383,521,283円	178,152,583円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,550,036,343円	2,991,369,467円
全世界株式インデックス・ファンド	296,801,828円	399,026,824円
グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	3,229,393円	1,578,722円

グローバルバランス４０ＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	878,515,606円	696,429,616円
グローバルバランス４０ＶＡ３＜適格機関投資家限定＞	71,012,688円	58,886,433円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	31,725,349円	26,251,030円
ワールドバランスＶＡ０９０２＜適格機関投資家限定＞	40,619,126円	円
ワールドエクイティ・ファンドＶＬ＜適格機関投資家限定＞	17,944,366,766円	17,740,592,018円
計	57,955,317,361円	56,526,014,844円
2 受益権の総数	57,955,317,361口	56,526,014,844口

(金融商品に関する注記)

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	<p>当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。</p>
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、株価指数先物取引、為替予約取引があり、株価指数先物取引はファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、効率的な運用に資する目的として、また為替予約取引は保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用しております。これらは、それぞれの取引種類により、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、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、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,113,179,848	11,117,521,239
投資証券	180,037,043	264,450,332
合計	3,293,216,891	11,381,971,571

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2019年 2月20日現在)			
		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				
	MINI S&P 500	1,709,541,145		1,784,897,937	75,356,792
	S&P 60	107,702,537		111,331,136	3,628,599
	SPI 200	87,652,167		96,105,989	8,453,822
	FTSE100INDEX	178,575,501		185,682,678	7,107,177
	FSMI INDEX	97,532,400		101,574,810	4,042,410
	EURO STOXX 50	311,092,881		321,395,633	10,302,752
	合 計	2,492,096,631		2,600,988,183	108,891,552

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 2月20日現在)			
		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				
	MINI S&P 500	3,823,589,145		3,901,200,822	77,611,677
	S&P 60	211,420,961		215,670,576	4,249,615
	SPI 200	191,286,674		197,542,560	6,255,886
	FTSE100INDEX	367,079,690		362,144,509	4,935,181
	FSMI INDEX	205,235,043		215,069,935	9,834,892
	EURO STOXX 50	625,145,924		640,594,769	15,448,845
	合 計	5,423,757,437		5,532,223,171	108,465,734

(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、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対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。
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。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2019年 2月20日現在)			
		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				
	アメリカ・ドル	1,211,654,248		1,218,371,200	6,716,952
	カナダ・ドル	75,114,481		75,366,000	251,519
	オーストラリア・ドル	40,914,560		41,147,600	233,040
	イギリス・ポンド	102,835,734		104,090,400	1,254,666
	ユーロ	153,928,356		154,635,600	707,244
	売建				
	アメリカ・ドル	367,465,180		368,164,800	699,620
	カナダ・ドル	24,151,196		24,284,600	133,404
	オーストラリア・ドル	25,849,058		26,112,900	263,842
	イギリス・ポンド	38,876,070		39,033,900	157,830
	ユーロ	60,042,553		60,345,600	303,047
	合計	2,100,831,436		2,111,552,600	7,605,678

(単位：円)

区 分	種 類	(2020年 2月20日現在)			
		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				
	アメリカ・ドル	1,984,256,790		2,010,522,600	26,265,810
	カナダ・ドル	85,030,545		86,633,300	1,602,755
	オーストラリア・ドル	47,341,815		47,526,400	184,585
	イギリス・ポンド	131,447,030		132,662,790	1,215,760
	ユーロ	366,966,787		365,742,400	1,224,387
	売建				
	アメリカ・ドル	247,830,320		249,220,000	1,389,680
	カナダ・ドル	10,942,360		10,944,700	2,340
	イギリス・ポンド	30,070,980		30,199,300	128,320
	ユーロ	34,874,414		34,884,100	9,686
	合計	2,938,761,041		2,968,335,590	26,514,497

(注) 1 . 時価の算定方法

(1) 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。

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。

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。

- ・ 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先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 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) 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、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。

4 . ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（2019年 2月20日現在）	（2020年 2月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6063円 （26,063円）	3.1665円 （31,665円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APACHE CORP	13,839	28.47	393,996.33	
	BAKER HUGHES COMPANY	20,549	20.81	427,624.69	
	CABOT OIL GAS CORP	14,921	15.60	232,767.60	
	CHENIERE ENERGY INC	8,311	55.35	460,013.85	
	CHEVRON CORPORATION	69,395	110.74	7,684,802.30	
	CONCHO RESOURCES INC	7,300	82.45	601,885.00	
	CONOCOPHILLIPS	40,506	59.26	2,400,385.56	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,500	26.07	91,245.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	14,940	22.72	339,436.80	
	DIAMONDBACK ENERGY	5,600	79.29	444,024.00	
	ENBRIDGE INC	12,650	41.97	530,920.50	
	EOG RESOURCES INC	21,106	77.28	1,631,071.68	
	EXXON MOBIL CORPORATION	154,751	60.34	9,337,675.34	
	HALLIBURTON CO	31,714	22.28	706,587.92	
	HESS CORP	9,900	63.57	629,343.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	5,743	42.82	245,915.26	
	KINDER MORGAN INC	74,172	22.16	1,643,651.52	
	MARATHON OIL CORP	28,857	10.47	302,132.79	
	MARATHON PETROLEUM CORP	23,930	57.69	1,380,521.70	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	14,331	23.38	335,058.78	
	NOBLE ENERGY INC	17,900	18.92	338,668.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	32,624	42.51	1,386,846.24	
	ONEOK INC NEW	15,000	76.75	1,151,250.00	
	PHILLIPS 66	16,383	88.36	1,447,601.88	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,024	141.17	850,408.08	
	SCHLUMBERGER LTD	50,462	34.29	1,730,341.98	
	TARGA RESOURCES CORP	9,000	36.95	332,550.00	
	TECHNIPFMC PLC	9,800	17.20	168,560.00	
	VALERO ENERGY CORP	15,103	83.23	1,257,022.69	
	WILLIAMS COS	44,041	21.55	949,083.55	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	8,047	255.82	2,058,583.54	
	ALBEMARLE CORP	4,100	89.34	366,294.00	
	AMCOR PLC	21,100	10.18	214,798.00	
	AVERY DENNISON CORP	3,257	136.77	445,459.89	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,400	29.73	220,002.00		
BALL CORP	11,404	77.01	878,222.04		
CELANESE CORPORATION	4,472	108.25	484,094.00		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,100	39.38	318,978.00		

CORTEVA INC	27,168	31.52	856,335.36
CROWN HOLDINGS INC	4,900	78.96	386,904.00
DOW INC	27,035	47.56	1,285,784.60
DUPONT DE NEMOURS INC	27,168	53.50	1,453,488.00
EASTMAN CHEMICAL CO	5,255	73.16	384,455.80
ECOLAB INC	9,426	210.31	1,982,382.06
FMC CORP	4,700	106.45	500,315.00
FREEPORT MCMORAN INC	52,466	12.10	634,838.60
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	3,589	134.26	481,859.14
INT'L PAPER CO	13,890	42.70	593,103.00
LINDE PLC	12,673	222.48	2,819,489.04
LYONDELLBASELL INDU CL A	9,745	81.95	798,602.75
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,300	258.67	594,941.00
MOSAIC CO/THE	13,101	18.41	241,189.41
NEWMONT CORPORATION	21,947	46.17	1,013,292.99
NUCOR CORP	10,971	47.71	523,426.41
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,600	98.93	356,148.00
PPG INDUSTRIES	8,547	119.52	1,021,537.44
RPM INTERNATIONAL INC	4,800	74.30	356,640.00
SEALED AIR CORP	6,203	35.10	217,725.30
SHERWIN-WILLIAMS CO	3,063	589.05	1,804,260.15
STEEL DYNAMICS INC	7,800	29.13	227,214.00
VULCAN MATERIALS CO	4,956	135.40	671,042.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,400	63.05	88,270.00
WESTROCK COMPANY	9,825	40.47	397,617.75
3M CO	20,982	159.34	3,343,271.88
ACUITY BRANDS INC	1,500	116.15	174,225.00
AERCAP HOLDINGS NV	4,669	62.71	292,792.99
ALLEGION PLC W/I	3,500	131.16	459,060.00
AMETEK INC	8,300	100.17	831,411.00
ARCONIC INC	14,829	34.07	505,224.03
BOEING CO	19,570	338.30	6,620,531.00
CATERPILLAR	20,571	136.86	2,815,347.06
CUMMINS ENGINE CO	5,412	167.84	908,350.08
DEERE & CO	10,895	164.93	1,796,912.35
DOVER CORP	5,214	117.25	611,341.50
EATON CORP PLC	15,261	104.31	1,591,874.91
EMERSON ELECTRIC CO	22,449	71.86	1,613,185.14
FASTENAL CO	20,800	38.29	796,432.00
FLOWSERVE CORP	5,200	45.54	236,808.00
FORTIVE CORPORATION	10,934	76.86	840,387.24
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	5,000	72.33	361,650.00
GENERAL DYNAMICS CORP	8,960	186.55	1,671,488.00
GENERAL ELECTRIC CO	318,802	12.61	4,020,093.22
GRAINGER (WW)	1,767	307.14	542,716.38
HD SUPPLY HOLDINGS	6,200	42.10	261,020.00
HEICO CORP	1,700	129.60	220,320.00
HEICO CORP-CLASS A	2,800	104.10	291,480.00

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,317	180.86	4,759,692.62
HUNTINGTON INGALLS IND	1,600	235.70	377,120.00
IDEX CORP	2,800	173.54	485,912.00
ILLINOIS TOOL WORKS	11,818	187.53	2,216,229.54
INGERSOLL-RAND PLC	8,831	145.83	1,287,824.73
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,100	101.46	517,446.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,300	58.11	482,313.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	8,500	31.35	266,475.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	28,924	41.97	1,213,940.28
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,170	225.98	1,846,256.60
LENNOX INTERNATIONAL	1,300	246.00	319,800.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	9,298	434.48	4,039,795.04
MASCO CORP	10,790	45.03	485,873.70
MIDDLEBY CORP	2,000	111.97	223,940.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,840	366.15	2,138,316.00
OWENS CORNING	3,900	65.65	256,035.00
PACCAR INC	12,606	74.23	935,743.38
PARKER HANNIFIN CORP	4,628	211.78	980,117.84
PENTAIR PLC	5,834	43.69	254,887.46
RAYTHEON COMPANY	10,126	222.47	2,252,731.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,322	200.36	865,955.92
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,800	387.97	1,474,286.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	48.58	301,196.00
SMITH (A.O.) CORP	4,900	44.10	216,090.00
SNAP-ON	2,004	158.00	316,632.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	3,800	65.61	249,318.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,660	161.79	915,731.40
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,300	394.06	512,278.00
TEXTRON	8,252	47.23	389,741.96
TRANSDIGM GROUP INC	1,700	641.26	1,090,142.00
UNITED RENTALS INC	2,896	153.55	444,680.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	29,956	150.68	4,513,770.08
WABCO HOLDINGS INC	1,900	135.96	258,324.00
WABTEC CORPORATION	6,306	78.64	495,903.84
XYLEM INC	6,654	87.96	585,285.84
CINTAS CORP	3,199	304.26	973,327.74
COPART INC	7,500	104.50	783,750.00
COSTAR GROUP	1,300	737.86	959,218.00
EQUIFAX INC	4,403	161.88	712,757.64
IHS MARKIT LIMITED	13,802	81.11	1,119,480.22
MANPOWER GROUP	2,354	92.54	217,839.16
NIELSEN HOLDINGS PLC	13,650	21.83	297,979.50
REPUBLIC SERVICES INC	8,102	100.04	810,524.08
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	4,640	59.50	276,080.00
ROLLINS	6,050	39.72	240,306.00
TRANSUNION	7,100	100.31	712,201.00
VERISK ANALYTICS INC	5,600	169.74	950,544.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,563	102.75	982,598.25

WASTE MANAGEMENT (NEW)	15,420	125.23	1,931,046.60	
AMERCO	300	345.24	103,572.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP	4,502	28.33	127,541.66	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,200	73.48	382,096.00	
CSX CORP	27,605	80.17	2,213,092.85	
DELTA AIR LINES INC	6,000	58.51	351,060.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,384	76.18	486,333.12	
FEDEX CORP	9,040	161.14	1,456,705.60	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,157	110.11	347,617.27	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,749	176.39	661,286.11	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	4,500	39.76	178,920.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,569	209.17	2,001,547.73	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,400	225.04	540,096.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,910	57.11	280,410.10	
UBER TECHNOLOGIES INC	7,500	41.05	307,875.00	
UNION PACIFIC CORP	25,766	183.50	4,728,061.00	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,527	79.42	200,694.34	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	25,497	106.76	2,722,059.72	
XPO LOGISTICS INC	3,400	97.47	331,398.00	
APTIV PLC	9,612	90.71	871,904.52	
AUTOLIV INC	3,100	76.63	237,553.00	
BORGWARNER INC	8,100	34.79	281,799.00	
FORD MOTOR COMPANY	142,625	8.00	1,141,000.00	
GENERAL MOTORS CO	46,799	34.92	1,634,221.08	
HARLEY-DAVIDSON	6,058	34.86	211,181.88	
LEAR CORP	2,250	124.82	280,845.00	
TESLA INC	4,900	917.42	4,495,358.00	
CAPRI HOLDINGS LIMITED	6,200	27.65	171,430.00	
DR HORTON INC	13,066	61.88	808,524.08	
GARMIN LTD	4,800	103.67	497,616.00	
HANESBRANDS INC	13,724	14.29	196,115.96	
HASBRO INC	4,800	97.68	468,864.00	
LEGGETT & PLATT INC	5,091	44.98	228,993.18	
LENNAR CORP-CL A	10,312	70.44	726,377.28	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,000	262.51	1,050,040.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,300	131.33	302,059.00	
NEWELL BRANDS INC	14,944	19.90	297,385.60	
NIKE B	45,704	102.46	4,682,831.84	
NVR INC	130	3,965.95	515,573.50	
POLARIS INC	2,189	93.08	203,752.12	
PULTE GROUP INC	9,363	46.55	435,847.65	
PVH CORP	2,700	86.13	232,551.00	
RALPH LAUREN CORP	1,974	119.80	236,485.20	
TAPESTRY INC	10,483	28.04	293,943.32	
UNDER ARMOUR INC CLASS A	6,924	16.57	114,730.68	
UNDER ARMOUR INC CLASS C	6,973	14.96	104,316.08	
VF CORP	12,298	83.40	1,025,653.20	

WHIRLPOOL CORP	2,374	147.22	349,500.28
ARAMARK	9,300	42.62	396,366.00
CARNIVAL CORP	15,266	43.34	661,628.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,001	933.84	934,773.84
DARDEN RESTAURANTS	4,419	120.68	533,284.92
DOMINO'S PIZZA INC	1,500	297.10	445,650.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	9,917	112.67	1,117,348.39
LAS VEGAS SANDS CORP	12,600	69.10	870,660.00
MARRIOTT INT'L A	10,244	147.63	1,512,321.72
MCDONALD'S CORP	27,728	215.63	5,978,988.64
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	7,636	21.68	165,548.48
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,400	32.09	590,456.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	8,193	52.02	426,199.86
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,600	111.01	732,666.00
STARBUCKS CORP	43,752	90.14	3,943,805.28
VAIL RESORTS	1,400	245.50	343,700.00
WYNN RESORTS LTD	3,700	136.17	503,829.00
YUM! BRANDS INC	11,058	105.19	1,163,191.02
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,900	64.37	1,795,923.00
ALPHABET INC-CL A	10,912	1,524.87	16,639,381.44
ALPHABET INC-CL C	11,481	1,526.69	17,527,927.89
ALTICE USA INC- A	5,200	28.69	149,188.00
CHARTER COMMUNICATION-A	5,625	542.46	3,051,337.50
COMCAST CORP-CL A	165,812	45.97	7,622,377.64
DISCOVERY INC-A	6,145	30.48	187,299.60
DISCOVERY INC-C	14,151	29.03	410,803.53
DISH NETWORK CORP-A	9,773	41.25	403,136.25
DISNEY (WALT) CO NEW	65,864	141.30	9,306,583.20
ELECTRONIC ARTS	10,724	109.78	1,177,280.72
FACEBOOK INC-A	88,052	217.49	19,150,429.48
FOX CORP	6,838	37.53	256,630.14
FOX CORPORATION-CLASS A	12,769	38.03	485,605.07
IAC/INTERACTIVECORP	2,900	236.20	684,980.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	15,139	24.99	378,323.61
LIBERTY BROADBAND CORP-C	3,900	139.24	543,036.00
LIBERTY GLOBAL PLC A	5,899	20.78	122,581.22
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	15,480	19.76	305,884.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,800	46.92	365,976.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,073	49.84	153,158.32
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	6,062	50.22	304,433.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,400	76.08	410,832.00
MATCH GROUP INC	2,000	75.92	151,840.00
NETFLIX INC	16,007	386.19	6,181,743.33
NEWS CORP - CLASS A	13,556	14.61	198,053.16
OMNICOM GROUP	8,088	78.62	635,878.56
PINTEREST INC- CLASS A	5,100	23.60	120,360.00
ROKU INC	3,000	126.56	379,680.00

