

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2019年5月20日

【計算期間】 第7期 自 2018年2月21日 至 2019年2月20日

【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）

【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

【連絡場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【電話番号】 03 - 4530 - 7409

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【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
	年2回	日本			
	年4回	北米			
債券 一般 国債 社債	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(<http://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キングしている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手しますが、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いません。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。）

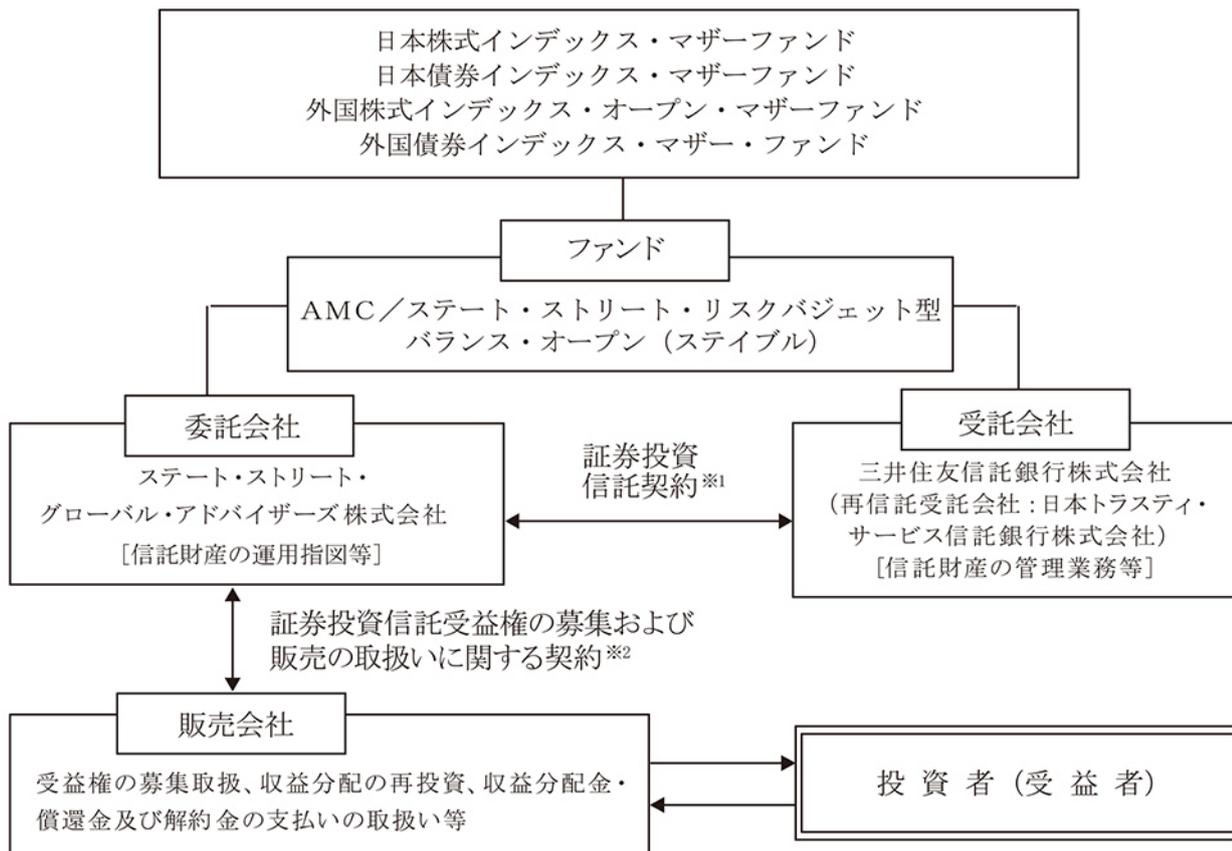
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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
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）<sup>1</sup>]

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）<sup>2</sup>]

<sup>1</sup> 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。

<sup>2</sup> 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。

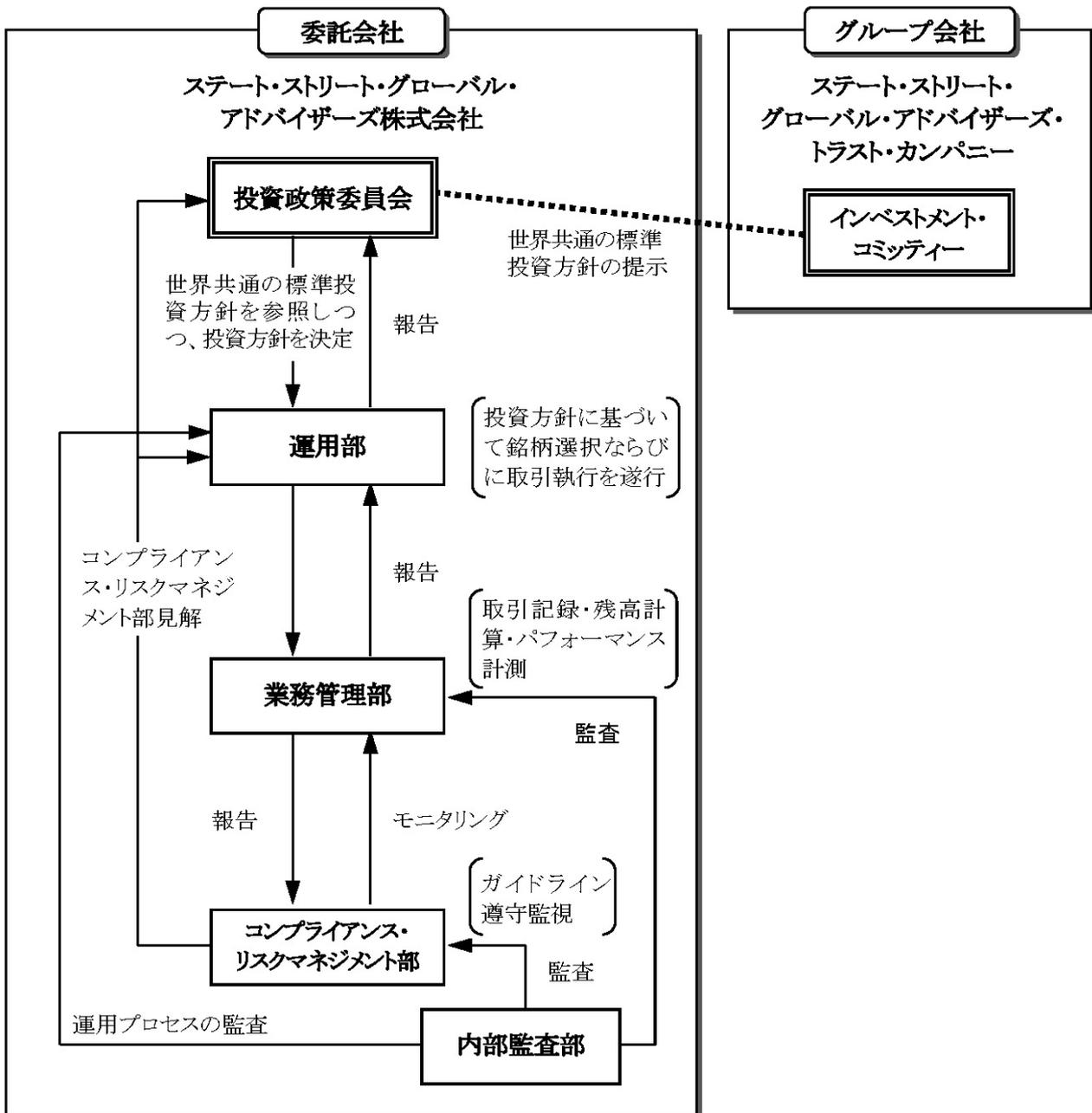
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者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。

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が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。
- (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。

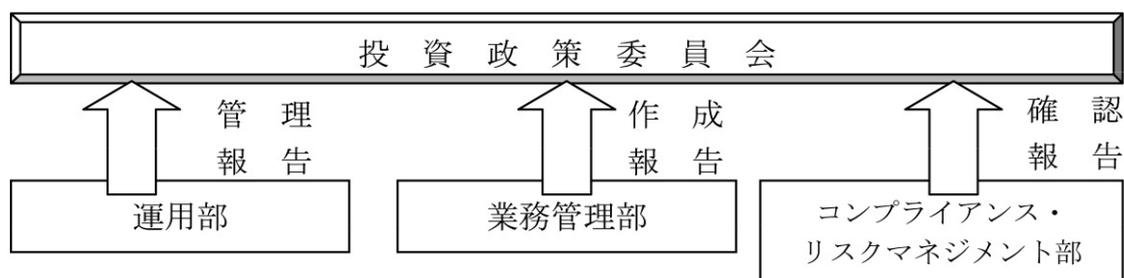
#### ファミリーファンド方式のリスク

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。

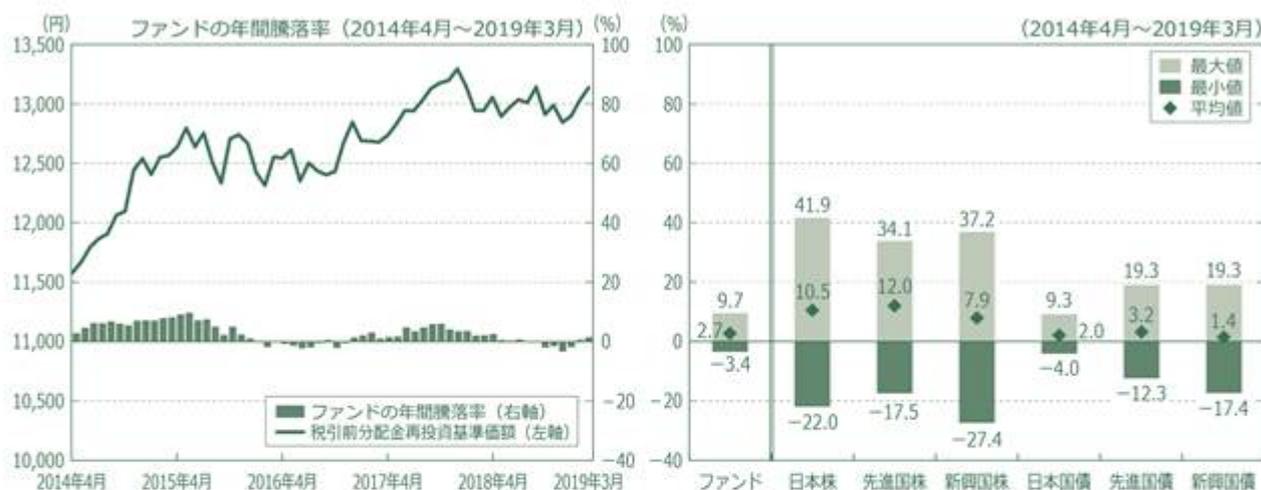
投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

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、野村証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、野村証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2.16%\*（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。

\*消費税率が10%に引き上げられる場合は、2.2%になります。

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0.81%\*（税抜0.75%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

\*消費税率が10%に引き上げられる場合は、年率0.825%になります。

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。

上記は、2019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場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家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】

(2019年3月29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	3,657,212,706	85.45
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		622,642,740	14.55
純資産総額		4,279,855,446	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。

## &lt;参考情報&gt;

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)

(2019年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	84,030,278,280	96.87
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,714,098,872	3.13
純資産総額		86,744,377,152	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。

## &lt;参考情報&gt;

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)

(2019年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	125,255,031,400	81.23
特殊債券	日本	13,540,643,800	8.78
地方債証券	日本	9,705,820,393	6.30
社債券	日本	5,260,129,400	3.41
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		433,784,856	0.28
純資産総額		154,195,409,849	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。

## &lt;参考情報&gt;

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)

(2019年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	95,712,338,439	63.42
	イギリス	9,153,489,795	6.06
	フランス	5,891,318,314	3.90
	カナダ	5,447,904,842	3.61
	スイス	4,831,625,998	3.20
	ドイツ	4,660,986,758	3.09
	オーストラリア	3,510,387,781	2.33
	香港	2,122,765,412	1.41
	オランダ	1,918,266,750	1.27
	スペイン	1,627,809,399	1.08
	スウェーデン	1,449,655,031	0.96
	イタリア	1,283,521,373	0.85
	デンマーク	973,878,770	0.65
	シンガポール	660,544,440	0.44

	フィンランド	569,896,565	0.38
	ベルギー	542,951,934	0.36
	ノルウェー	392,663,689	0.26
	イスラエル	289,911,784	0.19
	アイルランド	283,345,182	0.19
	ニュージーランド	129,967,392	0.09
	オーストリア	128,693,044	0.08
	ポルトガル	84,023,759	0.06
	小計	141,665,946,451	93.88
投資証券	アメリカ	3,142,482,507	2.08
	オーストラリア	276,245,180	0.18
	フランス	173,817,090	0.12
	イギリス	111,676,033	0.07
	香港	96,806,867	0.06
	シンガポール	69,439,883	0.05
	カナダ	28,474,238	0.02
	小計	3,898,941,798	2.58
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		5,346,605,840	3.54
純資産総額		150,911,494,089	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）

（2019年3月29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	67,485,440,767	46.00
	フランス	14,503,594,775	9.89
	イタリア	12,748,390,207	8.69
	イギリス	10,059,357,327	6.86
	ドイツ	9,702,232,688	6.61
	スペイン	8,238,167,932	5.62
	ベルギー	3,587,194,353	2.44
	オーストラリア	3,088,684,521	2.10
	カナダ	2,921,507,603	1.99
	オランダ	2,878,379,453	1.96
	オーストリア	2,152,775,993	1.47
	メキシコ	1,155,290,412	0.79
	アイルランド	1,137,207,614	0.78
	フィンランド	917,044,186	0.63
	ポーランド	892,087,973	0.61
	南アフリカ	780,671,070	0.53
	デンマーク	767,396,283	0.52
	マレーシア	678,620,771	0.46
	シンガポール	582,180,102	0.40
	スウェーデン	527,908,229	0.36
ノルウェー	335,622,135	0.23	
	小計	145,139,754,394	98.94
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,556,791,305	1.06
純資産総額		146,696,545,699	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】

（2019年3月29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		819,834,527	2.2809	1,869,960,572	2.3130	1,896,277,260	44.30
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		1,020,195,393	1.2869	1,312,889,451	1.2940	1,320,132,838	30.85
3	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		84,890,489	2.6063	221,250,081	2.6483	224,815,482	5.25
4	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		81,664,824	2.6514	216,526,114	2.6448	215,987,126	5.05
									投資比率：合計	85.45

（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		85.45
合計		85.45

（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）

（2019年3月29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	410,400	6,608.00	2,711,923,200	6,487.00	2,662,264,800	3.07
2	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通信業	151,000	10,485.00	1,583,235,000	10,745.00	1,622,495,000	1.87
3	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	321,600	4,683.00	1,506,052,800	4,521.00	1,453,953,600	1.68
4	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	2,500,400	584.00	1,460,233,600	550.00	1,375,220,000	1.59
5	日本	株式	キーエンス	電気機器	18,100	67,730.00	1,225,913,000	68,970.00	1,248,357,000	1.44
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	247,200	4,798.00	1,186,065,600	4,703.00	1,162,581,600	1.34
7	日本	株式	ソニー	電気機器	247,100	5,326.00	1,316,054,600	4,645.00	1,147,779,500	1.32
8	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	256,000	3,978.00	1,018,368,000	3,876.00	992,256,000	1.14

9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	310,700	3,092.00	960,684,400	2,995.00	930,546,500	1.07
10	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	33,000	24,790.00	818,070,000	25,710.00	848,430,000	0.98
11	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,935,500	175.90	868,154,450	171.30	845,451,150	0.97
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	252,100	3,181.00	801,930,100	3,161.00	796,888,100	0.92
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	254,500	3,148.00	801,166,000	3,074.00	782,333,000	0.90
14	日本	株式	花王	化学	89,400	8,628.00	771,343,200	8,718.00	779,389,200	0.90
15	日本	株式	KDDI	情報・通信業	318,400	2,659.50	846,784,800	2,385.00	759,384,000	0.88
16	日本	株式	任天堂	その他製品	22,700	30,350.00	688,945,000	31,560.00	716,412,000	0.83
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	131,700	5,378.00	708,282,600	5,362.00	706,175,400	0.81
18	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	65,500	10,650.00	697,575,000	10,680.00	699,540,000	0.81
19	日本	株式	ファナック	電気機器	35,000	19,200.00	672,000,000	18,880.00	660,800,000	0.76
20	日本	株式	ダイキン工業	機械	50,300	12,575.00	632,522,500	12,970.00	652,391,000	0.75
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	115,900	6,103.33	707,375,947	5,512.00	638,840,800	0.74
22	日本	株式	キヤノン	電気機器	198,200	3,183.00	630,870,600	3,213.00	636,816,600	0.73
23	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	152,000	4,716.00	716,832,000	4,176.00	634,752,000	0.73
24	日本	株式	日本電産	電気機器	44,300	13,690.00	606,467,000	14,025.00	621,307,500	0.72
25	日本	株式	日立製作所	電気機器	165,800	3,320.00	550,456,000	3,585.00	594,393,000	0.69
26	日本	株式	信越化学工業	化学	63,600	9,420.00	599,112,000	9,280.00	590,208,000	0.68
27	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	213,400	2,803.00	598,160,200	2,745.00	585,783,000	0.68
28	日本	株式	資生堂	化学	73,200	7,725.00	565,470,000	7,987.00	584,648,400	0.67
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	339,500	1,768.50	600,405,750	1,658.50	563,060,750	0.65
30	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	228,800	2,567.50	587,444,000	2,451.50	560,903,200	0.65
									投資比率：合計	30.97

(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	12.60
	情報・通信業	8.01
	輸送用機器	7.54
	化学	7.15
	銀行業	5.90
	医薬品	5.72
	サービス業	4.85
	卸売業	4.81
	陸運業	4.80
	機械	4.77
	小売業	4.61
	食料品	4.22
	建設業	2.91
	不動産業	2.44
	保険業	2.12
	精密機器	2.00
	その他製品	1.99
	電気・ガス業	1.88
	その他金融業	1.10
	鉄鋼	0.94
ガラス・土石製品	0.87	
証券、商品先物取引業	0.76	
非鉄金属	0.75	

ゴム製品	0.75
繊維製品	0.62
石油・石炭製品	0.59
空運業	0.59
金属製品	0.55
パルプ・紙	0.29
鉱業	0.28
倉庫・運輸関連業	0.20
海運業	0.14
水産・農林業	0.12
小計	96.87
合計	96.87

(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) (2019年6月限)	大阪取引所	買建	169	2,697,644,800	2,690,480,000	3.10

(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）

（2019年3月29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392回利付国 債(2年)	0.100	2020/09/01	3,300,000,000	100.37	3,312,309,000	100.39	3,313,134,000	2.15
2	日本	国債 証券	第131回利付国 債(5年)	0.100	2022/03/20	2,100,000,000	100.76	2,116,023,000	100.88	2,118,480,000	1.37
3	日本	国債 証券	第135回利付国 債(5年)	0.100	2023/03/20	1,900,000,000	101.03	1,919,684,000	101.24	1,923,560,000	1.25
4	日本	国債 証券	第353回利付国 債(10年)	0.100	2028/12/20	1,800,000,000	101.00	1,818,089,000	101.91	1,834,434,000	1.19
5	日本	国債 証券	第129回利付国 債(5年)	0.100	2021/09/20	1,750,000,000	100.62	1,760,937,500	100.72	1,762,600,000	1.14
6	日本	国債 証券	第9回利付国債 (40年)	0.400	2056/03/20	1,840,000,000	90.23	1,660,260,000	94.66	1,741,817,600	1.13
7	日本	国債 証券	第136回利付国 債(5年)	0.100	2023/06/20	1,700,000,000	101.10	1,718,717,000	101.31	1,722,423,000	1.12
8	日本	国債 証券	第137回利付国 債(5年)	0.100	2023/09/20	1,550,000,000	101.14	1,567,716,500	101.37	1,571,328,000	1.02
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	100.97	1,514,580,000	101.16	1,517,430,000	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	100.90	1,513,620,000	101.06	1,515,990,000	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	100.82	1,512,390,000	100.97	1,514,580,000	0.98
12	日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	0.100	2028/03/20	1,410,000,000	101.36	1,429,190,100	102.22	1,441,372,500	0.93
13	日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	0.400	2025/09/20	1,380,000,000	103.56	1,429,197,000	104.00	1,435,213,800	0.93
14	日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	103.02	1,339,267,000	103.47	1,345,188,000	0.87
15	日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	0.400	2025/06/20	1,200,000,000	103.45	1,241,508,000	103.84	1,246,116,000	0.81
16	日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	0.100	2026/09/20	1,200,000,000	101.71	1,220,556,000	102.31	1,227,768,000	0.80
17	日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	0.100	2026/06/20	1,200,000,000	101.73	1,220,760,000	102.27	1,227,264,000	0.80
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	100.68	1,208,232,000	100.79	1,209,516,000	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	101.09	1,172,676,000	102.00	1,183,304,400	0.77
20	日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	0.100	2027/09/20	1,100,000,000	101.54	1,117,028,000	102.36	1,126,004,000	0.73
21	日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	0.100	2026/03/20	1,100,000,000	101.70	1,118,766,000	102.19	1,124,101,000	0.73
22	日本	国債証券	第147回利付国債（20年）	1.600	2033/12/20	860,000,000	119.76	1,030,013,400	121.49	1,044,865,600	0.68
23	日本	国債証券	第336回利付国債（10年）	0.500	2024/12/20	1,000,000,000	103.76	1,037,670,000	104.08	1,040,800,000	0.67
24	日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	0.100	2026/12/20	1,000,000,000	101.69	1,016,900,000	102.35	1,023,520,000	0.66
25	日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	0.100	2021/06/20	1,000,000,000	100.56	1,005,630,000	100.64	1,006,460,000	0.65
26	日本	国債証券	第153回利付国債（20年）	1.300	2035/06/20	850,000,000	115.80	984,308,500	117.65	1,000,025,000	0.65
27	日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	0.100	2027/12/20	960,000,000	101.45	973,996,800	102.29	982,070,400	0.64
28	日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	0.600	2024/03/20	900,000,000	103.78	934,029,000	104.01	936,117,000	0.61
29	日本	国債証券	第314回利付国債（10年）	1.100	2021/03/20	900,000,000	102.54	922,905,000	102.53	922,824,000	0.60
30	日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	0.100	2027/03/20	900,000,000	101.66	914,949,000	102.38	921,483,000	0.60
										投資比率：合計	27.22

（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		81.23
特殊債券		8.78
地方債証券		6.30
社債券		3.41
合計		99.72