SIRIUS XM HOLDINGS INC	57,564	7.25	417,339.00
SNAP INC - A	27,300	17.20	469,560.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,200	113.54	476,868.00
TRIPADVISOR INC	3,871	28.84	111,639.64
TWITTER INC	26,647	38.77	1,033,104.19
VIACOMCBS INC	20,615	35.67	735,337.05
ZILLOW GROUP INC-C	5,000	54.47	272,350.00
ADOVANCE AUTO PARTS	2,750	140.12	385,330.00
AMAZON COM INC	15,388	2,170.22	33,395,345.36
AUTOZONE INC	881	1,066.79	939,841.99
BEST BUY COMPANY INC	8,686	90.94	789,904.84
BOOKING HOLDINGS INC	1,543	1,968.49	3,037,380.07
BURLINGTON STORES INC	2,500	248.09	620,225.00
CARMAX INC	6,250	100.13	625,812.50
DOLLAR GENERAL CORP	9,409	163.79	1,541,100.11
DOLLAR TREE INC	8,603	91.99	791,389.97
EBAY INC	29,822	37.53	1,119,219.66
EXPEDIA GROUP INC	4,627	121.88	563,938.76
GAP	9,054	17.18	155,547.72
GENUINE PARTS CO	5,400	99.35	536,490.00
GRUBHUB INC	3,700	54.58	201,946.00
HOME DEPOT	40,039	243.64	9,755,101.96
KOHL'S CORP	6,121	44.00	269,324.00
LKQ CORP	11,365	34.00	386,410.00
LOWE'S COMPANIES	28,306	123.44	3,494,092.64
MERCADOLIBRE	1,600	742.74	1,188,384.00
NORDSTROM INC	3,800	40.52	153,976.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,828	392.15	1,109,000.20
ROSS STORES INC	13,312	122.94	1,636,577.28
TARGET CORP	18,605	117.39	2,184,040.95
TIFFANY & CO	3,925	134.25	526,931.25
TJX COMPANIES INC	44,122	63.81	2,815,424.82
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,444	98.64	438,356.16
ULTA BEAUTY INC	2,116	296.86	628,155.76
WAYFAIR INC- CLASS A	2,400	80.63	193,512.00
COSTCO WHOLESALE CORP	16,087	323.02	5,196,422.74
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	11,600	5.30	61,480.00
KROGER CO	29,792	29.54	880,055.68
SYSCO CORP	17,703	76.20	1,348,968.60
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,929	52.07	1,454,263.03
WALMART INC	52,216	117.68	6,144,778.88
ALTRIA GROUP INC	68,232	45.14	3,079,992.48
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	20,784	43.97	913,872.48
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,480	71.39	819,557.20
BUNGE LIMITED	5,375	53.76	288,960.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	6,110	47.79	291,996.90
COCA-COLA CO	148,507	59.77	8,876,263.39
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,500	54.97	82,455.00

CONAGRA BRANDS INC	18,127	29.80	540,184.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,116	206.64	1,263,810.24
GENERAL MILLS	21,961	53.24	1,169,203.64
HORMEL FOODS CORP	10,600	48.44	513,464.00
INGREDION INC	2,700	94.57	255,339.00
JM SMUCKER CO	4,088	110.66	452,378.08
KELLOGG CO	9,587	66.30	635,618.10
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,400	94.35	509,490.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,449	164.03	729,769.47
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	7,000	54.88	384,160.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	52,661	59.30	3,122,797.30
MONSTER BEVERAGE CORP	14,840	70.09	1,040,061.40
PEPSICO INC	51,136	145.53	7,441,822.08
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	56,851	87.88	4,996,065.88
THE HERSHEY COMPANY	5,400	160.49	866,646.00
THE KRAFT HEINZ CO/THE	25,055	27.31	684,252.05
TYSON FOODS INC-CL A	11,026	77.83	858,153.58
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,900	75.78	674,442.00
CLOROX CO	4,683	164.84	771,945.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,762	75.54	2,248,221.48
COTY INC	10,584	11.49	121,610.16
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,013	213.12	1,707,730.56
KIMBERLY-CLARK CORP	12,557	143.77	1,805,319.89
PROCTER & GAMBLE CO	91,539	125.44	11,482,652.16
ABBOTT LABORATORIES	64,577	89.36	5,770,600.72
ABIOMED INC	1,600	167.90	268,640.00
ALIGN TECHNOLOGY	2,800	277.15	776,020.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,642	95.13	536,723.46
ANTHEM INC	9,355	304.06	2,844,481.30
BAXTER INTERNATIONAL	17,643	93.16	1,643,621.88
BECTON DICKINSON	9,809	256.07	2,511,790.63
BOSTON SCIENTIFIC CORP	50,848	43.02	2,187,480.96
CARDINAL HEALTH INC	10,771	59.35	639,258.85
CENTENE CORP	21,222	67.37	1,429,726.14
CERNER CORP	11,888	76.76	912,522.88
CIGNA CORP	13,828	221.44	3,062,072.32
CVS HEALTH CORPORATION	47,521	71.78	3,411,057.38
DANAHER CORP	22,869	163.91	3,748,457.79
DAVITA INC	3,800	85.49	324,862.00
DENTSPLY SIRONA INC	8,300	58.59	486,297.00
DEXCOM INC	3,300	291.68	962,544.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,600	235.31	1,788,356.00
HCA HEALTHCARE INC	9,933	150.08	1,490,744.64
HENRY SCHEIN INC	5,500	73.71	405,405.00
HOLOGIC INC	9,916	52.96	525,151.36
HUMANA	4,949	378.52	1,873,295.48
IDEXX LABORATORIES	3,100	290.97	902,007.00
INSULET CORP	2,200	215.67	474,474.00

INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	4,238	614.88	2,605,861.44
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,644	189.90	691,995.60
MCKESSON CORP	6,758	168.01	1,135,411.58
MEDTRONIC PLC	49,005	113.77	5,575,298.85
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,846	113.48	549,924.08
RESMED INC	5,233	176.62	924,252.46
STERIS PLC	3,100	168.26	521,606.00
STRYKER CORP	12,267	225.10	2,761,301.70
TELEFLEX	1,700	395.14	671,738.00
THE COOPER COS INC	1,831	356.56	652,861.36
UNITED HEALTH GROUP INC	34,691	305.31	10,591,509.21
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	139.03	419,870.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,460	146.60	507,236.00
VEEVA SYSTEMS A	4,900	163.89	803,061.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,700	174.76	471,852.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,431	160.02	1,189,108.62
ABBVIE INC	54,023	94.14	5,085,725.22
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,520	85.35	983,232.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,163	103.21	842,503.23
ALLERGAN PLC	11,925	198.81	2,370,809.25
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,900	129.00	503,100.00
AMGEN INC	21,914	222.96	4,885,945.44
BEIGENE LTD-ADR	1,300	173.19	225,147.00
BIOGEN INC	6,701	341.04	2,285,309.04
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,521	89.87	586,042.27
BIO-RAD LABORATORIES-A	800	409.01	327,208.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	85,676	65.71	5,629,769.96
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,356	29.93	309,955.08
EXACT SCIENCES CORP	4,900	102.52	502,348.00
GILEAD SCIENCES INC	46,210	67.35	3,112,243.50
ILLUMINA INC	5,400	303.20	1,637,280.00
INCYTE CORP	6,608	82.42	544,631.36
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,800	61.73	296,304.00
IQIVA HOLDINGS INC	6,232	164.39	1,024,478.48
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,201	137.62	302,901.62
JOHNSON & JOHNSON	96,525	148.94	14,376,433.50
LILLY (ELI) & CO	31,709	140.83	4,465,578.47
MERCK & CO	93,660	82.00	7,680,120.00
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	907	766.39	695,115.73
MYLAN NV	19,000	20.90	397,100.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,200	104.20	333,440.00
PERKINELMER INC	4,300	94.33	405,619.00
PERRIGO CO PLC	4,879	59.20	288,836.80
PFIZER	202,288	36.23	7,328,894.24
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,977	400.81	1,193,211.37
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,700	121.90	329,130.00
SEATTLE GENETICS	4,400	119.89	527,516.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10,200	13.45	137,190.00

THERMO ELECTRON CORP	14,671	339.74	4,984,325.54
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,410	247.78	2,331,609.80
WATERS CORPORATION	2,527	216.65	547,474.55
ZOETIS INC	17,395	144.06	2,505,923.70
BANK OF AMERICA CORP	323,387	34.72	11,227,996.64
CITIGROUP INC	82,551	78.05	6,443,105.55
CITIZENS FINANCIAL GROUP	16,700	38.35	640,445.00
COMERICA	5,522	62.97	347,720.34
EAST WEST BANCORP	5,300	47.24	250,345.50
FIFTH THIRD BANCORP	26,320	29.64	779,993.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,106	117.27	716,050.62
HUNTINGTON BANCSHARES INC	38,615	14.03	541,768.45
JPMORGAN CHASE & CO	116,990	137.49	16,084,955.10
KEYCORP	37,391	19.73	737,724.43
M & T BANK CORP	4,691	168.26	789,307.66
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	15,100	16.10	243,110.00
PNC BANK CORP	16,287	153.35	2,497,611.45
REGIONS FINANCIAL CORP	37,145	16.43	610,292.35
SIGNATURE BANK	2,000	146.43	292,860.00
SVB FINANCIAL GROUP	1,900	266.99	507,281.00
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	48,938	54.61	2,672,504.18
US BANCORP	54,635	54.75	2,991,266.25
WELLS FARGO COMPANY	152,997	47.09	7,204,628.73
ZIONS BANCORPORATION	6,500	45.81	297,765.00
ALLY FINANCIAL INC.	14,075	28.33	398,744.75
AMERICAN EXPRESS	25,715	136.93	3,521,154.95
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,896	179.04	876,579.84
BANK NEW YORK MELLO CORP	30,857	45.92	1,416,953.44
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,134	229.24	11,034,238.16
BLACKROCK INC	4,190	572.07	2,396,973.30
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	24,100	62.76	1,512,516.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,099	104.14	1,780,689.86
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,200	120.44	505,848.00
CME GROUP INC	13,089	207.50	2,715,967.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,532	75.56	871,357.92
E*TRADE FINANCIAL CORP	8,900	44.93	399,877.00
EATON VANCE CORP	4,400	51.29	225,676.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	12,000	26.98	323,760.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	308.66	432,124.00
FRANKLIN RESOURCES INC	12,005	25.37	304,566.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11,784	237.33	2,796,696.72
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	20,425	95.42	1,948,953.50
INVESCO LTD	15,680	17.69	277,379.20
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	9,000	23.68	213,120.00
KKR & CO INC -A	17,700	33.93	600,561.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,400	341.68	478,352.00
MOODY'S CORPORATION	6,249	285.31	1,782,902.19
MORGAN STANLEY	45,188	56.31	2,544,536.28

MSCI INC	3,170	332.11	1,052,788.70
NASDAQ INC	4,240	115.27	488,744.80
NORTHERN TRUST CORP	7,405	103.07	763,233.35
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,615	101.26	467,314.90
S&P GLOBAL INC	8,978	311.16	2,793,594.48
SCHWAB (CHARLES) CORP	42,916	47.44	2,035,935.04
SEI INVESTMENTS CO COM	4,700	69.13	324,911.00
STATE STREET CORP	13,531	78.76	1,065,701.56
SYNCHRONY FINANCIAL	22,315	33.37	744,651.55
T ROWE PRICE GROUP INC	8,793	139.06	1,222,754.58
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	10,200	49.81	508,062.00
VOYA FINANCIAL INC	5,154	62.47	321,970.38
AFLAC	26,910	51.55	1,387,210.50
ALLEGHANY CORP	548	839.47	460,029.56
ALLSTATE CORP	12,028	124.26	1,494,599.28
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,800	112.15	314,020.00
AMERICAN INT'L GROUP	31,717	49.41	1,567,136.97
AON PLC	8,634	237.43	2,049,970.62
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,650	48.18	705,837.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,000	108.78	761,460.00
ASSURANT INC	2,400	140.68	337,632.00
ATHENE HLDG LTD CLASS A	5,600	49.30	276,080.00
BROWN & BROWN INC	8,800	48.46	426,448.00
CHUBB LTD	16,584	164.21	2,723,258.64
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,637	113.02	637,093.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,000	162.04	162,040.00
EVEREST RE GROUP LTD	1,500	290.58	435,870.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,302	43.94	452,669.88
GLOBE LIFE INC	3,850	110.57	425,694.50
HARTFORD FINANCIAL SVCS	13,509	58.09	784,737.81
LINCOLN NATIONAL CORP	7,615	60.86	463,448.90
LOEWS CORP	10,105	53.71	542,739.55
MARKEL CORP	525	1,336.68	701,757.00
MARSH & MCLENNAN COS	18,475	118.48	2,188,918.00
METLIFE INC	28,971	51.79	1,500,408.09
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,086	55.91	563,908.26
PROGRESSIVE CORP	21,289	81.42	1,733,350.38
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,635	93.10	1,362,518.50
REINSURANCE GRP AMERICA	2,300	151.80	349,140.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,628	198.76	323,581.28
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	9,434	134.51	1,268,967.34
UNUM GROUP	7,632	29.70	226,670.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,828	211.76	1,022,377.28
WR BERKLEY CORP	5,415	79.48	430,384.20
CBRE GROUP INC-A	11,884	63.40	753,445.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,000	5.50	242,000.00
JONES LANG LASALLE INC	2,000	165.91	331,820.00

ACCENTURE PLC-CL A	23,297	215.92	5,030,288.24
ADOBE INC	17,728	383.28	6,794,787.84
AKAMAI TECHNOLOGIES	6,172	102.56	633,000.32
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,800	101.36	182,448.00
ANSYS INC	3,100	296.14	918,034.00
AUTODESK INC	8,037	210.76	1,693,878.12
AUTOMATIC DATA PROCESS	15,863	181.25	2,875,168.75
BLACK KNIGHT INC	5,500	76.10	418,550.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,200	76.54	398,008.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,200	122.88	516,096.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,400	80.02	832,208.00
CDK GLOBAL INC	4,300	52.02	223,686.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	4,603	117.00	538,551.00
CITRIX SYSTEMS INC	4,770	122.25	583,132.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,055	68.88	1,381,288.12
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,400	120.32	168,448.00
DOCUSIGN INC	3,700	91.49	338,513.00
DROPBOX INC-CLASS A	7,800	18.32	142,896.00
DXC TECHNOLOGY CO	9,707	29.80	289,268.60
EPAM SYSTEMS INC	2,000	240.00	480,000.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,396	157.29	3,522,666.84
FISERV INC	21,102	123.55	2,607,152.10
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,181	321.11	1,021,450.91
FORTINET INC	5,400	119.20	643,680.00
GARTNER INC	3,300	153.70	507,210.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,978	206.98	2,272,226.44
GODADDY INC-CLASS A	6,600	76.29	503,514.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,000	122.60	367,800.00
IBM CORP	32,361	150.86	4,881,980.46
INTUIT CORP	9,526	305.61	2,911,240.86
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,900	173.82	504,078.00
LEIDOS HOLDINGS INC	5,100	120.33	613,683.00
MASTERCARD INC-CLASS A	33,014	344.56	11,375,303.84
MICRO FOCUS INTL-SPN ADR	5,761	10.32	59,453.52
MICROSOFT CORP	265,432	187.28	49,710,104.96
MONGODB INC	1,300	180.09	234,117.00
NORTONLIFELOCK INC	23,300	20.70	482,310.00
OKTA INC	3,800	139.50	530,100.00
ORACLE CORP	85,359	55.44	4,732,302.96
PALO ALTO NETWORKS INC	3,440	248.71	855,562.40
PAYCHEX INC	12,051	90.11	1,085,915.61
PAYCOM SOFTWARE INC	1,900	324.48	616,512.00
PAYPAL HOLDINGS INC	40,822	123.91	5,058,254.02
PTC INC	4,000	88.45	353,800.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,700	248.79	671,733.00
SABRE CORP	10,500	22.36	234,780.00
SALESFORCE COM INC COM	30,479	192.87	5,878,484.73