（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）

（2019年3月29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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	171,167	19,928.25	3,411,059,538	20,946.03	3,585,269,596	2.38
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	263,032	12,229.98	3,216,878,229	12,978.06	3,413,645,262	2.26
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	14,988	185,749.53	2,784,014,020	196,831.88	2,950,116,304	1.95
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	86,652	15,392.09	1,333,755,659	18,374.39	1,592,178,032	1.06
5	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	96,725	16,187.89	1,565,773,805	15,414.29	1,490,947,316	0.99
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,381	120,790.41	1,374,715,735	129,690.70	1,476,009,914	0.98
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	10,812	121,487.43	1,313,522,138	130,110.24	1,406,751,993	0.93
8	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	152,651	8,774.86	1,339,492,588	8,961.33	1,367,956,382	0.91
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	119,890	12,215.55	1,464,523,416	11,177.80	1,340,106,789	0.89
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	110,341	9,500.65	1,048,311,442	10,615.75	1,171,352,691	0.78
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	63,395	15,438.70	978,736,957	17,166.82	1,088,290,763	0.72
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	46,634	24,162.52	1,126,795,097	22,271.25	1,038,597,631	0.69
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	89,839	10,302.09	925,529,625	11,493.01	1,032,520,929	0.68
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	336,087	3,112.15	1,045,956,383	3,033.35	1,019,471,753	0.68
15	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	208,288	5,051.15	1,052,094,951	4,693.76	977,655,361	0.65
16	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	148,884	6,598.35	982,389,560	6,557.28	976,275,445	0.65
17	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	164,528	5,294.22	871,047,921	5,894.67	969,839,730	0.64
18	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	161,982	5,254.26	851,096,612	5,922.42	959,326,473	0.64
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	68,895	13,191.16	908,805,071	13,653.98	940,691,627	0.62
20	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	34,691	31,360.22	1,087,917,548	26,885.10	932,671,271	0.62
21	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	262,283	3,392.96	889,916,855	3,441.79	902,725,603	0.60
22	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	161,197	5,997.89	966,843,421	5,448.49	878,281,709	0.58
23	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	33,114	21,827.29	722,788,993	26,067.11	863,186,326	0.57
24	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	40,739	19,496.50	794,268,052	21,094.75	859,379,403	0.57

25	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	93,660	8,647.23	809,899,646	9,171.10	858,965,572	0.57
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	78,062	10,076.04	786,556,115	10,633.59	830,079,583	0.55
27	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	19,470	38,020.73	740,263,698	41,559.09	809,155,591	0.54
28	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア・娯楽	64,964	12,727.22	826,811,334	12,287.70	798,258,331	0.53
29	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	25,295	28,345.84	717,008,073	30,258.23	765,382,142	0.51
30	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	145,707	5,436.29	792,105,536	5,169.91	753,292,688	0.50
									投資比率：合計	25.24

(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) 2019年3月29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	8.67
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.15
	銀行	7.65
	資本財	6.79
	エネルギー	6.28
	メディア・娯楽	5.66
	食品・飲料・タバコ	4.84
	小売	4.64
	ヘルスケア機器・サービス	4.51
	素材	4.33
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.12
	各種金融	4.02
	保険	3.71
	公益事業	3.37
	半導体・半導体製造装置	2.86
	電気通信サービス	2.35
	家庭用品・パーソナル用品	2.04
	運輸	1.93
	耐久消費財・アパレル	1.84
	消費者サービス	1.80
	食品・生活必需品小売り	1.44
自動車・自動車部品	1.14	
商業・専門サービス	1.13	
不動産	0.61	
小計	93.88	
投資証券		2.58
合計		96.46

(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) 2019年3月29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	232	32,088,080.00	32,723,600.00	3,631,992,364	2.41
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	159	5,117,910.00	5,153,190.00	641,881,346	0.43
	FTSE100INDEX	インターコンチネンタル取引所	買建	イギリス・ポンド	37	2,606,620.00	2,650,125.00	384,215,122	0.25
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	14	2,671,488.00	2,693,320.00	222,575,964	0.15
	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	20	1,826,840.00	1,845,600.00	205,802,856	0.14
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	15	2,309,250.00	2,313,000.00	181,894,320	0.12

(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（2019年3月29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。

## &lt;参考情報&gt;

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）

（2019年3月29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	2020/11/30	10,200,000	10,996.66	1,121,660,056	11,045.28	1,126,618,645	0.77
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/09/30	9,500,000	11,005.76	1,045,547,998	11,046.50	1,049,417,664	0.72
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2020/06/30	9,400,000	10,965.03	1,030,713,296	10,997.55	1,033,770,183	0.70
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2020/03/31	9,200,000	10,929.51	1,005,515,680	10,961.59	1,008,466,682	0.69
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2020/12/31	9,000,000	11,069.14	996,222,932	11,115.42	1,000,388,386	0.68
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2021/03/31	9,000,000	11,040.50	993,645,744	11,102.88	999,259,618	0.68
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/02/28	8,500,000	10,986.67	933,867,640	11,043.94	938,735,661	0.64
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2021/06/30	8,500,000	10,758.70	914,489,896	10,837.95	921,225,879	0.63
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	12,700.58	914,442,170	12,721.34	915,936,539	0.62
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2023/05/15	8,200,000	10,773.79	883,451,542	10,900.43	893,835,988	0.61
11	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	2.500	2020/10/25	6,800,000	13,087.68	889,962,316	13,059.75	888,063,324	0.61

12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/08/15	8,000,000	11,001.88	880,150,700	11,072.14	885,771,233	0.60
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/05/31	8,000,000	10,978.90	878,312,705	11,043.50	883,480,400	0.60
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	8,000,000	10,960.02	876,802,236	11,043.06	883,444,883	0.60
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/11/30	8,000,000	10,908.65	872,692,172	11,023.52	881,882,144	0.60
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/09/30	8,000,000	10,822.41	865,793,033	10,933.84	874,707,750	0.60
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2020/05/31	7,800,000	10,936.39	853,039,172	10,969.80	855,644,995	0.58
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	7,500,000	11,336.62	850,247,219	11,375.14	853,135,734	0.58
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2021/05/15	7,500,000	11,249.05	843,679,386	11,300.55	847,541,838	0.58
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	7,500,000	11,113.31	833,498,828	11,154.93	836,620,422	0.57
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2021/01/31	7,500,000	10,857.92	814,344,729	10,919.52	818,964,687	0.56
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	7,000,000	11,312.32	791,862,594	11,552.50	808,675,359	0.55
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2020/08/31	7,200,000	10,906.09	785,239,155	10,948.94	788,323,789	0.54
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	7,000,000	11,224.75	785,732,616	11,236.84	786,579,470	0.54
25	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.000	2022/04/25	5,700,000	13,799.37	786,564,637	13,792.03	786,145,741	0.54
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	7,000,000	10,897.44	762,820,951	11,020.08	771,406,027	0.53
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/08/15	6,900,000	11,111.98	766,727,022	11,141.50	768,764,132	0.52
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	7,000,000	10,763.47	753,443,406	10,880.46	761,632,248	0.52
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/02/15	6,700,000	10,771.57	721,695,826	10,938.61	732,887,503	0.50
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2028/02/15	6,400,000	11,203.88	717,048,675	11,439.73	732,143,315	0.50
										投資比率：合計	17.96

(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) 2019年3月29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		98.94
合計		98.94

(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) 2019年3月29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】

2019年3月29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
2018年 3月末日			4,217,704,879		1.2347
4月末日			4,259,319,565		1.2454
5月末日			4,204,110,064		1.2301
6月末日			4,232,335,233		1.2376
7月末日			4,259,733,811		1.2435
8月末日			4,254,146,883		1.2410
9月末日			4,301,319,811		1.2537
10月末日			4,206,943,142		1.2315
11月末日			4,237,123,413		1.2390
12月末日			4,187,868,557		1.2253
2019年 1月末日			4,204,461,583		1.2303
2月末日			4,247,694,442		1.2323
3月末日			4,279,855,446		1.2420

## 【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
-----	------------------------------	---------

## 【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%

(注) 収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末の分配基準価額（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

(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

（2019年3月29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です。

## ＜基準価額・純資産総額＞

基準価額	12,420円
純資産総額	4,280百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第3期（2015年2月20日）	160円
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
設定来累計	680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	44.30%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2020/11/30	0.77%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2020/09/30	0.72%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.625%	2020/06/30	0.70%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	30.85%	第3 9 2 回利付国債(2年)	日本	国債証券	—	0.100%	2020/09/01	2.15%
		第1 3 1 回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2022/03/20	1.37%
		第1 3 5 回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2023/03/20	1.25%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	5.25%	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	—	—	2.38%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	2.26%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	1.95%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	5.05%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.07%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	—	—	1.87%
		武田薬品工業	日本	株式	医薬品	—	—	1.68%

※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。

※2019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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、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つ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、併合の事項にあつ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](http://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7期計算期間(2018年2月21日から2019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6期 (2018年 2月20日現在)	第7期 (2019年 2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	5,119,066
コール・ローン	696,794,401	643,159,407
親投資信託受益証券	3,536,912,265	3,620,626,218
流動資産合計	4,233,706,666	4,268,904,691
資産合計	4,233,706,666	4,268,904,691
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	50,639,741	37,611,022
未払解約金	998	402
未払受託者報酬	1,019,779	1,149,832
未払委託者報酬	14,276,882	16,097,634
未払利息	1,707	1,640
その他未払費用	203,948	230,595
流動負債合計	66,143,055	55,091,125
負債合計	66,143,055	55,091,125
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 3,375,982,766	1 3,419,183,841
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	791,580,845	794,629,725
(分配準備積立金)	154,447,333	151,281,087
元本等合計	4,167,563,611	4,213,813,566
純資産合計	4,167,563,611	4,213,813,566
負債純資産合計	4,233,706,666	4,268,904,691

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自 2017年 2月21日 至 2018年 2月20日	第7期 自 2018年 2月21日 至 2019年 2月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	108,244,673	65,813,953
営業収益合計	108,244,673	65,813,953
営業費用		
支払利息	535,891	527,205
受託者報酬	1,957,571	2,284,230
委託者報酬	27,405,865	31,979,077
その他費用	402,555	525,831
営業費用合計	30,301,882	35,316,343
営業利益又は営業損失（ ）	77,942,791	30,497,610
経常利益又は経常損失（ ）	77,942,791	30,497,610
当期純利益又は当期純損失（ ）	77,942,791	30,497,610
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（ ）	2,282,260	148,538
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	604,056,731	791,580,845
剰余金増加額又は欠損金減少額	183,141,399	30,346,064
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	183,141,399	30,346,064
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,638,075	20,035,234
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,638,075	20,035,234
分配金	1 50,639,741	1 37,611,022
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	791,580,845	794,629,725

## (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6期 (2018年 2月20日現在)	第7期 (2019年 2月20日現在)
1 期首元本額	2,711,249,203円	3,375,982,766円
期中追加設定元本額	757,459,918円	128,819,369円
期中一部解約元本額	92,726,355円	85,618,294円
2 受益権の総数	3,375,982,766口	3,419,183,841口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第6期 自 2017年 2月21日 至 2018年 2月20日	第7期 自 2018年 2月21日 至 2019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(45,679,767円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(20,784,697円)、収益調整金(637,133,512円)及び分配準備積立金(138,622,610円)より分配対象収益は842,220,586円(1万口当たり2,494円)であり、うち50,639,741円(1万口当たり150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(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。

## (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6期 (2018年 2月20日現在)	第7期 (2019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</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</p> <p>「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>(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</p> <p>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	(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。  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。	(3)デリバティブ取引 同左  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	第6期 (2018年 2月20日現在)	第7期 (2019年 2月20日現在)
	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	102,025,969	60,413,768
合計	102,025,969	60,413,768

## (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6期 (2018年 2月20日現在)	第7期 (2019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)	1.2345円 (12,345円)	1.2324円 (12,324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	84,890,489	221,250,081	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	819,834,527	1,869,960,572	
	日本株式インデックス・マザー・ファンド	81,664,824	216,526,114	
	日本債券インデックス・マザー・ファンド	1,020,195,393	1,312,889,451	
合計		2,006,585,233	3,620,626,218	

(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	(2018年 2月20日現在)	(2019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
コール・ローン		3,754,925,708	2,690,346,033
株式		114,041,250,670	87,254,422,410
新株予約権証券		1,644,000	
派生商品評価勘定		48,919,928	122,902,528
未収入金			36,000,000
未収配当金		143,765,874	141,135,756
前払金		23,620,000	
差入委託証拠金		137,760,000	85,095,000
流動資産合計		118,151,886,180	90,351,314,862
資産合計		118,151,886,180	90,351,314,862
負債の部			
流動負債			
前受金			108,325,000
派生商品評価勘定		43,084,808	
未払金		43,665,544	

未払解約金		62,810,000	19,940,000
未払利息		9,202	6,862
その他未払費用		267	3,070
流動負債合計		149,569,821	128,274,932
負債合計		149,569,821	128,274,932
純資産の部			
元本等			
元本	1	41,667,325,452	34,028,428,491
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		76,334,990,907	56,194,611,439
元本等合計		118,002,316,359	90,223,039,930
純資産合計		118,002,316,359	90,223,039,930
負債純資産合計		118,151,886,180	90,351,314,862

(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、当ファンドの計算期間と異なります。

## (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、新株予約権証券 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	受取配当金 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。

### (貸借対照表に関する注記)

区 分	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
1 期首元本額	49,927,537,771円	41,667,325,452円
期中追加設定元本額	28,696,508,416円	10,521,493,768円
期中一部解約元本額	36,956,720,735円	18,160,390,729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)	71,586,277円	81,664,824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 >	943,748,997円	856,940,904円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	5,431,895円	4,365,158円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	201,817,922円	141,670,799円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	170,503円	121,013円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	7,306,794円	4,426,507円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	11,923,455円	11,202,501円
バランスファンドVA50B < 適格機関投資家限定 >	7,720,780,493円	7,241,529,595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 >	723,386,182円	426,392,515円
バランスファンドVA50C < 適格機関投資家限定 >	10,336,632円	6,648,845円
バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	1,319,995,375円	1,271,582,169円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	807,503,418円	802,871,113円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	65,651,503円	56,116,211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 >	106,906,468円	950,217,271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 >	13,470,086,948円	7,344,621,937円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	79,100,789円	58,645,273円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	962,463,349円	731,722,264円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	269,436,061円	199,034,584円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	2,229,424,434円	2,093,887,155円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	138,046,572円	62,460,294円
世界4資産バランスVA45 < 適格機関投資家限定 >	788,479,897円	162,484,745円
日本株式インデックス・ファンドFOF < 適格機関投資家限定 >	4,949,370,352円	4,801,801,587円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	18,538,708円	17,668,545円
グローバル4資産45VA < 適格機関投資家限定 >	19,075,109円	19,453,793円
4資産バランス30VA2 < 適格機関投資家限定 >	9,134,449円	8,090,499円
バランスファンドVA25B < 適格機関投資家限定 >	584,689,962円	580,693,532円

バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	3,935,146円	3,343,682円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	3,166,612円	3,384,173円
バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	35,234,894円	38,762,912円
日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	1,841,198,077円	1,339,409,071円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	361,087,677円	367,591,206円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,674,059,175円	1,683,985,611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>	182,106,649円	87,285,437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>	129,930,476円	158,424,927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>	53,512,531円	77,152,734円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	1,432,767,747円	1,995,324,541円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	32,137,238円	1,039,453円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	289,729,529円	286,917,026円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	26,061,203円	23,221,746円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	7,133,885円	7,279,937円
ワールドバランスVA0809<適格機関投資家限定>	59,735,215円	円
ワールドバランスVA0902<適格機関投資家限定>	21,136,854円	18,992,402円
計	41,667,325,452円	34,028,428,491円
2 受益権の総数	41,667,325,452口	34,028,428,491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	<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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	8,243,131,108	4,320,140,469
新株予約権証券	1,644,000	-
合計	8,244,775,108	4,320,140,469

(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	(2018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)	3,255,595,000		3,261,550,000	5,955,000
	合 計	3,255,595,000		3,261,550,000	5,955,000

(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

## (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)

	(2018年 2月20日現在)	(2019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)	2.8320円 (28,320円)	2.6514円 (26,514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	119,600	1,619.00	193,632,400	
極洋	1,700	2,990.00	5,083,000	
日本水産	47,200	726.00	34,267,200	
マルハニチロ	8,000	3,700.00	29,600,000	
ハウスイ	600	903.00	541,800	
カネコ種苗	1,400	1,328.00	1,859,200	
サカタのタネ	6,300	3,725.00	23,467,500	
ホクト	4,300	1,947.00	8,372,100	
ホクリヨウ	700	627.00	438,900	
ヒノキヤグループ	1,200	2,302.00	2,762,400	
ショーボンドホールディングス	4,000	7,910.00	31,640,000	
ミライト・ホールディングス	14,500	1,692.00	24,534,000	
タマホーム	3,100	1,129.00	3,499,900	
サンヨーホームズ	600	861.00	516,600	
日本アクア	1,400	529.00	740,600	
ファーストコーポレーション	1,000	736.00	736,000	
ベステラ	600	1,356.00	813,600	
TATERU	4,200	277.00	1,163,400	
スペースバリューホールディングス	6,100	883.00	5,386,300	
住石ホールディングス	11,700	101.00	1,181,700	
日鉄鉱業	1,200	4,555.00	5,466,000	
三井松島ホールディングス	2,300	1,547.00	3,558,100	
国際石油開発帝石	204,600	1,145.00	234,267,000	
石油資源開発	6,700	2,319.00	15,537,300	
K&Oエナジーグループ	2,700	1,521.00	4,106,700	
ダイセキ環境ソリューション	1,200	638.00	765,600	
第一カッター興業	500	1,750.00	875,000	
安藤・間	34,800	767.00	26,691,600	

東急建設	16,300	975.00	15,892,500
コムシスホールディングス	18,200	2,928.00	53,289,600
ミサワホーム	3,800	737.00	2,800,600
ビーアールホールディングス	3,800	357.00	1,356,600
高松コンストラクショングループ	2,700	2,701.00	7,292,700
東建コーポレーション	1,600	6,720.00	10,752,000
ソネック	700	716.00	501,200
ヤマウラ	1,800	981.00	1,765,800
大成建設	41,900	5,030.00	210,757,000
大林組	126,100	1,062.00	133,918,200
清水建設	128,600	945.00	121,527,000
飛島建設	3,800	1,485.00	5,643,000
長谷工コーポレーション	53,000	1,347.00	71,391,000
松井建設	4,500	737.00	3,316,500
銭高組	600	5,330.00	3,198,000
鹿島建設	99,400	1,594.00	158,443,600
不動テトラ	3,200	1,584.00	5,068,800
大末建設	1,600	939.00	1,502,400
鉄建建設	2,600	2,707.00	7,038,200
西松建設	9,800	2,508.00	24,578,400
三井住友建設	30,700	700.00	21,490,000
大豊建設	3,100	3,110.00	9,641,000
前田建設工業	29,900	1,159.00	34,654,100
佐田建設	2,600	376.00	977,600
ナカノフドー建設	3,500	514.00	1,799,000
奥村組	7,000	3,405.00	23,835,000
東鉄工業	5,100	3,040.00	15,504,000
イチケン	800	1,948.00	1,558,400
富士ピー・エス	1,300	489.00	635,700
浅沼組	1,500	2,661.00	3,991,500
戸田建設	48,800	706.00	34,452,800
熊谷組	6,700	3,265.00	21,875,500
青木あすなる建設	3,000	1,031.00	3,093,000
北野建設	900	3,080.00	2,772,000
植木組	500	2,348.00	1,174,000
矢作建設工業	5,600	754.00	4,222,400
ピーエス三菱	4,900	625.00	3,062,500
日本ハウスホールディングス	7,900	437.00	3,452,300
大東建託	15,000	15,685.00	235,275,000
新日本建設	5,000	981.00	4,905,000
N I P P O	9,800	2,108.00	20,658,400
東亜道路工業	900	3,080.00	2,772,000
前田道路	13,300	2,128.00	28,302,400
日本道路	1,100	6,560.00	7,216,000
東亜建設工業	3,400	1,619.00	5,504,600
若築建設	2,500	1,497.00	3,742,500
東洋建設	13,200	419.00	5,530,800
五洋建設	49,900	544.00	27,145,600
世紀東急工業	5,500	633.00	3,481,500

福田組	1,400	4,335.00	6,069,000
日本ドライケミカル	800	1,210.00	968,000
住友林業	30,000	1,434.00	43,020,000
日本基礎技術	5,200	370.00	1,924,000
バコーポレーション	5,600	383.00	2,144,800
大和ハウス工業	118,300	3,389.00	400,918,700
ライト工業	8,200	1,510.00	12,382,000
積水ハウス	131,700	1,627.50	214,341,750
日特建設	3,500	611.00	2,138,500
北陸電気工事	2,300	938.00	2,157,400
ユアテック	5,800	886.00	5,138,800
四電工	600	2,690.00	1,614,000
中電工	5,500	2,335.00	12,842,500
関電工	16,900	1,041.00	17,592,900
きんでん	27,900	1,811.00	50,526,900
東京エネシス	4,700	976.00	4,587,200
トーエネック	1,300	3,240.00	4,212,000
住友電設	3,300	1,857.00	6,128,100
日本電設工業	6,500	2,314.00	15,041,000
協和エクシオ	15,900	2,918.00	46,396,200
新日本空調	3,200	1,897.00	6,070,400
日本工営	2,400	2,577.00	6,184,800
九電工	8,300	3,850.00	31,955,000
三機工業	9,000	1,187.00	10,683,000
日揮	36,200	1,701.00	61,576,200
中外炉工業	1,400	1,772.00	2,480,800
ヤマト	3,300	473.00	1,560,900
太平電業	2,900	2,546.00	7,383,400
高砂熱学工業	11,700	1,800.00	21,060,000
三晃金属工業	500	2,981.00	1,490,500
NEC ネットズエスアイ	4,100	2,541.00	10,418,100
朝日工業社	900	2,940.00	2,646,000
明星工業	7,600	734.00	5,578,400
大気社	5,400	3,195.00	17,253,000
ダイダン	2,800	2,512.00	7,033,600
日比谷総合設備	4,700	1,869.00	8,784,300
東芝プラントシステム	9,200	2,055.00	18,906,000
日本製粉	12,700	1,912.00	24,282,400
日清製粉グループ本社	44,200	2,372.00	104,842,400
日東富士製粉	300	6,410.00	1,923,000
昭和産業	3,500	3,030.00	10,605,000
鳥越製粉	3,600	785.00	2,826,000
中部飼料	4,600	1,087.00	5,000,200
フィード・ワン	24,900	181.00	4,506,900
東洋精糖	900	1,023.00	920,700
日本甜菜製糖	2,100	1,825.00	3,832,500
三井製糖	3,000	2,879.00	8,637,000
塩水港精糖	3,900	225.00	877,500
日新製糖	1,700	2,069.00	3,517,300