SERVICENOW INC	6,884	357.72	2,462,544.48
SPLUNK INC	5,400	174.17	940,518.00
SQUARE INC - A	12,700	85.24	1,082,548.00
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	8,500	65.15	553,775.00
SYNOPSYS INC	5,615	164.99	926,418.85
TWILIO INC - A	4,300	128.06	550,658.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,400	331.59	464,226.00
VERISIGN INC	3,999	211.23	844,708.77
VISA INC-CLASS A SHARES	63,195	213.31	13,480,125.45
VMWARE INC	3,000	162.33	486,990.00
WESTERN UNION CO	15,216	26.22	398,963.52
WIX.COM LTD	1,800	155.24	279,432.00
WORKDAY INC CLASS A	5,972	197.58	1,179,947.76
AMPHENOL CORP-CL A	10,800	103.11	1,113,588.00
APPLE INC	165,367	323.62	53,516,068.54
ARISTA NETWORKS	1,900	225.02	427,538.00
ARROW ELECTRONICS INC	3,300	79.22	261,426.00
CDW CORP/DE	5,400	136.63	737,802.00
CISCO SYSTEMS	156,482	46.29	7,243,551.78
COGNEX CORP	6,300	52.26	329,238.00
CORNING	29,128	27.96	814,418.88
DELL TECHNOLOGIES INC-C	5,777	53.34	308,145.18
FLEX LTD	20,245	13.34	269,967.07
FLIR SYSTEMS INC	5,300	57.80	306,340.00
FS NETWORKS INC	2,300	129.75	298,425.00
HEWLETT-PACKARD CO	53,903	22.43	1,209,044.29
HP ENTERPRISE CO	48,776	14.47	705,788.72
IPG PHOTONICS CORP	1,500	143.94	215,902.50
JUNIPER NETWORKS INC	12,708	24.00	304,992.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,100	98.48	699,208.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,043	186.12	1,124,723.16
NETAPP INC	8,848	53.21	470,802.08
SEAGATE TECHNOLOGY	8,778	53.95	473,573.10
TE CONNECTIVITY LTD	12,262	93.38	1,145,025.56
TRIMBLE INC	9,343	45.97	429,497.71
WESTERN DIGITAL CORP	10,992	69.56	764,603.52
XEROX HOLDINGS CORPORATION	7,442	36.77	273,642.34
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,900	240.50	456,950.00
AT & T INC	267,183	38.44	10,270,514.52
CENTURYLINK INC	36,489	13.33	486,398.37
SPRINT CORP W/I	33,312	9.49	316,130.88
T MOBILE US INC	12,408	100.49	1,246,879.92
VERIZON COMMUNICATIONS	151,284	58.22	8,807,754.48
ZAYO GROUP HOLDINGS	9,300	34.96	325,128.00
AES CORPORATION	25,262	20.91	528,228.42
ALLIANT ENERGY CORP	8,790	59.47	522,697.35
AMEREN CORPORATION	8,877	85.88	762,356.76
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,985	103.50	1,861,447.50

AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,700	138.70	929,290.00
ATMOS ENERGY CORP	4,358	119.60	521,216.80
CENTERPOINT ENERGY INC	18,956	26.43	501,007.08
CMS ENERGY CORP	10,300	68.48	705,344.00
CONSOLIDATED EDISON	12,059	93.88	1,132,098.92
DOMINION ENERGY INC	29,960	87.84	2,631,686.40
DTE ENERGY	6,666	134.07	893,710.62
DUKE ENERGY CORP	26,565	101.42	2,694,222.30
EDISON INTERNATIONAL	12,616	76.64	966,890.24
ENTERGY CORP	7,320	133.09	974,218.80
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,000	53.62	428,960.00
EVERGY INC	8,800	73.91	650,408.00
EVERSOURCE ENERGY	11,771	94.30	1,110,005.30
EXELON CORP	35,409	49.60	1,756,286.40
FIRSTENERGY CORP	19,616	52.15	1,022,974.40
NEXTERA ENERGY INC	17,490	274.67	4,803,978.30
NISOURCE INC	13,800	30.02	414,276.00
NRG ENERGY INC	9,100	39.40	358,540.00
OGE ENERGY CORP	7,412	45.20	335,022.40
PINNACLE WEST CAPITAL	4,097	101.54	416,009.38
PPL CORPORATION	26,966	35.10	946,506.60
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	18,402	58.90	1,083,877.80
SEMPRA ENERGY	10,041	159.73	1,603,848.93
SOUTHERN CO	38,139	68.61	2,616,716.79
UGI CORP	6,500	41.19	267,735.00
VISTRA ENERGY CORP	14,400	22.69	326,736.00
WEC ENERGY GROUP INC	11,486	102.41	1,176,281.26
XCEL ENERGY INC	18,744	70.79	1,326,887.76
ADVANCED MICRO DEVICES	38,000	58.90	2,238,200.00
ANALOG DEVICES	13,448	123.89	1,666,072.72
APPLIED MATERIALS	33,641	67.41	2,267,739.81
BROADCOM INC	14,546	315.69	4,592,026.74
INTEL CORP	162,028	67.11	10,873,699.08
KLA CORPORATION	5,948	172.98	1,028,885.04
LAM RESEARCH CORP	5,300	333.85	1,769,405.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,700	25.21	572,153.50
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	10,300	63.20	650,960.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,910	109.82	978,496.20
MICRON TECHNOLOGY	40,230	59.99	2,413,397.70
NVIDIA CORP	21,100	314.70	6,640,170.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,191	134.95	1,375,275.45
ON SEMICONDUCTOR CORP	14,700	20.90	307,230.00
QORVO INC	4,225	104.24	440,414.00
QUALCOMM	44,418	90.56	4,022,494.08
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	6,351	119.14	756,658.14
TERADYNE INC	6,300	67.98	428,274.00
TEXAS INSTRUMENTS	34,086	133.13	4,537,869.18
XILINX INC	9,210	90.71	835,439.10

アメリカ・ドル 小計		10,923,894		1,055,309,099.01 (117,434,796,538)
カナダ・ドル	CAMECO CORP	13,622	12.20	166,188.40
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	43,190	40.40	1,744,876.00
	CENOVUS ENERGY INC	37,448	12.02	450,124.96
	ENBRIDGE INC	61,271	55.54	3,402,991.34
	HUSKY ENERGY INC	12,627	8.23	103,920.21
	IMPERIAL OIL LTD	9,985	32.13	320,818.05
	INTER PIPELINE LTD	14,689	21.93	322,129.77
	KEYERA CORP	8,542	35.98	307,341.16
	OVINTIV INC	9,529	21.48	204,682.92
	PARKLAND FUEL CORP	5,300	46.93	248,729.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	19,249	53.15	1,023,084.35
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,236	14.71	106,441.56
	SUNCOR ENERGY INC	56,830	40.32	2,291,385.60
	TC ENERGY CORP	33,907	75.71	2,567,098.97
	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,855	65.63	581,153.65
	BARRICK GOLD CORP	64,580	27.79	1,794,678.20
	CCL INDUSTRIES INC	5,500	57.11	314,105.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,228	11.93	312,900.04
	FRANCO NEV CORP	6,962	155.18	1,080,363.16
	KINROSS GOLD CORP	44,963	7.36	330,927.68
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	7,700	49.58	381,766.00
	LUNDIN MINING CORP	23,000	7.23	166,290.00
	METHANEX CORP	2,381	44.77	106,597.37
	NEWMONT CORPORATION	7,888	61.11	482,035.68
	NUTRIEN LTD	20,853	55.59	1,159,218.27
	TECK RESOURCES LTD	19,208	17.65	339,021.20
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,100	61.33	128,793.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,700	42.55	710,585.00
	BOMBARDIER INC.	91,141	1.46	133,065.86
	CAE Inc.	9,750	40.00	390,000.00
	WSP GLOBAL INC	3,900	96.14	374,946.00
	THOMSON REUTERS CORPORATION	7,462	108.49	809,552.38
	AIR CANADA	4,800	45.31	217,488.00
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	26,225	123.13	3,229,084.25
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,013	357.40	1,791,646.20
	MAGNA INTERNATIONAL INC	11,038	68.81	759,524.78
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,415	36.17	268,200.55
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,333	87.19	813,744.27
	STARS GROUP INC/THE	9,100	33.42	304,122.00
	QUEBECOR INC -CL B	7,000	33.35	233,450.00
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,356	25.80	447,784.80
	CANADIAN TIRE CORP.	2,131	151.00	321,781.00
	DOLLARAMA INC	10,685	41.69	445,457.65
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	31,800	44.10	1,402,380.00
	EMPIRE CO LTD 'A'	6,466	31.50	203,679.00
	LOBLAW COMPANIES LTD	6,572	71.09	467,203.48

METRO INC	9,518	55.66	529,771.88	
WESTON (GEORGE)	2,890	111.15	321,223.50	
SAPUTO INC	8,307	41.27	342,829.89	
AURORA CANNABIS INC	29,300	2.26	66,218.00	
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	11,391	34.93	397,887.63	
CANOPY GROWTH CORP	7,300	28.78	210,094.00	
CRONOS GROUP INC	6,600	9.62	63,492.00	
BANK OF MONTREAL	23,294	101.09	2,354,790.46	
BANK OF NOVA SCOTIA	44,522	74.63	3,322,676.86	
CANADIAN IMPERIAL BANK	16,214	109.04	1,767,974.56	
NATIONAL BANK OF CANADA	12,546	74.48	934,426.08	
ROYAL BANK OF CANADA	52,342	107.76	5,640,373.92	
TRONTO-DOMINION BANK	66,435	75.60	5,022,486.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	32,430	89.89	2,915,132.70	
CI FINANCIAL CORP	8,053	25.11	202,210.83	
IGM FINANCIAL INC	2,833	39.57	112,101.81	
ONEX CORPORATION	3,009	85.39	256,938.51	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	957	626.93	599,972.01	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,846	34.55	340,179.30	
IA FINANCIAL CORP INC	3,993	69.65	278,112.45	
INTACT FINANCIAL CORP	5,000	153.02	765,100.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,320	26.33	1,877,855.60	
POWER CORP OF CANADA	21,433	34.50	739,438.50	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,491	65.32	1,403,792.12	
BLACKBERRY LTD	18,500	8.14	150,590.00	
CGI INC	8,984	101.23	909,450.32	
CONSTELLATION SOFTWARE	755	1,454.33	1,098,019.15	
OPEN TEXT CORP	9,684	62.81	608,252.04	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,700	718.66	2,659,042.00	
BCE INC	5,615	65.07	365,368.05	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	13,404	66.62	892,974.48	
TELUS CORP	7,332	53.72	393,875.04	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	19,000	21.92	416,480.00	
ALTAGAS LTD	9,613	22.57	216,965.41	
ATCO LTD -CLASS I	2,614	54.37	142,123.18	
CANADIAN UTILITIES LTD A	4,700	42.17	198,199.00	
EMERA	8,900	60.03	534,267.00	
FORTIS INC	15,800	58.55	925,090.00	
HYDRO ONE	12,100	28.84	348,964.00	
カナダ・ドル 小計	1,469,255		74,086,095.04 (6,239,530,924)	
オーストラリア・ドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,013	34.77	313,382.01	
OIL SEARCH LTD	50,696	6.39	323,947.44	
ORIGIN ENERGY LIMITED	66,964	7.83	524,328.12	
SANTOS	66,130	8.17	540,282.10	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,496	22.74	124,979.04	
WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	34,951	33.23	1,161,421.73	
WORLEYPARSONS LTD	13,901	14.04	195,170.04	

ALUMINA LTD	88,343	2.14	189,054.02
AMCOR PLC-CDI	37,650	15.40	579,810.00
BHP GROUP LIMITED	107,541	38.50	4,140,328.50
BLUESCOPE STEEL LTD	20,351	13.89	282,675.39
BORAL LIMITED	40,934	4.82	197,301.88
FORTESCUE METALS GROUP LTD	51,521	11.14	573,943.94
INCITEC PIVOT LTD	64,405	3.02	194,503.10
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	16,278	30.79	501,199.62
NEWCREST MINING	28,601	28.28	808,836.28
ORICA	13,984	22.31	311,983.04
RIO TINTO LTD	13,479	98.09	1,322,155.11
SOUTH32 LTD	187,414	2.60	487,276.40
CIMIC GROUP LTD	3,202	27.61	88,407.22
BRAMBLES LTD	59,931	12.90	773,109.90
SEEK LTD	12,170	23.07	280,761.90
AURIZON HOLDINGS LTD	73,906	5.51	407,222.06
QANTAS AIRWAYS LTD	26,005	6.30	163,831.50
SYDNEY AIRPORT	42,048	8.44	354,885.12
TRANSURBAN GROUP	98,529	16.34	1,609,963.86
ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	21,329	37.37	797,064.73
CROWN RESORTS LTD	13,347	11.76	156,960.72
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,483	39.10	97,085.30
TABCORP HOLDINGS LIMITED	71,545	4.31	308,358.95
REA GROUP LTD	1,843	114.88	211,723.84
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,601	4.81	123,140.81
WESFARMERS LIMITED	41,245	46.55	1,919,954.75
COLES GROUP LTD	42,498	16.04	681,667.92
WOOLWORTHS GROUP LTD	45,779	43.53	1,992,759.87
COCA-COLA AMATIL	17,597	12.04	211,867.88
TREASURY WINE ESTATES LTD	26,527	12.00	318,324.00
COCHLEAR LIMITED	2,155	251.55	542,090.25
RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,676	79.84	453,171.84
SONIC HEALTHCARE LIMITED	16,603	31.58	524,322.74
CSL LIMITED	16,552	341.00	5,644,232.00
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	103,306	26.76	2,764,468.56
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,189	9.92	200,274.88
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	64,657	87.83	5,678,824.31
NATIONAL AUSTRALIA BANK	105,077	27.31	2,869,652.87
WESTPAC BANKING	127,282	25.62	3,260,964.84
AMP LTD	113,241	2.08	235,541.28
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	6,952	82.56	573,957.12
CHALLENGER LTD	21,308	10.34	220,324.72
MACQUARIE GROUP LIMITED	11,757	150.78	1,772,720.46
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,485	71.84	322,202.40
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	85,662	6.64	568,795.68
MEDIBANK PRIVATE LTD.	102,132	2.98	304,353.36
QBE INSURANCE GROUP	47,289	15.02	710,280.78
SUNCORP GROUP LTD	47,262	12.20	576,596.40

	LENLEASE GROUP	20,890	17.43	364,112.70	
	COMPUTERSHARE LIMITED	17,881	17.20	307,553.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,977	21.40	106,507.80	
	TELSTRA CORP	149,475	3.75	560,531.25	
	TPG TELECOM LTD	12,694	8.05	102,186.70	
	AGL ENERGY LIMITED	24,425	21.06	514,390.50	
	APA GROUP	44,520	11.36	505,747.20	
	AUSNET SERVICES	77,077	1.78	136,811.67	
	オーストラリア・ドル 小計	2,796,761		53,090,283.60 (3,945,669,877)	
イギリス・ポンド	BP PLC	744,402	4.63	3,445,092.45	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	156,335	19.28	3,014,451.47	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	136,471	19.33	2,637,984.43	
	ANGLO AMERICAN PLC	37,682	20.88	786,800.16	
	ANTOFAGASTA PLC	14,347	8.55	122,638.15	
	BHP GROUP PLC	76,975	16.92	1,302,109.10	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,587	51.85	237,835.95	
	EVRAZ PLC	20,049	3.90	78,271.29	
	GLENCORE PLC	394,413	2.32	915,038.16	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,180	27.12	194,721.60	
	MONDI PLC	18,133	16.71	302,911.76	
	RIO TINTO PLC REG	41,228	42.02	1,732,194.42	
	ASSTEAD GROUP PLC	16,640	27.65	460,096.00	
	BAE SYSTEMS PLC	116,304	6.40	744,345.60	
	BUNZL PLC	12,526	19.20	240,499.20	
	DCC (GB)	3,511	63.54	223,088.94	
	FERGUSON PLC	8,545	76.02	649,590.90	
	MEGGITT PLC	30,402	6.37	193,721.54	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	175,337	2.45	429,400.31	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	62,379	6.62	413,073.73	
	SMITHS GROUP PLC	14,885	17.60	261,976.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,807	94.00	263,858.00	
	WEIR GROUP PLC/THE	9,441	13.55	127,925.55	
	EXPERIAN PLC	33,124	28.98	959,933.52	
	G4S PLC	57,203	2.03	116,236.49	
	INTERTEK GROUP PLC	6,038	59.34	358,294.92	
	RELX PLC	47,523	20.99	997,507.77	
	RENTOKIL INITIAL PLC	70,299	5.04	354,306.96	
	EASYJET PLC	5,750	15.06	86,566.25	
	BARRATT DEVELOPMENTS	37,724	8.78	331,367.61	
	BURBERRY GROUP PLC	15,545	20.13	312,920.85	
	PERSIMMON PLC	11,768	32.98	388,108.64	
	TAYLOR WIMPEY PLC	117,244	2.36	276,930.32	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	4,372	54.74	239,323.28		
CARNIVAL PLC	6,051	31.16	188,549.16		
COMPASS GROUP PLC	57,764	19.50	1,126,109.18		
GVC HOLDINGS PLC	21,347	8.38	178,802.47		