L I F U L L	12,500	621.00	7,762,500
ジェイエシーリクルートメント	2,900	2,461.00	7,136,900
日本M&Aセンター	26,900	2,905.00	78,144,500
メンバーズ	1,000	1,510.00	1,510,000
中広	500	581.00	290,500
タケエイ	4,100	815.00	3,341,500
E・Jホールディングス	500	1,078.00	539,000
トラスト・テック	1,700	3,620.00	6,154,000
コシダカホールディングス	8,800	1,620.00	14,256,000
アルトナー	600	936.00	561,600
パソナグループ	3,300	1,463.00	4,827,900
C D S	1,000	1,273.00	1,273,000
リンクアンドモチベーション	6,600	945.00	6,237,000
G C A	3,600	899.00	3,236,400
エス・エム・エス	14,100	1,947.00	27,452,700
サニーサイドアップ	400	1,590.00	636,000
パーソルホールディングス	36,200	1,944.00	70,372,800
リニカル	2,500	1,732.00	4,330,000
クックパッド	11,100	291.00	3,230,100
エスクリ	1,200	623.00	747,600
アイ・ケイ・ケイ	1,600	746.00	1,193,600
森永製菓	8,800	4,940.00	43,472,000
中村屋	1,000	4,255.00	4,255,000
江崎グリコ	11,400	5,660.00	64,524,000
名糖産業	1,800	1,412.00	2,541,600
井村屋グループ	1,500	2,512.00	3,768,000
不二家	2,100	2,252.00	4,729,200
山崎製パン	30,800	1,918.00	59,074,400
第一屋製パン	500	1,017.00	508,500
モロゾフ	700	5,030.00	3,521,000
亀田製菓	2,400	5,220.00	12,528,000
寿スピリッツ	3,700	4,375.00	16,187,500
カルビー	17,200	3,100.00	53,320,000
森永乳業	7,600	3,455.00	26,258,000
六甲バター	2,400	1,993.00	4,783,200
ヤクルト本社	28,100	7,420.00	208,502,000
明治ホールディングス	26,900	8,730.00	234,837,000
雪印メグミルク	9,200	2,717.00	24,996,400
プリマハム	5,300	2,161.00	11,453,300
日本ハム	16,300	4,275.00	69,682,500
林兼産業	1,200	606.00	727,200
丸大食品	4,000	1,931.00	7,724,000
S F o o d s	2,700	4,135.00	11,164,500
伊藤ハム米久ホールディングス	24,500	669.00	16,390,500
学情	1,400	1,319.00	1,846,600
スタジオアリス	1,800	2,366.00	4,258,800
クロスキャット	700	1,001.00	700,700
シミックホールディングス	1,900	1,615.00	3,068,500
システナ	11,900	1,149.00	13,673,100

N J S	800	1,510.00	1,208,000
デジタルアーツ	1,800	8,320.00	14,976,000
新日鉄住金ソリューションズ	5,600	2,992.00	16,755,200
総合警備保障	14,300	4,840.00	69,212,000
キューブシステム	1,900	883.00	1,677,700
いちご	53,600	383.00	20,528,800
エイジア	700	1,338.00	936,600
日本駐車場開発	44,800	155.00	6,944,000
コア	1,600	1,346.00	2,153,600
カカクコム	27,000	2,146.00	57,942,000
アイロムグループ	1,400	1,495.00	2,093,000
セントケア・ホールディング	1,200	568.00	681,600
サイネックス	400	689.00	275,600
ルネサンス	1,900	2,006.00	3,811,400
ディップ	5,100	2,006.00	10,230,600
S B Sホールディングス	3,700	1,947.00	7,203,900
オプトホールディング	2,200	1,702.00	3,744,400
新日本科学	4,800	745.00	3,576,000
ツクイ	8,500	741.00	6,298,500
キャリアデザインセンター	800	1,218.00	974,400
ベネフィット・ワン	5,000	4,155.00	20,775,000
エムスリー	75,500	1,743.00	131,596,500
ツカダ・グローバルホールディング	2,800	620.00	1,736,000
プラス	200	578.00	115,600
アウトソーシング	18,800	1,348.00	25,342,400
ウェルネット	3,800	1,102.00	4,187,600
ワールドホールディングス	1,000	2,156.00	2,156,000
ディー・エヌ・エー	19,300	1,686.00	32,539,800
博報堂D Yホールディングス	49,800	1,786.00	88,942,800
ぐるなび	5,700	732.00	4,172,400
エスアールジータカミヤ	4,600	688.00	3,164,800
ジャパンベストレスキューシステム	3,100	1,261.00	3,909,100
ファンコミュニケーションズ	9,900	532.00	5,266,800
ライク	1,400	998.00	1,397,200
ビジネス・ブレークスルー	1,800	365.00	657,000
W D Bホールディングス	1,600	2,797.00	4,475,200
ティア	1,500	668.00	1,002,000
C D G	400	1,255.00	502,000
バリューコマース	2,400	2,135.00	5,124,000
インフォマート	19,600	1,252.00	24,539,200
サッポロホールディングス	13,700	2,456.00	33,647,200
アサヒグループホールディングス	78,900	4,829.00	381,008,100
麒麟ホールディングス	170,500	2,586.00	440,913,000
宝ホールディングス	28,200	1,243.00	35,052,600
オエノンホールディングス	10,500	382.00	4,011,000
養命酒製造	1,200	2,108.00	2,529,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	28,800	2,986.00	85,996,800
サントリー食品インターナショナル	25,200	4,990.00	125,748,000
ダイドーグループホールディングス	1,900	5,430.00	10,317,000

伊藤園	12,500	5,150.00	64,375,000
キーコーヒー	3,700	2,046.00	7,570,200
ユニカフェ	1,000	1,014.00	1,014,000
ジャパンフーズ	800	1,255.00	1,004,000
日清オイリオグループ	4,500	3,400.00	15,300,000
不二製油グループ本社	10,300	3,925.00	40,427,500
かどや製油	400	5,040.00	2,016,000
J - オイルミルズ	2,000	4,055.00	8,110,000
ローソン	9,300	6,790.00	63,147,000
サンエー	2,800	4,445.00	12,446,000
カワチ薬品	2,900	2,079.00	6,029,100
エービーシー・マート	6,700	6,390.00	42,813,000
ハードオフコーポレーション	1,700	814.00	1,383,800
高千穂交易	1,400	1,012.00	1,416,800
アスクル	3,200	2,366.00	7,571,200
ゲオホールディングス	6,200	1,641.00	10,174,200
アダストリア	5,700	1,961.00	11,177,700
ジーフット	2,200	684.00	1,504,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	779.00	623,200
伊藤忠食品	900	4,880.00	4,392,000
くらコーポレーション	2,200	5,630.00	12,386,000
キャンドウ	1,900	1,578.00	2,998,200
エレマテック	1,700	1,863.00	3,167,100
パルグループホールディングス	1,900	3,090.00	5,871,000
JALUX	1,000	2,521.00	2,521,000
エディオン	14,500	977.00	14,166,500
あらた	1,900	4,435.00	8,426,500
サーラコーポレーション	7,000	584.00	4,088,000
ワッツ	1,300	739.00	960,700
トーメンデバイス	500	2,457.00	1,228,500
ハローズ	1,500	2,145.00	3,217,500
J Pホールディングス	12,500	284.00	3,550,000
あみやき亭	800	3,685.00	2,948,000
東京エレクトロン デバイス	1,400	1,853.00	2,594,200
ひらまつ	4,900	350.00	1,715,000
フィールズ	2,800	722.00	2,021,600
双日	218,700	425.00	92,947,500
アルフレッサ ホールディングス	41,100	3,215.00	132,136,500
大黒天物産	900	4,100.00	3,690,000
ハニーズホールディングス	3,500	955.00	3,342,500
ファーマライズホールディングス	800	566.00	452,800
キッコーマン	25,500	5,590.00	142,545,000
味の素	86,600	1,672.00	144,795,200
キューピー	21,000	2,564.00	53,844,000
ハウス食品グループ本社	14,400	4,440.00	63,936,000
カゴメ	15,100	2,963.00	44,741,300
焼津水産化学工業	1,800	1,173.00	2,111,400
アリアケジャパン	3,400	5,890.00	20,026,000
ピエトロ	500	1,641.00	820,500

エバラ食品工業	800	2,122.00	1,697,600
ニチレイ	19,700	2,765.00	54,470,500
横浜冷凍	9,700	928.00	9,001,600
東洋水産	20,700	4,190.00	86,733,000
イトアンド	1,000	1,694.00	1,694,000
大冷	400	1,739.00	695,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	624.00	312,000
日清食品ホールディングス	16,100	7,740.00	124,614,000
永谷園ホールディングス	2,000	2,400.00	4,800,000
一正蒲鉾	1,700	1,098.00	1,866,600
フジッコ	4,100	2,308.00	9,462,800
ロック・フィールド	4,100	1,616.00	6,625,600
日本たばこ産業	219,300	2,827.00	619,961,100
ケンコーマヨネーズ	2,500	2,217.00	5,542,500
わらべや日洋ホールディングス	2,400	1,988.00	4,771,200
なとり	2,300	1,691.00	3,889,300
イフジ産業	700	692.00	484,400
ピクルスコーポレーション	500	1,893.00	946,500
北の達人コーポレーション	11,400	442.00	5,038,800
ユーグレナ	15,100	655.00	9,890,500
片倉工業	4,500	1,233.00	5,548,500
ゲンゼ	3,000	5,080.00	15,240,000
ヒューリック	77,200	1,025.00	79,130,000
神栄	400	798.00	319,200
ラサ商事	1,800	867.00	1,560,600
アルペン	2,800	1,646.00	4,608,800
ハブ	800	957.00	765,600
ラクーンホールディングス	2,400	678.00	1,627,200
クオールホールディングス	4,100	1,476.00	6,051,600
アルコニックス	3,900	1,271.00	4,956,900
神戸物産	5,400	3,660.00	19,764,000
ソリトンシステムズ	1,200	1,053.00	1,263,600
ジンス	2,500	5,410.00	13,525,000
ビックカメラ	20,000	1,245.00	24,900,000
D C Mホールディングス	20,100	1,116.00	22,431,600
ベッパーフードサービス	2,400	2,726.00	6,542,400
Monotaro	23,300	2,486.00	57,923,800
東京一番フーズ	700	612.00	428,400
DDホールディングス	800	2,149.00	1,719,200
あいホールディングス	6,000	1,957.00	11,742,000
ディーブイエックス	1,200	1,166.00	1,399,200
きちりホールディングス	1,200	726.00	871,200
アークランドサービスホールディングス	2,700	2,041.00	5,510,700
J.フロントリテイリング	47,700	1,233.00	58,814,100
ドトール・日レスホールディングス	6,500	2,191.00	14,241,500
マツモトキヨシホールディングス	15,300	3,870.00	59,211,000
broncoビリー	1,900	2,700.00	5,130,000
ZOZO	40,300	1,731.00	69,759,300
トレジャー・ファクトリー	1,200	750.00	900,000