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,465	50.80	328,422.00
TUI AG	16,657	8.56	142,583.92
WHITBREAD PLC	4,772	47.86	228,387.92
AUTO TRADER GROUP PLC	32,875	5.70	187,519.00
INFORMA PLC	46,430	7.78	361,225.40
ITV PLC	133,313	1.32	176,039.81
PEARSON	28,864	5.77	166,603.00
WPP PLC	45,620	9.80	447,258.48
JD SPORTS FASHION PLC	15,740	8.63	135,804.72
KINGFISHER PLC	82,829	2.22	183,466.23
MARKS & SPENCER GROUP PLC	68,134	1.81	123,526.94
NEXT PLC	4,791	71.42	342,173.22
OCADO GROUP PLC	17,430	11.67	203,408.10
MORRISON SUPERMARKETS	84,769	1.83	155,508.73
SAINSBURY (J) PLC	64,288	2.06	132,690.43
TESCO	356,071	2.57	913,678.18
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,189	26.44	348,717.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO	83,757	33.52	2,807,534.64
COCA COLA HBC AG CDI	7,095	28.61	202,987.95
DIAGEO	86,396	31.41	2,713,698.36
IMPERIAL BRANDS PLC	34,604	18.44	638,097.76
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	25,867	64.95	1,680,061.65
UNILEVER PLC	40,485	46.25	1,872,431.25
NMC HEALTH PLC	3,745	7.83	29,323.35
SMITH&NEOHEW PLC	32,605	18.45	601,562.25
ASTRAZENECA PLC	47,939	76.15	3,650,554.85
GLAXOSMITHKLINE PLC	182,258	16.78	3,058,289.24
BARCLAYS PLC	628,031	1.77	1,109,981.98
HSBC HOLDINGS PLC	737,935	5.59	4,125,056.65
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,556,024	0.56	1,425,750.18
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	179,665	2.06	370,109.90
STANDARD CHARTERED PLC	98,944	6.26	619,587.32
3I GROUP PLC	36,107	11.68	421,549.22
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,488	16.97	177,981.36
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	11,444	85.42	977,546.48
M&G PLC	93,974	2.51	236,250.63
SCHRODERS PLC	4,532	33.95	153,861.40
ST JAMES'S PLACE PLC	19,491	11.71	228,142.15
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	90,655	3.30	299,342.81
ADMIRAL GROUP PLC	6,877	23.19	159,477.63
AVIVA PLC	146,159	4.10	598,813.42
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	51,919	3.44	178,705.19
LEGAL & GENERAL GROUP	222,657	3.18	708,717.23
PRUDENTIAL PLC	94,733	14.96	1,417,205.68
RSA INSURANCE GROUP PLC	36,701	5.75	211,030.75
AVEVA GROUP PLC	2,303	52.90	121,828.70
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	7,069	8.01	56,636.82
SAGE GROUP PLC/THE	39,046	7.95	310,259.51

	HALMA PLC	14,444	22.21	320,801.24	
	BT GROUP PLC	313,465	1.55	487,124.61	
	VODAFONE GROUP PLC	975,993	1.56	1,520,597.09	
	CENTRICA PLC	207,769	0.75	155,660.53	
	NATIONAL GRID PLC	126,770	10.67	1,353,142.98	
	SEVERN TRENT PLC	8,476	26.96	228,512.96	
	SSE PLC	36,983	16.87	623,718.29	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,957	10.61	275,403.77	
イギリス・ボンド	小計	10,947,930		65,396,933.15 (9,405,386,925)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	7,136	23.41	167,053.76	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	299	636.50	190,313.50	
	GIVAUDAN-REG	336	3,395.00	1,140,720.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	17,893	49.25	881,230.25	
	SIKA AG-BEARER	4,629	186.50	863,308.50	
	ABB LTD	67,131	24.06	1,615,171.86	
	GEBERIT AG-REG	1,382	535.80	740,475.60	
	SCHINDLER HLDG AG	730	229.60	167,608.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,520	237.20	360,544.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,727	57.98	332,051.46	
	SGS S.A.	191	2,649.00	505,959.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,932	158.70	306,608.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	19,011	72.92	1,386,282.12	
	THE SWATCH GROUP	1,897	47.56	90,221.32	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,064	248.00	263,872.00	
	DUFRY AG-REG	1,447	84.88	122,821.36	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	86	2,214.00	190,404.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	41	8,620.00	353,420.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	93,500.00	374,000.00	
	NESTLE SA-REG	108,849	109.46	11,914,611.54	
	ALCON INC	15,079	62.38	940,628.02	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,000	256.40	512,800.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	370	1,013.50	374,995.00	
	LOMZA AG-REG	2,705	422.70	1,143,403.50	
	NOVARTIS AG-REG SHS	78,545	95.82	7,526,181.90	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	25,690	351.15	9,021,043.50	
	VIFOR PHARMA AG	1,662	180.25	299,575.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	93,000	13.57	1,261,545.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,042	49.23	395,907.66	
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1,347	81.50	109,780.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	695	960.00	667,200.00	
	UBS GROUP AG	140,656	12.91	1,815,868.96	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,744	181.70	316,884.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,214	521.40	632,979.60	
	SWISS RE LTD	10,716	116.80	1,251,628.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,457	439.90	2,400,534.30	
	SWISS PRIME SITE REG	2,885	123.70	356,874.50	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,342	164.60	385,493.20	

	SWISSCOM	962	575.60	553,727.20	
スイス・フラン	小計	636,416		51,933,728.61 (5,880,975,428)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	98,123	70.05	6,873,516.15	
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	51,540	10.08	519,523.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	49,500	69.15	3,422,925.00	
	MTR CORP	57,246	45.20	2,587,519.20	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	22,500	21.50	483,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	78,000	57.65	4,496,700.00	
	SANDS CHINA LTD	89,744	40.15	3,603,221.60	
	SJM HOLDINGS LTD	67,000	9.45	633,150.00	
	WYNN MACAU LTD	56,961	17.50	996,817.50	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	47,100	24.90	1,172,790.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	30,000	32.05	961,500.00	
	WH GROUP LIMITED	343,000	8.59	2,946,370.00	
	BANK EAST ASIA	50,043	17.74	887,762.82	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	133,489	27.60	3,684,296.40	
	HANG SENG BANK	28,800	163.70	4,714,560.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	43,541	270.40	11,773,486.40	
	AIA GROUP LTD	441,684	79.80	35,246,383.20	
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	96,133	51.45	4,946,042.85	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	74,000	18.18	1,345,320.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	53,308	37.00	1,972,396.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	28,500	23.30	664,050.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	229,174	10.30	2,360,492.20	
	SINO LAND	120,997	11.02	1,333,386.94	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	57,608	115.00	6,624,920.00	
	SWIRE PACIFIC A	17,500	75.05	1,313,375.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,877	25.30	1,059,488.10	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	45,125	41.50	1,872,687.50	
	WHEELLOCK & CO LTD	29,000	48.50	1,406,500.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	139,000	12.04	1,673,560.00	
	PCCW LIMITED	143,000	4.80	686,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	24,000	54.85	1,316,400.00	
	CLP HOLDINGS	61,317	82.20	5,040,257.40	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	92,161	7.84	722,542.24	
	HONGKONG CHINA GAS	367,644	15.18	5,580,835.92	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,000	56.30	2,927,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,000	100.30	1,003,000.00	
香港・ドル	小計	3,370,615		128,853,525.62 (1,845,182,487)	
シンガポール・ ドル	KEPPEL CORP LTD	53,700	6.70	359,790.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	29,660	2.04	60,506.40	
	SINGAPORE TECH ENGR.	54,600	4.31	235,326.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	86,000	1.02	87,720.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	82,000	2.06	168,920.00	
	SATS LIMITED	26,500	4.52	119,780.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	18,400	8.57	157,688.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	224,000	0.89	198,240.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	67,000	2.03	136,010.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,280	29.10	124,548.00	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	73,000	4.06	296,380.00	
	DBS GROUP HOLDING	65,268	25.31	1,651,933.08	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	117,756	11.09	1,305,914.04	
	UNITED OVERSEAS BANK	45,743	26.05	1,191,605.15	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,400	9.38	275,772.00	
	CAPITALAND LIMITED	91,385	3.74	341,779.90	
	CITY DEVELOPMENTS	15,700	11.01	172,857.00	
	UOL GROUP LIMITED	16,200	8.20	132,840.00	
	VENTURE CORP LTD	9,700	16.86	163,542.00	
	SINGAPORE TELECOM	295,674	3.17	937,286.58	
	シンガポール・ドル 小計	1,405,966		8,118,438.15 (647,932,548)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,234	5.41	168,975.94	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	8.35	289,703.25	
	A2 MILK CO LTD	26,114	16.43	429,053.02	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,211	25.11	532,608.21	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	13,260	16.60	220,116.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	69,089	4.78	330,245.42	
	MERCURY NZ LTD	23,232	5.62	130,563.84	
	MERIDIAN ENERGY LTD	44,665	5.68	253,697.20	
	ニュージーランド・ドル 小計	263,500		2,354,962.88 (167,461,410)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,791	309.40	2,101,135.40	
	BOLIDEN AB	10,491	232.00	2,433,912.00	
	ALFA LAVAL AB	11,218	253.70	2,846,006.60	
	ASSA ABLOY AB-B	36,369	244.70	8,899,494.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	24,392	371.30	9,056,749.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,472	329.10	4,762,735.20	
	EPIROC AB-A	23,507	118.25	2,779,702.75	
	EPIROC AB-B	15,442	115.00	1,775,830.00	
	SANDVIK AB	42,122	183.35	7,723,068.70	
	SKANSKA AB-B	12,783	237.60	3,037,240.80	
	SKF AB-B SHARES	13,533	191.05	2,585,479.65	
	VOLVO AB-B SHS	53,923	171.70	9,258,579.10	
	SECURITAS B	11,349	148.05	1,680,219.45	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,304	219.30	1,821,067.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,367	72.20	1,037,297.40	
	HENNES & MAURITZ B	30,308	202.85	6,147,977.80	
	ICA GRUPPEN AB	3,139	399.40	1,253,716.60	
	SWEDISH MATCH	6,087	622.00	3,786,114.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	22,617	319.00	7,214,823.00	
	NORDEA BANK ABP	118,440	85.79	10,160,967.60	
SKAND. ENSKILDA BANKEN A	60,441	104.30	6,303,996.30		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	57,109	112.30	6,413,340.70		

	SWEDBANK AB	32,607	160.90	5,246,466.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,013	253.10	1,521,890.30	
	INVESTOR AB SER B NPV	16,533	565.20	9,344,451.60	
	KINNEVIK AB-B SHS	9,233	232.90	2,150,365.70	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,984	449.60	1,341,606.40	
	"ERICSSON (LM) TEL,SEK1 SER B"	111,582	88.12	9,832,605.84	
	HEXAGON AB B SHS	9,475	572.00	5,419,700.00	
	MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 US D1.5	2,554	462.20	1,180,458.80	
	TELE2 AB-B SHS	19,366	151.90	2,941,695.40	
	TELIA COMPANY AB	102,682	42.14	4,327,019.48	
スウェーデン・クローネ 小計		910,233		146,385,713.97 (1,667,333,282)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	3,823	255.30	976,011.90	
	EQUINOR ASA	36,280	159.35	5,781,218.00	
	NORSK HYDRO	50,825	29.97	1,523,225.25	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,565	382.40	2,510,456.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,292	246.80	812,465.60	
	MOWI ASA	16,707	228.00	3,809,196.00	
	ORKLA ASA	28,896	88.68	2,562,497.28	
	DNB ASA	35,317	175.90	6,212,260.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,957	207.00	1,440,099.00	
TELENOR ASA	26,770	163.15	4,367,525.50		
ノルウェー・クローネ 小計		215,432		29,994,954.83 (360,239,407)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,758	556.20	2,090,199.60	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	7,655	382.00	2,924,210.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,837	712.40	4,870,678.80	
	ISS A/C	5,620	162.85	915,217.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	242	8,562.00	2,072,004.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	139	7,990.00	1,110,610.00	
	DSV PANALPINA A S	7,889	791.20	6,241,776.80	
	PANDORA A/S	3,715	335.00	1,244,525.00	
	CARLSBERG B	3,979	1,021.50	4,064,548.50	
	COLOPLAST B	4,469	991.40	4,430,566.60	
	DEMANT A/S	3,906	230.10	898,770.60	
	GENMAB A/S	2,345	1,634.00	3,831,730.00	
	H. LUNDBECK A/S	2,404	269.10	646,916.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,638	444.00	28,699,272.00	
	DANSKE BANK A/S	24,126	120.45	2,905,976.70	
TRYG A/S	4,970	208.80	1,037,736.00		
ORSTED A/S	7,046	771.20	5,433,875.20		
デンマーク・クローネ 小計		153,738		73,418,613.20 (1,182,039,672)	
イスラエル・シェケル	INTL FLAVORS AND FRAGR	74	465.20	34,424.80	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,350	13.21	374,503.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	923	557.80	514,849.40	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	30,293	44.30	1,341,979.90	

	BANK HAPOLIM BM	41,839	28.88	1,208,310.32	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	54,720	24.29	1,329,148.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	45,647	15.69	716,201.43	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,788	93.30	540,020.40	
	AZRIELI GROUP	1,403	279.60	392,278.80	
	NICE LTD	2,227	608.40	1,354,906.80	
イスラエル・シェケル 小計		211,264		7,806,624.15 (253,403,020)	
ユーロ	ENI SPA	92,610	12.94	1,198,188.18	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	17,893	14.59	260,969.40	
	NESTE OYJ	15,724	39.50	621,098.00	
	OMV AG	5,438	43.64	237,314.32	
	REPSOL SA	55,383	12.35	683,980.05	
	TECHNIPFMC PLC	6,886	15.86	109,177.53	
	TENARIS SA	17,691	9.46	167,356.86	
	TOTAL SA	87,699	45.05	3,950,839.95	
	VOPAK	2,526	50.12	126,603.12	
	AIR LIQUIDE	17,210	140.30	2,414,563.00	
	AKZO NOBEL	8,505	86.93	739,339.65	
	ARKEMA	2,547	84.70	215,730.90	
	BASF SE	33,509	61.10	2,047,399.90	
	COVESTRO	6,710	40.61	272,493.10	
	CRH	28,974	35.18	1,019,305.32	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,767	26.85	181,693.95	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,442	41.20	100,610.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,338	61.40	327,753.20	
	KONINKLIJKE DSM N.V	6,577	116.00	762,932.00	
	LANXESS AG	3,179	56.00	178,024.00	
	LINDE PLC	7,041	205.60	1,447,629.60	
	NLG) ARCELORMITTAL	24,836	15.48	384,411.60	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,322	34.04	283,280.88	
	SOLVAY	2,746	94.76	260,210.96	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	21,462	11.99	257,329.38	
	SYMRISE AG	4,828	99.00	477,972.00	
	THYSSENKRUPP AG	15,587	10.04	156,493.48	
	UMICORE	7,059	43.65	308,125.35	
	UPM-KYMMENE	19,294	30.01	579,012.94	
	VOESTALPINE AG	4,269	22.46	95,881.74	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,794	29.75	291,371.50	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV-RTS	9,794	0.44	4,338.74	
	AIRBUS SE	21,307	131.80	2,808,262.60	
	ALSTOM	6,443	47.54	306,300.22	
	ANDRITZ AG	2,569	35.50	91,199.50	
	BOUYGUES SA	8,320	39.40	327,808.00	
BRENNTAG AG	5,838	49.00	286,062.00		
CIE DE SAINT-GOBAIN	17,811	35.62	634,427.82		
CNH INDUSTRIAL NV	37,493	8.81	330,313.33		
DASSAULT AVIATION	90	1,074.00	96,660.00		

EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV IS10	2,896	111.00	321,456.00	
FERROVIAL SA	18,201	30.45	554,220.45	
GEA GROUP AG NPV	5,542	27.76	153,845.92	
HOCHTIEF	1,048	109.10	114,336.80	
KINGSPAN GROUP PLC	5,499	62.85	345,612.15	
KION GROUP AG	2,348	59.20	139,001.60	
KNORR-BREMSE AG	1,883	99.16	186,718.28	
KONE OYJ	12,689	54.62	693,073.18	
LEGRAND PROMESSES EUR4	9,959	77.00	766,843.00	
LEONARDO SPA	14,194	11.26	159,753.47	
METSO OYJ	3,699	33.25	122,991.75	
MTU AERO ENGINES AG	1,955	271.90	531,564.50	
PRYSMIAN SPA EURO.10	8,840	24.71	218,436.40	
SAFRAN SA	11,930	145.95	1,741,183.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,161	97.40	1,963,681.40	
SIEMENS AG	27,939	106.88	2,986,120.32	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,477	16.11	136,522.08	
THALES SA	3,829	95.62	366,128.98	
VINCI SA	18,625	106.75	1,988,218.75	
WARTSILA OYJ	16,662	10.78	179,616.36	
BUREAU VERITAS	10,475	25.09	262,817.75	
RANDSTAD NV	4,471	54.56	243,937.76	
RELX PLC	23,333	25.14	586,591.62	
TELEPERFORMANCE	2,201	244.20	537,484.20	
WOLTERS KLUWER CVA	10,435	70.96	740,467.60	
ADP	1,095	169.00	185,055.00	
AENA SME SA	2,503	169.45	424,133.35	
ATLANTIA SPA	18,583	22.69	421,648.27	
DEUTSCHE POST AG-REG	36,005	32.57	1,172,502.82	
FRAPORT AG NPV	1,722	69.84	120,264.48	
GETLINK SE	17,009	16.80	285,751.20	
LUFTHANSA	9,306	15.40	143,312.40	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	12,023	65.45	786,905.35	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	2,336	51.85	121,121.60	
CONTINENTAL	4,143	111.62	462,441.66	
DAIMLER AG	33,137	42.77	1,417,269.49	
FAURECIA	2,768	44.67	123,646.56	
FERRARI NV	4,496	167.20	751,731.20	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	40,417	12.27	495,835.75	
MICHELIN B	6,379	109.95	701,371.05	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,789	26.76	128,153.64	
PEUGEOT SA	21,183	19.50	413,068.50	
PIRELLI & C SPA	13,965	4.87	67,953.69	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	5,504	64.98	357,649.92	
RENAULT SA	7,189	31.72	227,999.13	
VALEO SA	8,953	27.05	242,178.65	
VOLKSWAGEN STAMM	1,150	171.75	197,512.50	
VOLKSWAGEN VORZUG	6,755	170.12	1,149,160.60	

ADIDAS AG	6,580	292.70	1,925,966.00
ESSILORLUXOTTICA	10,326	142.60	1,472,487.60
HERMES INTERNATIONAL	1,149	712.80	819,007.20
KERING	2,762	587.00	1,621,294.00
LVMH	10,158	419.05	4,256,709.90
MONCLER SPA	6,626	39.04	258,679.04
PUMA SE	2,946	80.10	235,974.60
SEB	886	119.00	105,434.00
ACCOR SA	6,256	38.94	243,608.64
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,903	107.60	312,362.80
SODEXO	3,342	100.55	336,038.10
ALTICE EUROPE NV	24,117	6.46	155,844.05
BOLLORE	30,462	3.73	113,623.26
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,348	13.00	82,492.26
JC DECAUX SA	2,913	22.82	66,474.66
PUBLICIS GROUPE	7,892	41.29	325,860.68
SES	13,477	11.07	149,123.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,970	40.34	79,469.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,988	74.86	223,681.68
VIVENDI SA	31,908	25.07	799,933.56
DELIVERY HERO SE	4,049	80.06	324,162.94
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	39,706	32.08	1,273,768.48
JUST EAT TAKEAWAY	3,691	91.50	337,726.50
PROSUS NV	17,741	72.43	1,284,980.63
ZALANDO SE	5,098	48.90	249,292.20
CARREFOUR	23,013	16.07	369,818.91
CASINO ORD	1,748	36.38	63,592.24
COLRUYT NV	1,986	46.40	92,150.40
JERONIMO MARTINS	9,027	17.22	155,399.80
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	43,016	23.76	1,021,845.08
METRO AG	6,776	12.20	82,667.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	27,792	68.20	1,895,414.40
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	7,100	51.30	364,230.00
DANONE	22,505	71.60	1,611,358.00
DAVIDE CAMPARI -MILANO SPA	21,075	8.68	182,931.00
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	4,142	93.70	388,105.40
HEINEKEN NV	9,419	104.95	988,524.05
KERRY GROUP A	5,925	125.60	744,180.00
PERNOD RICARD	7,731	169.05	1,306,925.55
REMY COINTREAU	796	103.50	82,386.00
BEIERSDORF	3,734	107.35	400,844.90
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	6,642	93.86	623,418.12
HENKEL KGAA	3,965	84.55	335,240.75
L'OREAL	9,223	272.30	2,511,422.90
UNILEVER NV	53,574	54.86	2,939,069.64
BIOMERIEUX	1,392	96.50	134,328.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,591	111.20	176,919.20

FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	7,926	74.80	592,864.80
FRESENIUS SE & CO KGaA	15,605	48.64	759,027.20
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32,979	45.09	1,486,858.21
SARTORIUS AG-VORZUG	1,315	240.00	315,600.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,330	40.62	216,477.95
BAYER AG	34,040	75.48	2,569,339.20
EUROFINS SCIENTIFIC	430	476.00	204,680.00
GALAPAGOS NV	1,594	247.30	394,196.20
GRIFOLS SA	11,013	34.07	375,212.91
IPSEN	1,583	67.80	107,327.40
MERCK KGAA	4,807	125.60	603,759.20
ORION OYJ	3,906	38.86	151,787.16
QIAGEN N.V.	8,373	34.25	286,775.25
RECORDATI	3,655	42.16	154,094.80
SANOFI	41,168	94.00	3,869,792.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	969	187.70	181,881.30
UCB SA	4,542	89.50	406,509.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,708	15.11	237,347.88
AIB GROUP PLC	29,132	2.25	65,547.00
BANCA INTESA SPA	541,770	2.60	1,410,498.19
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	242,608	5.17	1,255,253.79
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192		
BANCO SANTANDER SA	606,302	3.92	2,374,884.93
BANK OF IRELAND GROUP PLC	36,992	4.00	147,968.00
BANKIA SA	42,322	1.73	73,153.57
BANKINTER, S.A.	26,337	6.24	164,342.88
BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV	214,457	0.89	190,652.27
BNP PARIBAS	41,033	53.75	2,205,523.75
CAIXABANK	134,124	2.75	368,975.12
COMMERZBANK AG	37,296	6.68	249,137.28
CREDIT AGRICOLE SA	41,695	13.34	556,002.82
ERSTE GROUP BANK AG	11,259	35.15	395,753.85
FINECOBANK SPA	22,503	11.19	251,808.57
ING GROUP N.V.	141,962	10.03	1,423,311.01
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	9,036	71.10	642,459.60
MEDIOBANCA	23,487	9.75	228,998.25
NORDEA BANK ABP	1,730	8.10	14,019.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,358	22.35	119,751.30
SOCIETE GENERALE-A	29,050	31.80	923,644.75
UNICREDIT SPA	73,042	14.13	1,032,229.54
AMUNDI SA	2,166	77.85	168,623.10
DEUTSCHE BANK AG-REG	72,963	9.91	723,136.29
DEUTSCHE BOERSE AG	6,907	157.20	1,085,780.40
EURAZEO	1,643	65.65	107,862.95
EXOR NV	4,019	75.26	302,469.94
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,025	94.66	286,346.50

NATIXIS	34,559	4.33	149,778.70
WENDEL	971	126.20	122,540.20
AEGON NV	66,132	3.75	248,127.26
AGEAS	6,675	50.26	335,485.50
ALLIANZ	15,503	231.65	3,591,269.95
ASSICURAZIONI GENERALI	39,841	18.88	752,198.08
AXA	70,433	25.37	1,786,533.04
CNP ASSURANCES	6,177	17.17	106,059.09
HANNOVER RUECK SE	2,232	192.40	429,436.80
MAPFRE SA	44,197	2.40	106,205.39
MUENCHENER RUECK AG-REG	5,256	281.30	1,478,512.80
NN GROUP NV	11,305	36.73	415,232.65
POSTE ITALIANE	18,953	11.51	218,149.03
SAMPO INSURANCE CO A	16,523	41.53	686,200.19
SCOR SE	5,621	37.32	209,775.72
AROUNDTOWN SA	32,616	8.81	287,412.19
BGP HOLDINGS PLC	1,671,480		
DEUTSCHE WOHNEN SE	12,977	39.19	508,568.63
VONOVIA SE	19,171	54.06	1,036,384.26
ADYEN NV	398	893.80	355,732.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	15,694	73.32	1,150,684.08
ATOS SE	3,693	78.10	288,423.30
CAPGEMINI SA	5,757	115.30	663,782.10
DASSAULT SYSTEMES	4,768	157.50	750,960.00
EDENRED	8,981	50.30	451,744.30
SAP SE	35,914	129.44	4,648,708.16
WIRECARD AG	4,420	137.20	606,424.00
WORLDLINE SA	3,253	77.50	252,107.50
INGENICO GROUP	2,209	142.10	313,898.90
NOKIA OYJ	204,408	3.89	795,453.73
CELLNEX TELECOM SA	9,005	48.89	440,254.45
DEUTSCHE TELEKOM	121,520	16.55	2,011,156.00
ELISA CORP-A SHARES	5,535	57.50	318,262.50
ILIAD SA	1,039	136.00	141,304.00
KPN (KON. PTT NEDERLAND	132,190	2.52	333,383.18
ORANGE S.A.	72,492	13.46	975,379.86
PROXIMUS	5,519	27.08	149,454.52
TELECOM ITALIA SPA	333,928	0.52	174,277.02
TELECOM ITALIA-RNC	206,844	0.51	106,317.81
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	2.60	71,837.29
TELEFONICA S.A.	169,893	6.54	1,111,100.22
UNITED INTERNET	3,527	31.39	110,712.53
E.ON SE	81,481	11.48	935,238.91
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	95,693	4.93	471,383.71
ELEC DE FRANCE EURO.5	22,912	13.47	308,510.08
ENAGAS	8,825	25.62	226,096.50
ENDESA SA	11,338	26.12	296,148.56
ENEL SPA	296,753	8.57	2,541,986.19

ENGIE	66,388	16.65	1,105,028.26	
FORTUM OYJ	16,615	22.63	375,997.45	
IBERDROLA SA	224,562	11.22	2,519,585.64	
NATURGY ENERGY GROUP SA	11,144	24.61	274,253.84	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,120	19.61	316,113.20	
RWE AG	21,504	34.41	739,952.64	
SNAM SPA	76,150	5.10	388,365.00	
SUEZ	12,964	15.61	202,368.04	
TERNA SPA	52,455	6.79	355,959.63	
UNIPER SE	7,326	29.86	218,754.36	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,211	28.90	584,097.90	
VERBUND AG	2,339	50.05	117,066.95	
ASML HOLDING NV	15,554	292.90	4,555,766.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	45,435	22.19	1,007,975.47	
STMICROELECTRONICS NV	24,717	29.13	720,006.21	
ユーロ 小計	9,013,777		161,636,070.72 (19,443,202,947)	
合計	42,318,781		168,473,154,465 (168,473,154,465)	

(注) 1 . 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	19,600	381,024.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	4,100	693,679.00	
		AMERICAN TOWER CORP	16,192	4,017,235.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	52,500	546,525.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,115	1,154,967.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,650	818,685.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,506	413,041.86	
		CROWN CASTLE INTL CORP	15,166	2,511,489.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,800	1,032,798.00	
		DUKE REALTY CORP	13,600	521,696.00	
		EQUINIX INC	3,127	2,012,912.44	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,200	466,798.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	13,443	1,147,225.62	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,337	751,649.31	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,800	515,904.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,800	351,820.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,600	684,852.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	27,048	451,972.08	
		INVITATION HOMES INC	17,400	552,798.00	
		IRON MOUNTAIN INC	10,557	356,826.60	
		KIMCO REALTY CORP	16,600	308,096.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	18,900	449,820.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	4,137	599,989.11	
NATIONAL RETAIL PPTYS	5,800	329,208.00			

	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,000	351,120.00	
	PROLOGIS INC	27,061	2,645,753.97	
	PUBLIC STORAGE	5,730	1,253,724.00	
	REALTY INCOME CORP	11,774	938,034.58	
	REGENCY CENTERS CORP	6,000	380,040.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	4,200	1,217,370.00	
	SIMON PPTY (SIMON DEBART	11,180	1,531,771.80	
	SL GREEN REALTY CORP	3,000	281,790.00	
	SUN COMMUNITIES INC	3,400	572,832.00	
	UDR INC	10,800	541,944.00	
	VENTAS INC COM	13,800	816,270.00	
	VEREIT INC	39,092	384,274.36	
	VICI PROPERTIES INC	17,100	469,737.00	
	VORNADO REALTY TRUST	6,359	409,392.42	
	WELLTOWER INC	14,791	1,297,762.34	
	WEYERHAEUSER CO	27,060	821,812.20	
	WP CAREY INC	6,500	550,095.00	
アメリカ・ドル 小計		510,825	35,534,735.49 (3,954,305,365)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,800	166,432.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	3,441	75,426.72	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TR-REIT UNIT	5,913	127,779.93	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,000	137,750.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,100	65,793.00	
カナダ・ドル 小計		19,254	573,181.65 (48,273,358)	
オーストラリア・ドル	DEXUS	41,637	558,352.17	
	GOODMAN GROUP	59,453	988,108.86	
	GPT GROUP	69,421	435,269.67	
	MIRVAC GROUP	140,592	466,765.44	
	SCENTRE GROUP	200,028	740,103.60	
	STOCKLAND	89,428	464,131.32	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-CDI	16,240	165,648.00	
	VINCINITY CENTERS	117,781	277,963.16	
オーストラリア・ドル 小計		734,580	4,096,342.22 (304,440,153)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	34,396	195,025.32	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,622	258,233.40	
	SEGRO PLC	41,355	381,789.36	
イギリス・ポンド 小計		102,373	835,048.08 (120,096,614)	
香港・ドル	LINK REIT	78,487	6,125,910.35	
香港・ドル 小計		78,487	6,125,910.35 (87,723,036)	

シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	106,050	352,086.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	93,946	195,407.68	
	CAPITALAND MALL TRUST	97,221	245,969.13	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	71,600	170,408.00	
	SUNTEC REAL ESTAITTE INVESTMENT TRUST	72,600	132,132.00	
シンガポール・ドル 小計		441,417	1,096,002.81 (87,471,984)	
ユーロ	COVIVIO	1,671	186,483.60	
	GECINA SA	1,691	308,776.60	
	ICADE	1,152	120,384.00	
	KLEPIERRE	7,517	235,582.78	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,354	548,604.00	
ユーロ 小計		16,385	1,399,830.98 (168,385,668)	
投資証券 小計			4,770,696,178 (4,770,696,178)	
合計			4,770,696,178 (4,770,696,178)	

- (注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
 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。
 3. 投資証券における券面総額は、証券数です。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 610銘柄	96.7%		70.1%
	投資証券 41銘柄		3.3%	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	99.2%		3.6%
	投資証券 5銘柄		0.8%	
オーストラリア・ドル	株式 63銘柄	92.8%		2.5%
	投資証券 8銘柄		7.2%	
イギリス・ポンド	株式 93銘柄	98.7%		5.5%
	投資証券 3銘柄		1.3%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	100.0%		3.4%
香港・ドル	株式 36銘柄	95.5%		1.1%
	投資証券 1銘柄		4.5%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	88.1%		0.4%
	投資証券 5銘柄		11.9%	
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%
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%		0.2%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100.0%		0.7%
イスラエル・シェケル	株式 10銘柄	100.0%		0.1%
ユーロ	株式 244銘柄	99.1%		11.3%
	投資証券 5銘柄		0.9%	

(注) 組入株式時価比率及び組入投資証券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表
 該当する事項はありません。