物語コーポレーション	1,000	9,520.00	9,520,000
ココカラファイン	3,900	4,980.00	19,422,000
三越伊勢丹ホールディングス	69,100	1,101.00	76,079,100
東洋紡	14,700	1,629.00	23,946,300
ユニチカ	11,500	497.00	5,715,500
富士紡ホールディングス	2,200	2,867.00	6,307,400
日清紡ホールディングス	24,700	960.00	23,712,000
倉敷紡績	4,000	2,250.00	9,000,000
ダイワボウホールディングス	3,200	6,410.00	20,512,000
シキボウ	2,000	1,033.00	2,066,000
日東紡績	5,600	1,962.00	10,987,200
トヨタ紡織	13,200	1,842.00	24,314,400
マクニカ・富士エレホールディングス	10,300	1,599.00	16,469,700
H a m e e	900	821.00	738,900
ラクト・ジャパン	700	8,490.00	5,943,000
ウエルシアホールディングス	9,800	4,055.00	39,739,000
クリエイトSDホールディングス	5,500	2,894.00	15,917,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,000	1,092.00	7,644,000
八洲電機	2,800	830.00	2,324,000
メディアスホールディングス	1,500	745.00	1,117,500
U K Cホールディングス	2,300	2,054.00	4,724,200
ジューテックホールディングス	800	1,035.00	828,000
丸善C H Iホールディングス	4,600	336.00	1,545,600
大光	800	613.00	490,400
O C H Iホールディングス	1,000	1,241.00	1,241,000
T O K A Iホールディングス	19,800	925.00	18,315,000
黒谷	700	467.00	326,900
ミサワ	500	431.00	215,500
ティーライフ	500	1,025.00	512,500
C o m i n i x	800	844.00	675,200
エー・ピーカンパニー	800	498.00	398,400
三洋貿易	1,800	2,089.00	3,760,200
チムニー	1,200	2,656.00	3,187,200
シュッピン	2,400	771.00	1,850,400
ビューティガレージ	400	1,499.00	599,600
ウイン・パートナーズ	2,900	1,149.00	3,332,100
ネクステージ	4,200	1,011.00	4,246,200
ジョイフル本田	10,900	1,451.00	15,815,900
鳥貴族	1,300	1,817.00	2,362,100
キリン堂ホールディングス	1,500	1,556.00	2,334,000
ホットランド	1,900	1,364.00	2,591,600
すかいらくホールディングス	34,400	1,706.00	58,686,400
綿半ホールディングス	1,500	2,315.00	3,472,500
日本毛織	12,500	875.00	10,937,500
ダイトウボウ	5,000	82.00	410,000
トーア紡コーポレーション	1,400	460.00	644,000
ダイドーリミテッド	4,000	347.00	1,388,000
ヨシックス	600	3,135.00	1,881,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	12,400	1,174.00	14,557,600

三栄建築設計	1,500	1,648.00	2,472,000
スター・マイカ	1,400	1,381.00	1,933,400
野村不動産ホールディングス	24,600	2,076.00	51,069,600
三重交通グループホールディングス	8,200	611.00	5,010,200
サムティ	5,100	1,532.00	7,813,200
ディア・ライフ	4,200	438.00	1,839,600
コーセーアールイー	700	761.00	532,700
エー・ディー・ワークス	46,700	34.00	1,587,800
日本商業開発	2,300	1,544.00	3,551,200
プレサンスコーポレーション	5,100	1,381.00	7,043,100
ユニゾホールディングス	6,200	2,131.00	13,212,200
THEグローバル社	1,700	497.00	844,900
日本管理センター	2,700	776.00	2,095,200
サンセイランディック	900	754.00	678,600
エストラスト	600	791.00	474,600
フージャースホールディングス	8,900	683.00	6,078,700
オープンハウス	6,100	3,905.00	23,820,500
東急不動産ホールディングス	98,400	621.00	61,106,400
飯田グループホールディングス	30,900	2,019.00	62,387,100
イーグランド	500	679.00	339,500
ムゲンエステート	2,900	617.00	1,789,300
帝国繊維	4,200	2,474.00	10,390,800
日本コークス工業	34,800	101.00	3,514,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,500	615.00	922,500
ミタチ産業	800	736.00	588,800
B E E N O S	600	1,172.00	703,200
あさひ	3,000	1,509.00	4,527,000
日本調剤	1,300	3,935.00	5,115,500
コスモス薬品	1,900	21,090.00	40,071,000
シップヘルスケアホールディングス	7,700	4,315.00	33,225,500
トーエル	1,900	708.00	1,345,200
ソフトクリエイトホールディングス	1,900	1,548.00	2,941,200
オンリー	500	990.00	495,000
セブン&アイ・ホールディングス	156,200	4,976.00	777,251,200
薬王堂	1,600	2,621.00	4,193,600
クリエイト・レストランツ・ホールディング	10,000	1,287.00	12,870,000
明治電機工業	1,200	1,822.00	2,186,400
ツルハホールディングス	8,000	9,860.00	78,880,000
デリカフーズホールディングス	700	1,345.00	941,500
スターティアホールディングス	1,000	578.00	578,000
サンマルクホールディングス	2,700	2,569.00	6,936,300
フェリシモ	1,200	1,135.00	1,362,000
トリドールホールディングス	4,600	2,258.00	10,386,800
帝人	32,300	1,869.00	60,368,700
東レ	285,300	786.10	224,274,330
クラレ	62,000	1,536.00	95,232,000
旭化成	263,600	1,213.50	319,878,600
サカイオーベックス	1,000	1,827.00	1,827,000
T O K Y O B A S E	2,400	901.00	2,162,400

稲葉製作所	2,300	1,286.00	2,957,800
宮地エンジニアリンググループ	1,000	2,103.00	2,103,000
トーカロ	10,400	943.00	9,807,200
アルファCo	1,200	1,379.00	1,654,800
SUMCO	41,000	1,560.00	63,960,000
川田テクノロジーズ	800	6,840.00	5,472,000
RS Technologies	700	3,195.00	2,236,500
ビーロット	600	1,477.00	886,200
ファーストブラザーズ	1,000	1,125.00	1,125,000
ハウスドゥ	1,200	1,563.00	1,875,600
シーアールイー	1,200	928.00	1,113,600
プロパティエージェント	300	1,127.00	338,100
ケイアイスター不動産	1,500	1,753.00	2,629,500
アグレ都市デザイン	400	632.00	252,800
グッドコムアセット	400	1,462.00	584,800
ジェイ・エス・ビー	100	4,195.00	419,500
テンポイノベーション	300	1,800.00	540,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	738.00	221,400
住江織物	1,000	2,648.00	2,648,000
日本フェルト	2,000	458.00	916,000
イチカワ	600	1,402.00	841,200
エコナックホールディングス	9,000	123.00	1,107,000
日東製網	400	1,317.00	526,800
芦森工業	800	1,713.00	1,370,400
アツギ	2,900	960.00	2,784,000
ウイルプラスホールディングス	400	750.00	300,000
ジャパンミート	1,400	1,771.00	2,479,400
コメダホールディングス	7,000	2,137.00	14,959,000
サツドラホールディングス	500	1,898.00	949,000
デファクトスタンダード	200	391.00	78,200
ダイユー・リックホールディングス	1,900	1,013.00	1,924,700
パロックジャパンリミテッド	3,200	915.00	2,928,000
クスリのアオキホールディングス	2,900	7,700.00	22,330,000
ダイニック	1,400	762.00	1,066,800
共和レザー	2,500	781.00	1,952,500
力の源ホールディングス	900	800.00	720,000
スシローグローバルホールディングス	4,100	7,200.00	29,520,000
LIXILピバ	4,000	1,460.00	5,840,000
セーレン	9,100	1,910.00	17,381,000
ソトー	1,600	979.00	1,566,400
東海染工	800	1,040.00	832,000
小松マテーレ	6,000	816.00	4,896,000
ワコールホールディングス	10,700	2,798.00	29,938,600
ホギメディカル	5,000	3,765.00	18,825,000
レナウン	11,900	101.00	1,201,900
クラウドシアホールディングス	1,300	473.00	614,900
T S Iホールディングス	13,700	697.00	9,548,900
マツオカコーポレーション	800	3,370.00	2,696,000
ワールド	3,800	2,027.00	7,702,600

T I S	12,300	5,260.00	64,698,000
ネオス	1,300	1,034.00	1,344,200
電算システム	1,400	2,515.00	3,521,000
グリー	19,900	465.00	9,253,500
コーエーテックモホールディングス	7,600	1,853.00	14,082,800
三菱総合研究所	1,400	3,315.00	4,641,000
ボルテージ	900	578.00	520,200
電算	400	2,219.00	887,600
A G S	2,000	704.00	1,408,000
ファインデックス	3,400	804.00	2,733,600
ヒト・コミュニケーションズ	1,000	1,626.00	1,626,000
ブレインパッド	700	5,150.00	3,605,000
K L a b	6,600	808.00	5,332,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディ	5,400	881.00	4,757,400
イーブックイニシアティブジャパン	600	1,565.00	939,000
ネクソン	93,700	1,638.00	153,480,600
アイスタイル	9,400	685.00	6,439,000
エムアップ	1,200	2,143.00	2,571,600
エイチーム	2,300	1,893.00	4,353,900
テクノスジャパン	3,700	781.00	2,889,700
e n i s h	1,200	468.00	561,600
コロプラ	10,500	706.00	7,413,000
オルトプラス	1,900	315.00	598,500
ブロードリーフ	18,400	574.00	10,561,600
クロス・マーケティンググループ	1,200	429.00	514,800
デジタルハーツホールディングス	2,100	1,320.00	2,772,000
メディアドゥホールディングス	1,200	2,391.00	2,869,200
じげん	4,400	664.00	2,921,600
ブイキューブ	2,100	421.00	884,100
サイバーリンクス	500	948.00	474,000
ディー・エル・イー	1,500	141.00	211,500
フィックスターズ	3,500	1,290.00	4,515,000
C A R T A H O L D I N G S	1,900	1,052.00	1,998,800
オプティム	600	3,940.00	2,364,000
セレス	1,200	1,885.00	2,262,000
特種東海製紙	2,200	3,995.00	8,789,000
ベリサーブ	500	6,680.00	3,340,000
ティーガイア	3,700	2,022.00	7,481,400
セック	300	3,720.00	1,116,000
日本アジアグループ	4,500	368.00	1,656,000
豆蔵ホールディングス	2,700	1,050.00	2,835,000
テクマトリックス	1,800	1,810.00	3,258,000
プロシップ	1,000	1,357.00	1,357,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	89,800	303.00	27,209,400
G M O ペイメントゲートウェイ	6,000	6,360.00	38,160,000
ザッパラス	1,600	396.00	633,600
システムリサーチ	500	3,085.00	1,542,500
インターネットイニシアティブ	6,000	2,529.00	15,174,000
さくらインターネット	4,800	524.00	2,515,200

ヴィンクス	800	1,141.00	912,800
GMOクラウド	800	3,430.00	2,744,000
SRAホールディングス	2,000	2,662.00	5,324,000
Minorisソリューションズ	700	1,637.00	1,145,900
システムインテグレータ	800	688.00	550,400
朝日ネット	3,600	516.00	1,857,600
eBASE	800	1,763.00	1,410,400
アバント	1,100	1,454.00	1,599,400
アドソル日進	1,400	1,756.00	2,458,400
フリービット	2,400	976.00	2,342,400
コムチュア	1,900	3,085.00	5,861,500
サイバーコム	600	2,530.00	1,518,000
アステリア	2,100	838.00	1,759,800
王子ホールディングス	165,500	662.00	109,561,000
日本製紙	17,800	2,051.00	36,507,800
三菱製紙	6,100	569.00	3,470,900
北越コーポレーション	22,100	637.00	14,077,700
中越パルプ工業	1,500	1,371.00	2,056,500
巴川製紙所	1,200	1,022.00	1,226,400
大王製紙	16,000	1,307.00	20,912,000
阿波製紙	1,000	466.00	466,000
マークライズ	1,400	1,485.00	2,079,000
メディカル・データ・ビジョン	3,200	1,138.00	3,641,600
gumi	4,700	588.00	2,763,600
ショーケース・ティービー	600	783.00	469,800
モバイルファクトリー	800	1,447.00	1,157,600
テラスカイ	200	3,910.00	782,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,400	1,504.00	2,105,600
PCIホールディングス	600	2,285.00	1,371,000
パイブドHD	400	841.00	336,400
アイピーシー	400	1,196.00	478,400
ネオジャパン	700	1,028.00	719,600
PR TIMES	200	2,352.00	470,400
ランドコンピュータ	400	1,141.00	456,400
ダブルスタンダード	200	5,010.00	1,002,000
オーブンドア	1,500	3,150.00	4,725,000
マイネット	900	1,121.00	1,008,900
アカツキ	900	5,690.00	5,121,000
ベネフィットジャパン	200	833.00	166,600
Ubicomホールディングス	500	1,264.00	632,000
LINE	11,200	4,045.00	45,304,000
カナミックネットワーク	600	1,984.00	1,190,400
ノムラシステムコーポレーション	300	725.00	217,500
レンゴー	37,800	919.00	34,738,200
トーモク	2,200	1,647.00	3,623,400
ザ・パック	2,800	3,235.00	9,058,000
チェンジ	400	3,815.00	1,526,000
シンクロ・フード	900	747.00	672,300
オークネット	1,300	999.00	1,298,700

AOI TYO Holdings	3,300	781.00	2,577,300
マクロミル	4,000	1,385.00	5,540,000
ビーグリー	600	976.00	585,600
オロ	400	4,810.00	1,924,000
昭和電工	24,400	3,920.00	95,648,000
住友化学	289,400	563.00	162,932,200
住友精化	1,600	4,395.00	7,032,000
日産化学	22,600	5,750.00	129,950,000
ラサ工業	1,500	1,531.00	2,296,500
クレハ	3,400	6,910.00	23,494,000
多木化学	1,000	5,630.00	5,630,000
テイカ	3,000	2,137.00	6,411,000
石原産業	7,100	1,218.00	8,647,800
片倉コープアグリ	1,000	1,142.00	1,142,000
日東エフシー	2,500	774.00	1,935,000
日本曹達	5,500	2,964.00	16,302,000
東ソー	56,800	1,662.00	94,401,600
トクヤマ	11,400	2,840.00	32,376,000
セントラル硝子	8,100	2,561.00	20,744,100
東亜合成	23,400	1,261.00	29,507,400
大阪ソーダ	3,900	2,776.00	10,826,400
関東電化工業	9,500	890.00	8,455,000
デンカ	14,400	3,435.00	49,464,000
イビデン	22,900	1,577.00	36,113,300
信越化学工業	65,300	9,596.00	626,618,800
日本カーバイド工業	1,200	1,526.00	1,831,200
堺化学工業	2,700	2,442.00	6,593,400
第一稀元素化学工業	2,900	907.00	2,630,300
エア・ウォーター	32,400	1,832.00	59,356,800
大陽日酸	30,200	1,578.00	47,655,600
日本化学工業	1,400	2,372.00	3,320,800
東邦アセチレン	700	1,372.00	960,400
日本パーライジング	20,300	1,461.00	29,658,300
高圧ガス工業	5,700	805.00	4,588,500
チタン工業	500	2,340.00	1,170,000
四国化成工業	5,700	1,308.00	7,455,600
戸田工業	900	2,254.00	2,028,600
ステラ ケミファ	2,000	3,155.00	6,310,000
保土谷化学工業	1,400	2,782.00	3,894,800
日本触媒	6,200	7,600.00	47,120,000
大日精化工業	3,100	3,170.00	9,827,000
カネカ	10,600	4,475.00	47,435,000
協和発酵キリン	47,000	2,145.00	100,815,000
三菱瓦斯化学	38,100	1,792.00	68,275,200
三井化学	35,700	2,841.00	101,423,700
J S R	39,500	1,840.00	72,680,000
東京応化工業	6,400	3,420.00	21,888,000
大阪有機化学工業	3,300	1,214.00	4,006,200
三菱ケミカルホールディングス	251,300	834.20	209,634,460

KHネオケム	5,600	2,980.00	16,688,000
ダイセル	57,600	1,149.00	66,182,400
住友ベークライト	6,400	4,360.00	27,904,000
積水化学工業	80,400	1,749.00	140,619,600
日本ゼオン	33,100	1,162.00	38,462,200
アイカ工業	11,000	3,860.00	42,460,000
宇部興産	19,800	2,575.00	50,985,000
積水樹脂	6,100	2,123.00	12,950,300
タキロンシーアイ	7,800	606.00	4,726,800
旭有機材	2,300	1,696.00	3,900,800
日立化成	19,400	2,076.00	40,274,400
ニチバン	1,900	2,243.00	4,261,700
リケンテクノス	8,300	478.00	3,967,400
大倉工業	1,800	1,769.00	3,184,200
積水化成品工業	4,800	968.00	4,646,400
群栄化学工業	900	2,773.00	2,495,700
タイガースポリマー	2,100	617.00	1,295,700
ミライアル	1,200	1,192.00	1,430,400
ダイキアクシス	1,200	1,029.00	1,234,800
ダイキョーニシカワ	7,800	1,267.00	9,882,600
竹本容器	1,000	1,452.00	1,452,000
森六ホールディングス	1,700	2,564.00	4,358,800
日本化薬	25,500	1,302.00	33,201,000
カーリットホールディングス	4,000	837.00	3,348,000
E P Sホールディングス	5,400	1,800.00	9,720,000
ソルクシーズ	1,400	647.00	905,800
レッグス	800	919.00	735,200
プレステージ・インターナショナル	7,500	1,320.00	9,900,000
フェイス	1,200	759.00	910,800
ハイマックス	600	1,833.00	1,099,800
アミューズ	2,400	2,509.00	6,021,600
野村総合研究所	23,400	4,430.00	103,662,000
ドリームインキュベータ	1,300	1,505.00	1,956,500
サイバネットシステム	3,300	597.00	1,970,100
クイック	2,400	1,580.00	3,792,000
T A C	2,500	228.00	570,000
C Eホールディングス	900	732.00	658,800
ケネディクス	33,900	561.00	19,017,900
日本システム技術	500	1,383.00	691,500
電通	43,700	4,905.00	214,348,500
インテージホールディングス	4,300	852.00	3,663,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	1,800.00	2,880,000
東邦システムサイエンス	1,300	911.00	1,184,300
びあ	1,200	4,035.00	4,842,000
イオンファンタジー	1,300	2,824.00	3,671,200
ソースネクスト	11,200	529.00	5,924,800
シーティーエス	3,900	720.00	2,808,000
ネクシィーズグループ	1,200	1,729.00	2,074,800
インフォコム	1,500	4,005.00	6,007,500

メディカルシステムネットワーク	4,100	440.00	1,804,000
日本精化	3,200	1,215.00	3,888,000
扶桑化学工業	3,200	2,177.00	6,966,400
トリケミカル研究所	800	5,030.00	4,024,000
F I G	3,000	343.00	1,029,000
A D E K A	17,100	1,727.00	29,531,700
日油	15,200	3,825.00	58,140,000
ミヨシ油脂	1,600	1,065.00	1,704,000
新日本理化	6,200	191.00	1,184,200
ハリマ化成グループ	3,000	1,087.00	3,261,000
アルテリア・ネットワークス	3,100	1,279.00	3,964,900
花王	92,300	8,328.00	768,674,400
第一工業製薬	1,500	3,090.00	4,635,000
石原ケミカル	1,100	1,845.00	2,029,500
日華化学	1,100	947.00	1,041,700
ニイタカ	500	1,483.00	741,500
三洋化成工業	2,500	5,500.00	13,750,000
武田薬品工業	239,900	4,492.00	1,077,630,800
アステラス製薬	350,600	1,707.00	598,474,200
大日本住友製薬	27,800	2,773.00	77,089,400
塩野義製薬	49,900	6,996.00	349,100,400
田辺三菱製薬	41,400	1,605.00	66,447,000
わかもと製薬	4,000	279.00	1,116,000
あすか製薬	4,300	1,208.00	5,194,400
日本新薬	9,800	6,840.00	67,032,000
ビオフェルミン製薬	700	2,393.00	1,675,100
中外製薬	39,100	7,310.00	285,821,000
科研製薬	6,800	5,290.00	35,972,000
エーザイ	45,000	8,909.00	400,905,000
理研ビタミン	1,400	3,605.00	5,047,000
ロート製薬	20,600	3,010.00	62,006,000
小野薬品工業	88,700	2,280.50	202,280,350
久光製薬	11,100	5,570.00	61,827,000
有機合成薬品工業	3,000	196.00	588,000
持田製薬	2,600	11,490.00	29,874,000
参天製薬	71,100	1,569.00	111,555,900
扶桑薬品工業	1,300	2,575.00	3,347,500
日本ケミファ	500	2,950.00	1,475,000
ツムラ	13,400	3,545.00	47,503,000
日医工	10,000	1,593.00	15,930,000
テルモ	54,000	6,715.00	362,610,000
みらかホールディングス	10,800	3,050.00	32,940,000
キッセイ薬品工業	6,700	2,920.00	19,564,000
生化学工業	7,300	1,372.00	10,015,600
栄研化学	6,100	2,570.00	15,677,000
日水製薬	1,600	1,183.00	1,892,800
鳥居薬品	2,000	2,337.00	4,674,000
J C R ファーマ	2,700	5,700.00	15,390,000
東和薬品	1,800	8,800.00	15,840,000

富士製薬工業	2,500	1,844.00	4,610,000
沢井製薬	7,500	6,010.00	45,075,000
ゼリア新薬工業	8,100	1,899.00	15,381,900
第一三共	107,500	3,904.00	419,680,000
キョーリン製薬ホールディングス	10,600	2,245.00	23,797,000
大幸薬品	1,900	1,835.00	3,486,500
ダイト	2,200	2,835.00	6,237,000
大塚ホールディングス	71,500	4,533.00	324,109,500
大正製薬ホールディングス	8,400	11,340.00	95,256,000
ペプチドリーム	17,300	5,060.00	87,538,000
大日本塗料	4,500	1,156.00	5,202,000
日本ペイントホールディングス	30,300	4,150.00	125,745,000
関西ペイント	41,300	2,122.00	87,638,600
神東塗料	2,000	173.00	346,000
中国塗料	11,400	1,006.00	11,468,400
日本特殊塗料	2,500	1,363.00	3,407,500
藤倉化成	4,900	617.00	3,023,300
太陽ホールディングス	3,000	3,745.00	11,235,000
D I C	16,600	3,555.00	59,013,000
サカタインクス	8,100	1,235.00	10,003,500
東洋インキS Cホールディングス	7,900	2,646.00	20,903,400
T & K T O K A	2,600	1,040.00	2,704,000
アルプス技研	3,200	1,982.00	6,342,400
サニックス	7,100	202.00	1,434,200
ダイオーズ	700	1,378.00	964,600
日本空調サービス	3,700	663.00	2,453,100
オリエンタルランド	42,400	12,285.00	520,884,000
フォーカスシステムズ	2,100	1,039.00	2,181,900
ダスキン	9,600	2,710.00	26,016,000
パーク24	21,600	2,664.00	57,542,400
明光ネットワークジャパン	4,400	943.00	4,149,200
ファルコホールディングス	2,000	1,428.00	2,856,000
クレスコ	900	3,430.00	3,087,000
フジ・メディア・ホールディングス	38,200	1,641.00	62,686,200
秀英予備校	1,000	495.00	495,000
田谷	800	640.00	512,000
ラウンドワン	11,200	1,410.00	15,792,000
リゾートトラスト	15,400	1,585.00	24,409,000
オービック	12,900	10,330.00	133,257,000
ジャストシステム	6,000	2,689.00	16,134,000
T D Cソフト	3,100	947.00	2,935,700
ヤフー	250,400	309.00	77,373,600
ビー・エム・エル	4,700	3,365.00	15,815,500
ワタベウェディング	400	684.00	273,600
トレンドマイクロ	19,600	5,270.00	103,292,000
りらいあコミュニケーションズ	5,700	977.00	5,568,900
インフォメーション・ディベロプメント	1,000	1,386.00	1,386,000
リソー教育	18,000	489.00	8,802,000
日本オラクル	7,500	8,300.00	62,250,000