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関係に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		260,140,815	697,986,436
金銭信託		785,872	584,006
コール・ローン		98,736,930	238,292,886
国債証券		144,429,871,714	176,496,966,424
派生商品評価勘定		12,000	
未収利息		1,205,972,511	1,265,355,099
前払費用		59,399,221	61,335,996
流動資産合計		146,054,919,063	178,760,520,847
資産合計		146,054,919,063	178,760,520,847
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		33,000	
未払解約金		60,374,892	205,554,722
未払利息		251	657
その他未払費用		210	39
流動負債合計		60,408,353	205,555,418
負債合計		60,408,353	205,555,418
純資産の部			
元本等			
元本	1	64,007,469,031	73,334,845,875
剰余金			
剰余金又は欠損金()		81,987,041,679	105,220,119,554
元本等合計		145,994,510,710	178,554,965,429
純資産合計		145,994,510,710	178,554,965,429
負債純資産合計		146,054,919,063	178,760,520,847

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月21日から、翌年2月20日までであります。

(2) 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</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
-------------------	--

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 期首元本額	77,182,711,057円	64,007,469,031円
期中追加設定元本額	17,652,006,111円	30,359,812,025円
期中一部解約元本額	30,827,248,137円	21,032,435,181円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	6,151,926,579円	6,291,104,333円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	16,224,013円	20,853,801円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン(ステイブル)	819,834,527円	763,843,839円
外国債券インデックス・ファンド / 為替ヘッジ付き(年金1) < 適格機関投資家限定 >	1,546,466,428円	5,417,830,174円
外国債券パッシブ・ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,772,355,475円	1,882,203,113円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	4,992,225円	2,943,162円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	377,645,298円	222,084,839円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	84,219円	82,574円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	7,628,195円	7,586,051円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	4,251,183円	3,234,093円

バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	8,259,856,676円	7,581,001,007円
外国債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	106,604,554円	98,318,990円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	3,165,556円	2,756,436円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	3,396,546,005円	2,916,006,429円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,492,658,471円	1,360,263,266円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	36,624,722円	37,193,740円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	269,254,164円	968,304,960円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,260,005,070円	3,940,399,378円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	533,211,369円	1,090,922,090円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	3,590,404,794円	3,081,102,256円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	107,507,805円	93,891,388円
世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	187,022,504円	円
外国債券インデックス・ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	148,688,336円	148,430,810円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	100,878,655円	100,195,272円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	58,728,277円	57,189,023円
外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	3,894,205,578円	5,387,130,583円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	37,363,302円	49,611,848円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	668,782,969円	585,825,671円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	3,809,488円	2,792,788円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,356,085円	2,279,440円
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	13,787,084,927円	17,394,564,903円
外国債券インデックス・ファンドA<適格機関投資家限定>	618,524,266円	106,385,803円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	1,136,987,195円	1,026,672,004円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,927,690,179円	1,699,795,288円
外国債券インデックス・ファンドA/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定>	1,094,196,514円	795,004,028円

4 資産インデックスバランスV A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	33,525,745円	32,704,740円
T a dリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機関投資家限定 >	136,849,852円	97,375,498円
債券マルチ・ファクター戦略ファン ド（年金）< 適格機関投資家限定 >	534,530,098円	394,501,692円
フレックス資産配分戦略ファンド< 適格機関投資家限定 >	393,259,414円	143,565,053円
T a dリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）< 適 格機関投資家限定 >	120,956,525円	83,959,379円
ステート・ストリート先進国債券イ ンデックス・オープン	133,205,198円	63,005,172円
ステート・ストリート先進国債券イ ンデックス・オープン（為替ヘッジ あり）	3,618,286,122円	4,477,268,418円
世界国債タームスプレッド・プレミ ア戦略ファンド/ 為替ヘッジ付< 適 格機関投資家限定 >	3,834,415,948円	4,211,046,152円
グローバルバランス4 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	4,182,372円	2,260,911円
グローバルバランス4 0 V A 2 < 適 格機関投資家限定 >	664,153,566円	586,796,983円
グローバルバランス4 0 V A 3 < 適 格機関投資家限定 >	93,605,621円	87,955,166円
グローバルバランス5 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	16,932,967円	16,603,331円
計	64,007,469,031円	73,334,845,875円
2 受益権の総数	64,007,469,031口	73,334,845,875口

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引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。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。</p>

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2020年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、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、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>
---------------------------	--	--

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（2019年 2月20日現在）	（2020年 2月20日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	958,577,648	8,381,760,440
合計	958,577,648	8,381,760,440

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2019年 2月20日現在）			
		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				
	アメリカ・ドル	166,125,000		166,095,000	30,000
	イギリス・ポンド	28,933,000		28,930,000	3,000
	ユーロ	150,852,000		150,864,000	12,000
	合 計	345,910,000		345,889,000	21,000

（注）1．時価の算定方法

(1) 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。

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。

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。

- ・ 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先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 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) 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、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。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（2020年2月20日現在）

該当する事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（2019年 2月20日現在）	（2020年 2月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2809円 （22,809円）	2.4348円 （24,348円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 5.25% 29/02/15	1,500,000	1,966,289.07	
		US TREASURY N/B 1.88% 21/11/30	4,000,000	4,029,218.76	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/11/30	11,300,000	11,480,976.50	
		US TREASURY N/B 1.63% 23/05/31	5,500,000	5,539,960.91	
		US TREASURY N/B 2.13% 23/11/30	4,500,000	4,619,707.02	
		US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	7,600,000	7,845,515.64	
		US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	3,600,000	4,792,218.76	
		US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	2,900,000	3,176,632.79	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	1,200,000	1,661,765.62	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000	1,298,074.22	
		US TREASURY N/B 1.38% 21/01/31	3,400,000	3,395,085.94	
		US TREASURY N/B 3.63% 21/02/15	7,500,000	7,653,808.57	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/02/28	8,500,000	8,541,835.98	
		US TREASURY N/B 2.25% 21/03/31	9,000,000	9,072,773.46	
		US TREASURY N/B 2.38% 21/04/15	6,800,000	6,867,203.10	
		US TREASURY N/B 1.38% 21/04/30	7,500,000	7,488,867.15	
		US TREASURY N/B 3.13% 21/05/15	7,500,000	7,647,656.25	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/05/31	8,100,000	8,149,992.22	
		US TREASURY N/B 2.63% 21/06/15	8,650,000	8,775,357.44	
		US TREASURY N/B 1.13% 21/06/30	11,000,000	10,945,429.66	
		US TREASURY N/B 1.13% 21/07/31	11,000,000	10,941,992.16	
		US TREASURY N/B 2.13% 21/08/15	8,000,000	8,074,687.52	
		US TREASURY N/B 2.75% 21/09/15	5,400,000	5,505,679.67	
US TREASURY N/B 2.13% 21/09/30	7,200,000	7,273,687.53			
US TREASURY N/B 1.25% 21/10/31	7,700,000	7,672,628.88			
US TREASURY N/B 2.0% 21/11/15	8,000,000	8,074,687.52			

US TREASURY N/B 2.63% 21/12/15	5,500,000	5,614,511.70	
US TREASURY N/B 2.0% 21/12/31	5,000,000	5,050,000.00	
US TREASURY N/B 1.5% 22/01/31	5,600,000	5,605,906.26	
US TREASURY N/B 2.0% 22/02/15	5,700,000	5,763,234.37	
US TREASURY N/B 1.75% 22/02/28	5,650,000	5,685,312.50	
US TREASURY N/B 2.38% 22/03/15	8,000,000	8,154,687.52	
US TREASURY N/B 1.75% 22/03/31	5,500,000	5,536,523.40	
US TREASURY N/B 1.88% 22/04/30	5,500,000	5,552,636.70	
US TREASURY N/B 1.75% 22/05/15	5,600,000	5,641,343.73	
US TREASURY N/B 1.75% 22/05/31	7,500,000	7,555,078.12	
US TREASURY N/B 2.13% 22/06/30	4,300,000	4,371,050.79	
US TREASURY N/B 1.75% 22/07/15	4,500,000	4,535,507.79	
US TREASURY N/B 1.88% 22/07/31	4,500,000	4,549,570.29	
US TREASURY N/B 1.63% 22/08/15	5,000,000	5,027,539.05	
US TREASURY N/B 1.63% 22/08/31	6,900,000	6,935,847.63	
US TREASURY N/B 1.75% 22/09/30	8,000,000	8,070,624.96	
US TREASURY N/B 1.88% 22/10/31	3,500,000	3,542,792.96	
US TREASURY N/B 1.63% 22/11/15	8,000,000	8,046,249.99	
US TREASURY N/B 2.13% 22/12/31	6,000,000	6,120,937.50	
US TREASURY N/B 1.75% 23/01/31	2,900,000	2,929,000.00	
US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	5,000,000	5,087,500.00	
US TREASURY N/B 2.63% 23/02/28	5,500,000	5,697,871.08	
US TREASURY N/B 1.5% 23/03/31	4,000,000	4,012,656.24	
US TREASURY N/B 1.75% 23/05/15	5,800,000	5,863,437.50	
US TREASURY N/B 1.38% 23/06/30	2,500,000	2,498,046.87	
US TREASURY N/B 2.75% 23/07/31	4,000,000	4,180,937.52	
US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	5,500,000	5,706,250.00	
US TREASURY N/B 2.75% 23/08/31	4,500,000	4,708,125.00	
US TREASURY N/B 1.38% 23/09/30	6,000,000	5,995,078.14	
US TREASURY N/B 2.88% 23/09/30	3,500,000	3,680,742.17	
US TREASURY N/B 1.63% 23/10/31	5,500,000	5,545,546.87	
US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	6,600,000	6,922,781.25	
US TREASURY N/B 2.25% 23/12/31	5,000,000	5,159,375.00	
US TREASURY N/B 2.25% 24/01/31	5,000,000	5,162,304.70	
US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	5,000,000	5,260,156.25	
US TREASURY N/B 2.13% 24/02/29	4,000,000	4,111,562.48	
US TREASURY N/B 2.13% 24/03/31	8,500,000	8,741,718.75	
US TREASURY N/B 2.0% 24/04/30	5,500,000	5,632,343.75	
US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	8,500,000	8,879,179.72	
US TREASURY N/B 2.0% 24/05/31	11,000,000	11,266,835.91	
US TREASURY N/B 2.0% 24/06/30	6,000,000	6,150,000.00	
US TREASURY N/B 2.13% 24/07/31	5,000,000	5,153,125.00	
US TREASURY N/B 2.38% 24/08/15	6,500,000	6,771,425.76	
US TREASURY N/B 1.88% 24/08/31	4,500,000	4,590,000.00	
US TREASURY N/B 2.13% 24/09/30	5,800,000	5,983,515.58	
US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	9,200,000	9,551,109.35	
US TREASURY N/B 2.25% 24/12/31	4,600,000	4,779,507.82	
US TREASURY N/B 2.5% 25/01/31	4,500,000	4,732,382.79	

US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	6,000,000	6,167,343.72	
US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	4,200,000	4,470,703.10	
US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	4,000,000	4,236,406.24	
US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	6,000,000	6,209,531.28	
US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	3,600,000	3,870,421.88	
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	6,500,000	6,690,937.50	
US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	3,500,000	3,792,304.67	
US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	5,900,000	6,157,433.57	
US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	3,800,000	4,098,359.35	
US TREASURY N/B 2.63% 25/12/31	4,500,000	4,794,960.96	
US TREASURY N/B 2.63% 26/01/31	4,000,000	4,264,843.76	
US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	7,200,000	7,266,375.00	
US TREASURY N/B 2.5% 26/02/28	5,200,000	5,510,375.00	
US TREASURY N/B 2.25% 26/03/31	6,700,000	7,006,472.66	
US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	7,200,000	7,264,406.23	
US TREASURY N/B 1.88% 26/07/31	7,500,000	7,681,933.56	
US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	6,000,000	6,005,859.36	
US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	6,000,000	6,300,000.00	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	5,000,000	5,300,390.60	
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	5,500,000	5,789,394.54	
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	4,500,000	4,741,347.64	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	5,800,000	6,335,367.20	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	5,800,000	6,401,523.45	
US TREASURY N/B 5.5% 28/08/15	1,100,000	1,447,703.12	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	5,800,000	6,414,437.50	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	7,000,000	7,899,335.92	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	6,200,000	6,755,335.92	
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	5,600,000	5,990,031.26	
US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	6,500,000	6,532,500.00	
US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	5,600,000	5,688,156.25	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	1,000,000	1,419,843.75	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	1,300,000	1,647,292.97	
US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	900,000	1,251,562.50	
US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	1,150,000	1,627,474.60	
US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	1,900,000	2,698,445.32	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	1,900,000	2,537,316.41	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,500,000	2,102,695.32	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,700,000	2,537,382.80	
US TREASURY N/B 4.38% 41/05/15	1,500,000	2,141,718.75	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	1,600,000	2,109,250.00	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	1,200,000	1,449,656.25	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	1,300,000	1,572,136.72	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	1,200,000	1,423,218.74	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	2,000,000	2,278,671.88	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	2,300,000	2,619,484.37	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	2,500,000	3,021,679.70	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	3,400,000	3,953,828.10	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	3,000,000	3,918,164.07	

US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	3,300,000	4,319,261.72	
US TREASURY N/B 3.38% 44/05/15	3,800,000	4,794,531.25	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	3,700,000	4,492,320.29	
US TREASURY N/B 3.0% 44/11/15	3,500,000	4,166,640.62	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	3,400,000	3,713,570.30	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	3,300,000	3,934,992.20	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	3,600,000	4,207,359.38	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	3,400,000	4,065,523.44	
US TREASURY N/B 2.5% 46/02/15	3,500,000	3,831,132.83	
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	3,000,000	3,134,531.25	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	3,200,000	3,763,249.98	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	3,400,000	4,096,734.39	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	3,100,000	3,736,105.46	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	3,200,000	3,690,375.00	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	3,000,000	3,461,601.57	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	3,950,000	4,775,333.97	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	3,800,000	4,703,242.17	
US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	4,000,000	4,849,375.00	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	4,500,000	5,838,925.77	
US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	4,500,000	5,471,718.75	
US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	4,350,000	5,174,630.84	
US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	3,600,000	3,785,062.50	
US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	3,700,000	3,997,300.76	
US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	1,000,000	1,398,007.81	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	500,000	740,664.06	
US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000	2,523,203.12	
US TREASURY N/B 6.5% 26/11/15	1,000,000	1,323,515.62	
US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	1,200,000	1,656,703.12	
US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000	401,871.09	
US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	3,000,000	3,492,421.86	
US TREASURY N/B 8.0% 21/11/15	7,200,000	7,999,593.76	
アメリカ・ドル 小計	730,950,000	777,537,116.47 (86,524,330,320)	
カナダ・ドル			
CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/06/01	5,700,000	5,820,555.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	1,850,000	2,548,985.50	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 21/05/01	2,100,000	2,104,326.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 22/06/01	5,900,000	6,067,265.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	4,100,000	4,108,856.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 24/03/01	1,100,000	1,136,454.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	2,600,000	2,719,626.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	1,750,000	1,829,047.50	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	1,000,000	1,008,040.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	1,030,000	1,080,727.50	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	600,000	594,060.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	1,380,000	1,977,374.40	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	1,270,000	1,651,000.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	850,000	968,685.50	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	400,000	571,984.00	

	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	1,040,000	1,584,960.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 41/06/01	1,180,000	1,723,177.60	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	1,050,000	1,618,018.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 8.0% 27/06/01	1,000,000	1,454,460.00	
カナダ・ドル 小計		35,900,000	40,567,602.50 (3,416,603,482)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 21/12/21	2,600,000	2,659,039.13	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 22/07/15	2,450,000	2,741,820.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	2,000,000	2,298,629.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,400,000	2,596,815.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	2,100,000	2,360,790.64	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	2,600,000	3,131,284.54	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	2,400,000	3,040,971.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	2,500,000	2,838,519.77	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	2,300,000	2,533,628.27	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 28/11/21	1,580,000	1,812,630.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	5,400,000	6,457,535.13	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	4,400,000	5,024,688.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,250,000	1,766,472.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	850,000	1,028,355.95	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	1,100,000	1,437,816.31	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	1,050,000	1,364,800.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	750,000	1,027,846.62	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 21/05/15	1,500,000	1,591,050.19		
オーストラリア・ドル 小計		39,230,000	45,712,695.77 (3,397,367,549)	
イギリス・ポンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	1,550,000	2,800,850.00	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	1,650,000	2,799,093.00	
	UK GILT BOND 8.0% 21/06/07	1,750,000	1,918,434.00	
	UK GILT BOND 3.75% 21/09/07	1,470,000	1,543,030.70	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	1,100,000	1,651,566.40	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	1,100,000	1,735,399.60	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	1,350,000	2,693,709.00	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,700,000	2,083,707.00	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	3,000,000	3,188,526.00	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	1,200,000	1,303,987.20	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,650,000	1,759,480.80	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	1,430,000	2,288,835.12	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	1,850,000	2,821,192.31	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	1,450,000	2,527,474.70	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	1,700,000	2,547,358.20	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	1,350,000	1,930,918.50	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	1,500,000	2,204,850.00	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	1,200,000	1,230,710.40	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	1,150,000	1,214,183.80	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	1,750,000	1,911,350.00	
UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	720,000	921,965.30		
UK GILT BOND 1.0% 24/04/22	2,430,000	2,483,362.80		

	UK GILT BOND 1.75% 22/09/07	2,150,000	2,220,166.94	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	2,200,000	2,559,497.60	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	1,700,000	2,098,956.00	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	1,210,000	1,888,495.40	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	1,200,000	1,323,235.20	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	1,700,000	3,358,945.00	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	1,800,000	2,618,136.00	
	UK GILT BOND 4.0% 22/03/07	1,850,000	1,982,489.60	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	1,600,000	2,773,764.41	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,500,000	2,120,685.00	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,300,000	1,673,599.20	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	1,600,000	3,150,086.40	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	1,500,000	2,476,236.00	
	UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	2,200,000	2,471,260.00	
イギリス・ポンド 小計		57,560,000	78,275,537.58 (11,257,587,814)	
シンガ ポール・ ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	1,200,000	1,252,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	800,000	892,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	460,000	549,539.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	250,000	273,195.96	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	500,000	575,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	540,000	623,359.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.13% 22/09/01	3,200,000	3,329,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	1,200,000	1,352,400.00	
シンガポール・ドル 小計		8,150,000	8,847,944.76 (706,154,471)	
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	3,900,000	4,060,708.82	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.42% 22/08/15	6,000,000	6,108,279.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	4,000,000	4,092,944.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	5,000,000	5,298,111.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,000,000	2,128,385.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	2,800,000	3,161,898.57	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.13% 32/04/15	1,750,000	1,933,606.62	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,400,000	1,709,777.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,600,000	1,889,127.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	1,600,000	1,963,951.00	
マレーシア・リングgit 小計		30,050,000	32,346,791.41 (863,335,862)	
スウェー デン・ク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	5,500,000	5,969,150.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 22/06/01	11,500,000	12,527,985.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	9,400,000	10,054,700.88	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000	4,518,482.97	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	1,800,000	1,941,318.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	5,100,000	8,081,076.77	
スウェーデン・クローナ 小計		37,500,000	43,092,713.62 (490,826,008)	

ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	3,500,000	3,532,340.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/05/25	5,500,000	5,662,776.22	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	4,500,000	4,796,775.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 25/03/13	3,500,000	3,571,045.13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	4,200,000	4,310,040.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	3,600,000	3,711,582.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	8,500,000	8,682,707.50	
ノルウェー・クローネ 小計		33,300,000	34,267,265.85 (411,549,862)	
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 3.0% 21/11/15	6,700,000	7,131,218.70	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15	7,000,000	7,569,254.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	5,600,000	6,363,248.64	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	8,000,000	8,634,240.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15	1,000,000	1,089,230.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	11,800,000	22,786,272.00	
デンマーク・クローネ 小計		40,100,000	53,573,463.34 (862,532,759)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	12,500,000	13,661,625.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 21/06/10	51,000,000	50,928,600.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 23/12/07	38,000,000	39,947,500.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	35,000,000	40,100,200.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	42,000,000	44,432,220.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	20,000,000	22,729,200.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23	8,000,000	8,858,080.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	8,500,000	11,353,025.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	9,000,000	10,683,630.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	17,500,000	19,462,625.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	11,000,000	12,672,184.36	
	メキシコ・ペソ 小計		252,500,000	274,828,889.36 (1,648,973,336)
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 21/10/25	10,000,000	10,711,572.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25	5,300,000	5,738,310.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	3,300,000	3,529,294.62	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	3,300,000	3,400,172.28	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	6,500,000	8,558,722.08	
ポーランド・ズロチ 小計		31,700,000	35,585,555.37 (1,002,800,950)	
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,000,000	15,043,500.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,000,000	26,015,300.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	21,000,000	17,970,749.99	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	31,000,000	22,238,125.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,600,000	10,561,874.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,900,000	12,476,300.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000	27,980,800.00	
南アフリカ・ランド 小計		151,500,000	132,286,649.89 (982,889,808)	

ユーロ	ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	2,300,000	2,852,676.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 21/09/28	1,700,000	1,832,957.17	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 22/09/28	1,450,000	1,635,235.18	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	1,690,000	1,851,580.90	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	2,250,000	2,559,237.75	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	1,400,000	1,495,156.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,300,000	1,696,474.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 26/06/22	900,000	980,322.30	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	1,200,000	1,299,840.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	1,250,000	1,362,521.25	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	1,150,000	1,268,904.53	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	1,150,000	1,289,473.15	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	600,000	894,864.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	700,000	812,868.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	500,000	708,765.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	400,000	480,440.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	650,000	836,039.10	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	1,460,000	2,604,318.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	770,000	1,371,528.62	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	950,000	1,206,015.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	500,000	650,335.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	410,000	618,280.41	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	450,000	693,315.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 22/03/28	450,000	494,070.75	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,500,000	2,214,655.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	1,800,000	3,111,732.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 21/04/30	4,400,000	4,712,567.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.85% 22/01/31	3,200,000	3,594,307.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.4% 22/04/30	2,150,000	2,190,366.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.45% 22/10/31	1,700,000	1,740,055.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	2,300,000	2,693,760.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,100,000	2,466,828.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	2,200,000	2,642,791.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.8% 24/04/30	2,000,000	2,341,544.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	2,200,000	2,508,490.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	2,000,000	2,183,999.86	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	2,200,000	2,774,303.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	2,700,000	2,940,688.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,400,000	1,548,604.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	1,900,000	2,102,344.30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	1,900,000	2,100,913.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	1,900,000	2,103,091.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	2,100,000	2,341,193.92	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	500,000	518,245.50	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	2,350,000	2,754,580.05	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,600,000	1,988,582.76	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	1,100,000	1,299,333.74	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,700,000	2,978,214.70	

SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	1,150,000	2,208,256.45	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	1,100,000	1,533,469.33	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	2,300,000	3,164,551.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 21/09/01	4,400,000	4,734,641.46	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	3,200,000	4,751,072.48	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	1,500,000	2,160,258.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	2,200,000	2,327,720.84	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	1,900,000	2,073,153.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	1,500,000	1,588,557.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	2,200,000	2,377,709.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	1,150,000	2,006,311.85	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	2,350,000	3,879,932.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/04	4,500,000	4,740,922.52	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 21/09/04	3,400,000	3,552,000.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 22/01/04	2,900,000	3,046,513.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.75% 22/07/04	4,400,000	4,653,223.24	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 22/09/04	2,400,000	2,533,646.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	1,600,000	1,705,005.36	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	2,150,000	2,302,973.89	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/08/15	2,300,000	2,517,015.71	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	2,900,000	3,169,552.81	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	3,400,000	3,656,526.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,100,000	2,242,807.43	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	2,000,000	2,131,907.49	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	4,000,000	4,270,432.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	600,000	626,283.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	2,200,000	3,546,813.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	1,500,000	2,000,107.03	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	380,000	369,008.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	1,700,000	2,258,161.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/08/01	3,600,000	3,807,948.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	2,000,000	3,134,718.74	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	3,700,000	5,196,588.95	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	1,800,000	2,777,221.78	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	3,000,000	4,572,817.68	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/11/01	2,600,000	3,731,008.58	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/03/01	2,700,000	2,813,054.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.15% 21/12/15	3,200,000	3,336,428.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 22/03/01	3,000,000	3,315,210.15	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 22/08/01	2,200,000	2,253,618.90	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/09/01	3,700,000	4,221,451.06	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/11/01	3,500,000	4,023,460.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.95% 23/03/15	1,500,000	1,543,417.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	3,600,000	4,181,479.66	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.65% 23/10/15	2,620,000	2,675,992.02	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	2,300,000	2,700,402.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.85% 24/05/15	4,300,000	4,601,455.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 24/09/01	3,100,000	3,589,068.89	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	3,600,000	4,441,672.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	2,400,000	2,544,089.18	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 25/12/01	2,600,000	2,835,081.36	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	1,900,000	2,032,663.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	1,900,000	1,989,247.84	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,200,000	1,333,392.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	1,600,000	1,762,377.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	400,000	440,418.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	2,550,000	3,390,327.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	2,400,000	2,808,088.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	2,200,000	2,742,000.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	2,000,000	2,125,233.17	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	1,400,000	1,611,962.82	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	1,300,000	1,458,371.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	1,000,000	1,221,579.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	2,430,000	3,827,199.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	1,450,000	2,294,423.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	1,450,000	1,879,010.68	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	1,400,000	1,655,640.23	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	1,400,000	1,880,785.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	1,100,000	1,577,218.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	400,000	446,642.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	900,000	1,077,020.02	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,400,000	2,031,948.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	2,000,000	2,992,286.36	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	2,000,000	3,438,953.18	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	1,150,000	2,139,765.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,750,000	3,046,828.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,400,000	2,805,027.48	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,400,000	2,321,547.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	2,500,000	3,177,319.37	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	950,000	1,594,077.04	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,000,000	1,531,150.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,000,000	2,078,746.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.5% 21/04/15	720,000	754,478.64	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	1,100,000	1,174,141.10	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.0% 24/04/15	900,000	997,830.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	600,000	635,451.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	400,000	426,255.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	550,000	693,532.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	50,000	53,477.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	220,000	235,688.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	500,000	550,539.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	300,000	347,559.90	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	420,000	645,265.81	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	290,000	373,919.90	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	780,000	972,281.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	2,950,000	5,465,636.10	

FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	1,110,000	2,403,374.22	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 22/04/25	5,700,000	6,154,162.66	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 22/10/25	4,550,000	4,903,183.13	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 23/03/25	2,500,000	2,546,941.94	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	3,000,000	3,232,650.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	5,000,000	5,608,100.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	4,100,000	4,320,071.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	3,500,000	4,363,807.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/05/25	3,000,000	3,174,998.11	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	3,600,000	3,959,856.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	3,200,000	3,974,400.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	3,000,000	3,263,550.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	2,800,000	3,053,024.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	3,900,000	4,165,718.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	3,550,000	4,529,430.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	2,050,000	2,393,206.90	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	2,650,000	3,104,194.78	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	1,700,000	2,167,041.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	2,250,000	3,104,212.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 21/10/25	5,900,000	6,285,742.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 21/04/25	5,300,000	5,573,119.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	2,600,000	4,430,322.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	3,200,000	4,914,263.09	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	2,700,000	4,697,829.90	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	2,700,000	3,707,313.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	3,650,000	3,960,447.49	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	3,500,000	4,133,246.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	2,100,000	3,493,375.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	2,200,000	3,711,968.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,552,729.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	2,700,000	5,551,365.53	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	4,500,000	5,312,137.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 24/11/25	3,900,000	4,330,150.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	2,600,000	2,713,490.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	1,100,000	1,538,350.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.8% 22/03/15	370,000	380,156.22	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	1,000,000	1,296,041.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	550,000	678,931.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	680,000	772,946.48	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	1,100,000	1,191,221.90	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	850,000	948,215.37	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	450,000	520,536.15	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	330,000	406,056.25	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	740,000	998,382.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	1,080,000	1,356,448.13	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	700,000	765,353.05	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	850,000	984,983.82	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	2,350,000	2,654,024.20	

SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	1,500,000	2,144,670.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	1,350,000	2,452,522.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	1,200,000	2,030,660.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.25% 22/07/15	1,800,000	1,926,295.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	2,000,000	2,164,619.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,900,000	2,119,950.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	1,350,000	1,409,189.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	1,400,000	1,491,169.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	1,100,000	1,199,059.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	1,000,000	1,098,456.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	1,120,000	1,182,433.28	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	1,150,000	1,555,066.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	490,000	535,272.57	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	1,250,000	2,138,278.28	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/15	750,000	790,933.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 23/01/15	1,350,000	1,524,388.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	1,150,000	1,698,494.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.5% 23/01/15	800,000	991,767.20	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	230,000	331,758.67	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	430,000	815,930.16	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.65% 22/04/20	1,400,000	1,530,603.20	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.4% 22/11/22	1,560,000	1,734,715.32	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	1,500,000	1,630,297.50	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	1,170,000	1,291,407.39	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	950,000	1,041,650.30	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	900,000	1,194,200.10	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	1,100,000	1,186,309.30	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	750,000	815,677.87	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	900,000	962,616.60	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	550,000	737,867.90	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	550,000	926,451.90	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	570,000	741,094.05	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	380,000	859,101.72	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.5% 21/09/15	200,000	213,007.80	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	1,080,000	1,825,622.28	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	1,350,000	2,023,852.83	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,800,000	2,825,526.09	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,420,000	2,513,331.84	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	2,000,000	2,765,700.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	1,900,000	2,721,672.10	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	970,000	1,666,983.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	2,910,000	4,421,416.17	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	2,100,000	3,476,076.69	
ユーロ 小計	435,980,000	539,795,612.30 (64,932,014,203)	
国債証券 小計		176,496,966,424 (176,496,966,424)	

合計		176,496,966,424	
		(176,496,966,424)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 153銘柄	100.0%	49.0%
カナダ・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	1.9%
オーストラリア・ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	1.9%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	100.0%	6.4%
シンガポール・ドル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカ・ランド	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 235銘柄	100.0%	36.8%

(注) 組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2020年3月31日現在)

資産総額	4,518,370,777円
負債総額	4,141,103円
純資産総額(-)	4,514,229,674円
発行済口数	3,661,886,735口
1口当たり純資産額(/)	1.2328円

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2020年3月31日現在)

資産総額	94,559,548,619円
負債総額	615,436,928円
純資産総額(-)	93,944,111,691円
発行済口数	39,238,929,218口
1口当たり純資産額(/)	2.3942円

<参考情報>

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）

(2020年3月31日現在)

資産総額	155,382,277,077円
負債総額	654,406,550円
純資産総額(-)	154,727,870,527円
発行済口数	119,740,449,154口
1口当たり純資産額(/)	1.2922円

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(2020年3月31日現在)

資産総額	127,572,723,634円
負債総額	2,227,380,858円
純資産総額(-)	125,345,342,776円
発行済口数	53,128,535,493口
1口当たり純資産額(/)	2.3593円

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

(2020年3月31日現在)

資産総額	144,540,903,892円
負債総額	1,982,260,362円
純資産総額(-)	142,558,643,530円
発行済口数	58,527,079,674口
1口当たり純資産額(/)	2.4358円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

受益者が委託会社に対して行う下記の手続きは、販売会社を通じて、委託会社に請求することにより行うことができます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(1) 受益証券の名義書換等

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等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。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。したがって該当事項はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等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、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

< 受益権の譲渡 >

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

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の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。）に社振法の規定にしたがい、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われるよう通知するものとします。

上記の振替について、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等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえ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。

(5) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

< 受益権の再分割 >

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

< 償還金 >

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に支払います。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて>

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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等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（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査を行います。各部には、部長をおき、部長は、代表取締役社長または取締役の命を受け、所属員を指揮監督し、部の業務を統括します。

投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

投資政策委員会で、投資対象地域経済、産業、政治について更に精緻に分析を行い、投資対象企業、債券を様々な面より分析しつつ、基本的な運用方針を決定します。

2) 運用実施計画の作成

ファンド・マネージャーは決定された運用基本方針に基づいて、具体的な銘柄選択と運用実施計画を作成します。

3) 運用の実行

ファンド・マネージャーは運用計画に基づいて、組入有価証券の売買等を指図します。

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）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2020年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計133本であり、その純資産総額は2,148,307百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）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）ならびに同規則第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）により作成しております。
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」といいます。）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「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）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表ならびに第23期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、E Y 新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2018年3月31日現在)			当事業年度 (2019年3月31日現在)		
	金 額	構成比	%	金 額	構成比	%
(資産の部)						
流動資産						
預金		2,376,164			2,933,318	
有価証券		22,684			44,368	
前払金		46,929			42,741	
前払費用		8,682			15,949	
未収入金		210,888			500,748	
未収還付法人税等		1,020			2,367	
未収委託者報酬		642,874			617,227	
未収収益		221,238			122,922	
流動資産計		3,530,482	53.2		4,279,642	60.3
固定資産						
有形固定資産		106,070			84,968	
建物附属設備	1	79,548			66,820	
器具備品	1	26,521			18,147	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		3,002,584			2,732,068	
長期差入保証金		66,014			63,377	
繰延税金資産		2,931,719			2,662,416	
その他投資		4,850			6,275	
固定資産計		3,108,655	46.8		2,817,037	39.7
資産合計		6,639,137	100.0		7,096,680	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2018年3月31日現在)			当事業年度 (2019年3月31日現在)		
	金 額	構成比	%	金 額	構成比	%
(負債の部)						
流動負債						
預り金		123,003			134,522	
未払金		295,067			286,607	
未払手数料	131,425			123,825		
その他未払金	163,642			162,781		
未払費用		2,095			1,928	
未払法人税等		6,486			1,181	
未払消費税等		33,130			27,995	
賞与引当金		85,243			57,088	
流動負債計		545,027	8.2		509,323	7.2
固定負債						
退職給付引当金		65,230			67,644	
固定負債計		65,230	1.0		67,644	1.0
負債合計		610,257	9.2		576,968	8.1

(純資産の部)			%			%
株主資本		6,028,879	90.8		6,519,711	91.9
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	5,609,759			6,100,591		
純資産合計		6,028,879	90.8		6,519,711	91.9
負債・純資産合計		6,639,137	100.0		7,096,680	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別	前事業年度		当事業年度	
	自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
科 目	金 額	構成比	金 額	構成比
		%		%
営業収益				
委託者報酬	2,350,838		2,337,607	
投資顧問収入	1,772,901		2,367,856	
その他営業収益	20,464		17,873	
営業収益計	4,144,205	100.0	4,723,337	100.0
営業費用				
支払手数料	523,308		502,719	
広告宣伝費	43,448		39,808	
公告費	1,140		1,140	
調査費	417,484		585,088	
調査費	257,351		353,007	
委託調査費	158,734		230,952	
図書費	1,398		1,129	
委託計算費	151,080		153,098	
営業雑経費	31,907		44,871	
通信費	4,058		4,783	
印刷費	9,892		9,076	
協会費	9,442		8,632	
諸会費	2,072		6,374	
その他	6,441		16,005	
営業費用計	1,168,368	28.2	1,326,726	28.1
一般管理費				
給料	1,277,564		1,315,296	
役員報酬	249,245		211,622	
給料・手当	804,242		876,471	
賞与	162,677		192,102	
賞与引当金繰入額	61,399		35,098	
交際費	3,788		3,029	
旅費交通費	26,904		21,095	
租税公課	11,290		6,373	
不動産賃借料	95,293		104,671	
退職給付費用	41,704		79,897	

固定資産減価償却費		22,523			21,600	
福利厚生費		113,473			116,798	
事務手数料		254,170			773,947	
諸経費		145,755			190,123	
一般管理費計		1,992,467	48.1		2,632,834	55.7
営業利益		983,368	23.7		763,777	16.2
営業外収益						
有価証券運用益		3,607			1,711	
雑収入		9,153			50	
営業外収益計		12,761	0.3		1,762	0.0
営業外費用						
支払利息		169			-	
為替差損		601			46	
雑損失		241			277	
営業外費用計		1,012	0.0		324	0.0
経常利益		995,117	24.0		765,215	16.2
特別利益						
事業再構築費用戻入		-			5,262	
特別利益計		-	0.0		5,262	0.1
特別損失						
事業再構築費用		28,134			6,296	
事務処理損失		0			714	
ゴルフ会員権売却損		-			2,800	
特別損失計		28,134	0.7		9,811	0.2
税引前当期純利益		966,983	23.3		760,665	16.1
法人税,住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		340,417	8.2		269,303	5.7
当期純利益		626,035	15.1		490,831	10.4

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	4,983,724	5,092,844	5,402,844	
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	626,035	626,035	626,035	
当期変動額合計	-	-	-	626,035	626,035	626,035	
当期末残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	

当期変動額							
当期純利益	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期変動額合計	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等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、必要額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 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ます。

[表示方法の変更]

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果関係注記を変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」669,807千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」2,931,719千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第5項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解（注8）（評価性引当額の合計額を除く。）及び同注解（注9）に記載された内容を追加してあります。

す。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取り扱いに従い、その記載をしておりません。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 42,115千円 器具備品 29,212千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 54,843千円 器具備品 38,003千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（損益計算書関係）

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額20,209千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額254,170千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額17,341千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額773,947千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

該当ありません。

3. 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当事業年度の末日後となるもの

該当ありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末

普通株式	6,200株	-	-	6,200株
------	--------	---	---	--------

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

該当ありません。

3. 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当事業年度の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日
2019年6月26日 定時株主総会(予定)	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日

（金融商品関係）

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、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

2018年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	2,376,164	2,376,164	
(2) 未収入金	210,888	210,888	
(3) 未収委託者報酬	642,874	642,874	
(4) 預り金	123,003	123,003	
(5) 未払手数料	131,425	131,425	
(6) その他未払金	163,642	163,642	

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

（1）預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（2）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

（注3）社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

2019年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	2,933,318	2,933,318	
(2) 未収入金	500,748	500,748	
(3) 未収委託者報酬	617,227	617,227	
(4) 預り金	134,522	134,522	
(5) 未払手数料	123,825	123,825	
(6) その他未払金	162,781	162,781	

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) 未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

(注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 22,684千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,913千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 44,368千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,704千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
2011年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。	同左

2. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
退職給付債務の期首残高	469,114
勤務費用	45,881
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	9,915
退職給付の支払額	51,823
退職給付債務の期末残高	473,087

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
退職給付債務の期首残高	473,087
勤務費用	51,555
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	52,891
退職給付の支払額	75,129
退職給付債務の期末残高	502,405

3．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
年金資産の期首残高	367,412
期待運用収益	2,717
数理計算上の差異の発生額	8,568
事業主からの拠出額	53,470
退職給付の支払額	51,823
年金資産の期末残高	380,344

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
年金資産の期首残高	380,344
期待運用収益	2,814
数理計算上の差異の発生額	32,480
事業主からの拠出額	56,396
退職給付の支払額	75,129
年金資産の期末残高	396,905

4．退職給付債務及び年金資産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

(単位：千円)

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
積立型制度の退職給付債務	473,087
年金資産	380,344
	92,742
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	92,742
未認識数理計算上の差異	1,347
未認識過去勤務費用	26,164
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	65,230

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
積立型制度の退職給付債務	502,405
年金資産	396,905
	105,499
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	105,499
未認識数理計算上の差異	20,411
未認識過去勤務費用	17,443
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	67,644

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
退職給付費用	25,902
(1)勤務費用	45,881
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,717
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	25,983

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
退職給付費用	58,810
(1)勤務費用	51,555

(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,814
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	1,347

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2018年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.0%

その他 2.0%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

当事業年度（2019年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.1%

その他 1.9%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2018年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2019年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

8．確定拠出制度

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,262千円であります。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,720千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
<p>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</p> <p style="text-align: right;">（単位：千円）</p> <p>繰延税金資産</p> <p>連結納税適用に伴う影響額 1,837,768</p> <p>賞与引当金繰入超過額 21,749</p> <p>退職給付引当金 21,040</p> <p>繰越欠損金 1,001,357</p> <p>その他 49,802</p> <p>繰延税金資産 合計 2,931,719</p> <p>繰延税金負債との相殺 -</p> <p>繰延税金資産の純額 2,931,719</p>	<p>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</p> <p style="text-align: right;">（単位：千円）</p> <p>繰延税金資産</p> <p>連結納税適用に伴う影響額 1,225,179</p> <p>賞与引当金繰入超過額 14,373</p> <p>退職給付引当金 21,778</p> <p>(注) 繰越欠損金 1,372,856</p> <p>その他 28,228</p> <p>繰延税金資産 合計 2,662,416</p> <p>繰延税金負債との相殺 -</p> <p>繰延税金資産の純額 2,662,416</p>

（注）税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

当事業年度（2019年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(*2) 税務上の繰越欠損金1,372,856千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,372,856千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

<p>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の差異の原因となった主要な項目別内訳</p> <p>法定実効税率 30.8%</p> <p>交際費等永久に損金に 算入されない項目 4.5%</p> <p>その他 0.1%</p> <p>税効果会計適用後の 法人税等の負担率 35.2%</p> <p style="text-align: center;">=====</p>	<p>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の差異の原因となった主要な項目別内訳</p> <p>法定実効税率 30.6%</p> <p>交際費等永久に損金に 算入されない項目 5.3%</p> <p>その他 0.5%</p> <p>税効果会計適用後の 法人税等の負担率 35.4%</p> <p style="text-align: center;">=====</p>
--	--

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

（セグメント情報）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

(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)

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)

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)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

前事業年度											
自 2017年4月 1日											
至 2018年3月31日											
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 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 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取 事務手数料の支払	155,038 100,307 98,690 20,209 254,170	前払金 未収入金 未払金	4,422 38,775 14,495
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 人件費等の支払	35,330 141,349	前払金	42,506
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグレーション	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	16,773	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	255 14,663	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 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 (千円)	科目	期末 残高 (千円)			
						役員の 兼任等	事業上の関係							
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・オブ・ニューヨーク・シティ	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	229,260	前払金	8,051		
								ソフトウェアの使用契約	投資顧問料の支払	164,709				
								人件費等及び事務手数料の支払	人件費等の支払	135,677			未払金	30,899
								事務手数料の支払	事務手数料の受取	17,341				
事務手数料の支払	事務手数料の支払	773,947												
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	35,235	前払金	34,689		
								兼職社員の人件費支払等	人件費等の支払	159,558				
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグレーション	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	16,146	-	-		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	531 19,937	-	-		

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
1株当たり純資産	972,399円98銭	1株当たり純資産	1,051,566円42銭
1株当たり当期純利益	100,973円44銭	1株当たり当期純利益	79,166円44銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
当期純利益（千円）	626,035	490,831
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	626,035	490,831
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

（重要な後発事象）

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

科 目	第23期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）	
	金 額	構成比
（資産の部）		%
流動資産		

預金			2,511,636	
有価証券			22,042	
前払金			51,061	
前払費用			8,756	
未収入金			669,231	
未収委託者報酬			640,786	
未収収益			334,586	
		流動資産計	4,238,102	61.4
固定資産				
有形固定資産			74,183	
建物附属設備	1	60,457		
器具備品	1	13,726		
無形固定資産			0	
ソフトウェア		0		
投資その他の資産			2,586,171	
長期差入保証金		70,868		
繰延税金資産		2,509,027		
その他投資		6,275		
		固定資産計	2,660,354	38.6
		資産合計	6,898,456	100.0
		(負債の部)		%
流動負債				
預り金			21,231	
未払金			222,874	
未払手数料		128,750		
その他未払金		94,124		
未払費用			7,535	
未払法人税等			2,605	
未払消費税等	2		40,995	
賞与引当金			204,502	
		流動負債計	499,744	7.2
固定負債				
退職給付引当金			82,532	
		固定負債計	82,532	1.2
		負債合計	582,276	8.4
		(純資産の部)		%
株主資本			6,316,179	91.6
資本金		310,000		
利益剰余金		6,006,179		
利益準備金		77,500		
その他利益剰余金				
別途積立金		31,620		
繰越利益剰余金		5,897,059		
		純資産合計	6,316,179	91.6
		負債・純資産合計	6,898,456	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第23期中間会計期間	
		自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日	
		金額	構成比
営業収益			%

委託者報酬			1,189,462	
投資顧問収入			1,385,359	
その他営業収益	1		22,437	
	営業収益計		2,597,260	100.0
営業費用・一般管理費				
営業費用			730,763	
支払手数料		253,189		
その他営業費用		477,573		
一般管理費	2		1,425,365	
	営業費用・一般管理費計		2,156,129	83.0
営業利益			441,131	17.0
営業外収益			3,496	0.1
営業外費用			3,733	0.1
経常利益			440,894	17.0
特別損失			772	0.0
税引前中間純利益			440,121	16.9
法人税,住民税及び事業税			265	0.0
法人税等調整額			153,388	5.9
中間純利益			286,467	11.0

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
			その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711
当中間期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	490,000	490,000	490,000	490,000
中間純利益	-	-	-	286,467	286,467	286,467	286,467
当中間期変動額合計	-	-	-	203,532	203,532	203,532	203,532
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	5,897,059	6,006,179	6,316,179	6,316,179

[重要な会計方針]

	第23期中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4.引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5.その他中間 財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の処理方法 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ます。</p>

注 記 事 項

（中間貸借対照表関係）

第23期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)					
1. 有形固定資産の減価償却累計額	<table border="0"> <tr> <td>建物附属設備</td> <td>61,206千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>42,424千円</td> </tr> </table>	建物附属設備	61,206千円	器具備品	42,424千円
建物附属設備	61,206千円				
器具備品	42,424千円				
2. 消費税等の取扱い	<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>				

（中間損益計算書関係）

第23期中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日			
1. 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間に、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額22,145千円は、損益計算書のその他営業収益に含まれております。			
2. 減価償却実施額	<table border="0"> <tr> <td>有形固定資産</td> <td>10,929千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	10,929千円
有形固定資産	10,929千円		

（中間株主資本等変動計算書関係）

第23期中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日					
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項					
株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)	
普通株式	6,200			6,200	
2. 当中間会計期間中に行った剰余金の配当に関する事項					
決議	株式の種類	配当金の 総額	1株あたりの 配当額	基準日	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

(金融商品関係)

第23期中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日			
1. 金融商品の時価等に関する事項			
2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。			
(単位：千円)			
	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	2,511,636	2,511,636	
(2)未収入金	669,231	669,231	
(3)未収委託者報酬	640,786	640,786	
(4)未収収益	334,586	334,586	
(5)未払手数料	128,750	128,750	
(6)その他未払金	94,124	94,124	
(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項			
(1)預金 預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。			
(2)未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)未収収益、(5)未払手数料及び(6)その他未払金 これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。			

(有価証券関係)

第23期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	22,042千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	3,336千円

（資産除去債務関係）

第23期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
資産除去債務の総額の期中における増減はありません。

（デリバティブ取引関係）

第23期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第23期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
<p>（セグメント情報） 当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。</p> <p>（セグメント関連情報）</p> <p>1. 商品およびサービスごとの情報 単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。</p> <p>2. 地域ごとの情報</p> <p>(1) 営業収益 本邦に所在している顧客への収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除いております。</p> <p>(2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しています。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。 また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。</p> <p>（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） 該当事項はありません。</p> <p>（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） 該当事項はありません。</p> <p>（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報） 該当事項はありません。</p>

（1株当たり情報）

第23期中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
--

1株当たり純資産額 1,018,738円66銭

1株当たり中間純利益 46,204円50銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第23期中間会計期間	
自 2019年4月 1日	
至 2019年9月30日	
中間純利益(千円)	286,467
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益(千円)	286,467
期中平均株式数(株)	6,200

(重要な後発事象)

第23期中間会計期間

自 2019年4月 1日

至 2019年9月30日

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。)。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。)。

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

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

その他、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実は存在しておりません。

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

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2019年3月末現在）

事業の内容

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

（参考）再信託受託会社

名 称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

但し、関係当局の認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末現在）

事業の内容：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（兼営法）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	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (2019年3月末現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (2019年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円 (2019年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	9,257百万円 (2019年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社は主として、信託財産の保管・管理・計算、受益権の設定に係る振替機関への通知、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

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) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (2) 目論見書の表紙および裏表紙に、委託会社の名称および本店の所在地、当ファンドの基本的形態等を記載すること、委託会社および当ファンドのロゴマークを表示し、図案を採用することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に、以下のような別称を使用することがあります。
交付目論見書 「投資信託説明書（交付目論見書）」
請求目論見書 「投資信託説明書（請求目論見書）」
- (4) 目論見書の表紙裏に、以下の事項を記載することがあります。
「当ファンドは、有価証券などの値動きのある証券に投資します（また、外国証券にはこの他に為替変動もあります。）ので、基準価額は変動します。従って、元本が保証されているものではありません。」
- (5) 請求目論見書に当ファンドの信託約款の全文を記載します。
- (6) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載することがあります。
- (7) 目論見書に投資信託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を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年6月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 雅人
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」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第22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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2019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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

2020年4月8日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

PwC 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 大畑 茂

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AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2019年2月21日から2020年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の2020年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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

() 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月20日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 伊藤 雅人 印

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」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第23期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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