早稲田アカデミー	500	1,700.00	850,000
アルファシステムズ	1,300	2,682.00	3,486,600
フューチャー	5,000	1,763.00	8,815,000
CAC Holdings	2,700	1,200.00	3,240,000
ソフトバンク・テクノロジー	1,500	2,108.00	3,162,000
トーセ	1,300	812.00	1,055,600
ユー・エス・エス	43,800	2,016.00	88,300,800
オービックビジネスコンサルタント	3,800	4,385.00	16,663,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,800	2,623.00	44,066,400
アイティフォー	4,400	840.00	3,696,000
東京個別指導学院	1,200	1,191.00	1,429,200
東計電算	500	3,065.00	1,532,500
サイバーエージェント	22,100	3,355.00	74,145,500
楽天	167,200	800.00	133,760,000
エクスネット	500	846.00	423,000
クリーク・アンド・リバー社	1,800	1,171.00	2,107,800
テー・オー・ダブリュー	3,300	800.00	2,640,000
大塚商会	19,900	4,065.00	80,893,500
サイボウズ	4,200	648.00	2,721,600
ソフトブレーン	3,200	522.00	1,670,400
セントラルスポーツ	1,300	3,490.00	4,537,000
パラカ	1,000	1,902.00	1,902,000
電通国際情報サービス	2,300	3,725.00	8,567,500
デジタルガレージ	6,700	2,909.00	19,490,300
EMシステムズ	2,500	1,262.00	3,155,000
ウェザーニューズ	1,200	3,130.00	3,756,000
CIJ	3,300	811.00	2,676,300
東洋ビジネスエンジニアリング	300	1,976.00	592,800
日本エンタープライズ	4,000	178.00	712,000
WOWOW	1,800	3,020.00	5,436,000
スカラ	2,300	846.00	1,945,800
フルキャストホールディングス	3,700	2,270.00	8,399,000
エン・ジャパン	3,900	3,920.00	15,288,000
富士フイルムホールディングス	78,000	5,035.00	392,730,000
コニカミノルタ	87,800	1,087.00	95,438,600
資生堂	75,200	7,215.00	542,568,000
ライオン	52,300	2,231.00	116,681,300
高砂香料工業	2,400	3,660.00	8,784,000
マンダム	7,400	2,776.00	20,542,400
ミルボン	4,700	4,935.00	23,194,500
ファンケル	18,400	2,518.00	46,331,200
コーセー	6,400	18,200.00	116,480,000
コタ	1,900	1,505.00	2,859,500
シーボン	400	2,670.00	1,068,000
ポーラ・オルビスホールディングス	16,000	3,160.00	50,560,000
ノエビアホールディングス	2,400	5,350.00	12,840,000
アジュバンコスメジャパン	800	979.00	783,200
エステー	2,600	1,920.00	4,992,000
アグロ カネショウ	1,500	2,086.00	3,129,000

コニシ	6,200	1,697.00	10,521,400
長谷川香料	4,500	1,733.00	7,798,500
星光PMC	2,800	824.00	2,307,200
小林製薬	10,500	8,930.00	93,765,000
荒川化学工業	3,400	1,414.00	4,807,600
メック	2,500	1,155.00	2,887,500
日本高純度化学	1,100	2,379.00	2,616,900
タカラバイオ	9,900	2,369.00	23,453,100
JCU	4,600	1,871.00	8,606,600
新田ゼラチン	2,500	716.00	1,790,000
OATアグリオ	500	1,698.00	849,000
デクセリアルズ	9,700	815.00	7,905,500
アース製薬	2,900	4,995.00	14,485,500
北興化学工業	3,700	549.00	2,031,300
大成ラミック	1,100	2,874.00	3,161,400
クミアイ化学工業	15,700	712.00	11,178,400
日本農薬	8,800	493.00	4,338,400
昭和シェル石油	35,100	1,753.00	61,530,300
富士興産	1,400	669.00	936,600
ニチレキ	4,700	1,130.00	5,311,000
ユシロ化学工業	2,300	1,314.00	3,022,200
ビーピー・カストロール	1,300	1,363.00	1,771,900
富士石油	9,100	292.00	2,657,200
MORESCO	1,300	1,618.00	2,103,400
出光興産	29,900	4,160.00	124,384,000
JXTGホールディングス	644,200	568.40	366,163,280
コスモエネルギーホールディングス	10,900	2,439.00	26,585,100
横浜ゴム	21,700	2,314.00	50,213,800
TOYO TIRE	19,200	1,422.00	27,302,400
ブリヂストン	116,300	4,397.00	511,371,100
住友ゴム工業	33,700	1,425.00	48,022,500
藤倉ゴム工業	3,400	436.00	1,482,400
オカモト	2,600	5,830.00	15,158,000
アキレス	2,700	2,049.00	5,532,300
フコク	1,700	873.00	1,484,100
ニッタ	3,900	3,905.00	15,229,500
クリエートメディック	1,100	997.00	1,096,700
住友理工	7,300	1,021.00	7,453,300
三ツ星ベルト	4,600	2,174.00	10,000,400
バンドー化学	7,200	1,184.00	8,524,800
AGC	37,900	3,915.00	148,378,500
日本板硝子	19,200	973.00	18,681,600
石塚硝子	500	1,737.00	868,500
有沢製作所	6,300	816.00	5,140,800
日本山村硝子	1,500	1,491.00	2,236,500
日本電気硝子	16,200	3,030.00	49,086,000
オハラ	1,600	1,742.00	2,787,200
住友大阪セメント	7,100	4,715.00	33,476,500
太平洋セメント	23,700	3,700.00	87,690,000

リソルホールディングス	400	4,260.00	1,704,000
日本ヒューム	4,100	815.00	3,341,500
日本コンクリート工業	7,900	284.00	2,243,600
三谷セキサン	2,000	2,830.00	5,660,000
アジアパイルホールディングス	5,300	627.00	3,323,100
東海カーボン	34,100	1,515.00	51,661,500
日本カーボン	1,800	5,150.00	9,270,000
東洋炭素	2,200	2,157.00	4,745,400
ノリタケカンパニーリミテド	2,100	5,300.00	11,130,000
TOTO	28,900	4,335.00	125,281,500
日本碍子	45,800	1,688.00	77,310,400
日本特殊陶業	31,600	2,379.00	75,176,400
ダントーホールディングス	3,000	112.00	336,000
MARUWA	1,300	6,320.00	8,216,000
品川リフラクトリーズ	1,000	3,445.00	3,445,000
黒崎播磨	700	5,700.00	3,990,000
ヨータイ	2,000	598.00	1,196,000
イソライト工業	2,100	566.00	1,188,600
東京窯業	5,300	393.00	2,082,900
ニッカトー	1,100	1,039.00	1,142,900
フジミインコーポレーテッド	3,400	2,333.00	7,932,200
クニミネ工業	1,200	825.00	990,000
エーアンドエーマテリアル	800	1,108.00	886,400
ニチアス	10,400	2,080.00	21,632,000
新日鐵住金	173,500	2,030.00	352,205,000
神戸製鋼所	67,900	889.00	60,363,100
中山製鋼所	5,600	497.00	2,783,200
合同製鐵	2,000	1,740.00	3,480,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	100,300	1,934.50	194,030,350
東京製鐵	20,100	880.00	17,688,000
共英製鋼	4,200	1,716.00	7,207,200
大和工業	8,000	3,040.00	24,320,000
東京鐵鋼	1,500	1,211.00	1,816,500
大阪製鐵	2,400	1,866.00	4,478,400
淀川製鋼所	5,500	2,253.00	12,391,500
丸一鋼管	13,100	3,325.00	43,557,500
モリ工業	1,200	2,580.00	3,096,000
大同特殊鋼	6,600	4,730.00	31,218,000
日本高周波鋼業	1,400	544.00	761,600
日本冶金工業	30,900	244.00	7,539,600
山陽特殊製鋼	4,300	2,506.00	10,775,800
愛知製鋼	2,100	3,540.00	7,434,000
日立金属	39,900	1,135.00	45,286,500
日本金属	1,000	1,298.00	1,298,000
大平洋金属	2,300	2,942.00	6,766,600
新日本電工	21,900	236.00	5,168,400
栗本鐵工所	1,800	1,509.00	2,716,200
虹技	500	1,389.00	694,500
日本鑄鉄管	300	881.00	264,300

日本製鋼所	12,100	2,078.00	25,143,800
三菱製鋼	2,700	1,644.00	4,438,800
日亜鋼業	5,400	334.00	1,803,600
日本精線	700	3,385.00	2,369,500
エンビプロ・ホールディングス	900	561.00	504,900
大紀アルミニウム工業所	6,000	629.00	3,774,000
日本軽金属ホールディングス	109,700	245.00	26,876,500
三井金属鉱業	10,100	2,685.00	27,118,500
東邦亜鉛	2,100	3,170.00	6,657,000
三菱マテリアル	24,500	3,080.00	75,460,000
住友金属鉱山	51,200	3,202.00	163,942,400
DOWAホールディングス	9,500	3,520.00	33,440,000
古河機械金属	6,200	1,461.00	9,058,200
エス・サイエンス	19,300	58.00	1,119,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,900	1,858.00	7,246,200
東邦チタニウム	6,700	986.00	6,606,200
UACJ	5,700	2,219.00	12,648,300
CKサンエツ	800	3,490.00	2,792,000
古河電気工業	12,300	3,535.00	43,480,500
住友電気工業	138,800	1,551.00	215,278,800
フジクラ	45,400	493.00	22,382,200
昭和電線ホールディングス	5,100	714.00	3,641,400
東京特殊電線	600	2,091.00	1,254,600
タツタ電線	7,200	523.00	3,765,600
カナレ電気	700	1,837.00	1,285,900
平河ヒューテック	1,800	1,664.00	2,995,200
リョービ	4,600	2,753.00	12,663,800
アーレスティ	4,400	701.00	3,084,400
アサヒホールディングス	6,400	2,170.00	13,888,000
東洋製罐グループホールディングス	23,600	2,297.00	54,209,200
ホッカンホールディングス	2,000	1,762.00	3,524,000
コロナ	2,000	1,043.00	2,086,000
横河ブリッジホールディングス	7,000	1,959.00	13,713,000
OSJBホールディングス	18,300	280.00	5,124,000
駒井ハルテック	800	1,908.00	1,526,400
高田機工	300	2,643.00	792,900
三和ホールディングス	38,700	1,301.00	50,348,700
文化シャッター	11,000	837.00	9,207,000
三協立山	5,200	1,462.00	7,602,400
アルインコ	2,600	996.00	2,589,600
東洋シャッター	1,500	714.00	1,071,000
LIXILグループ	54,700	1,603.00	87,684,100
日本ファイルコン	3,200	555.00	1,776,000
ノーリツ	8,400	1,643.00	13,801,200
長府製作所	3,800	2,211.00	8,401,800
リンナイ	6,600	7,370.00	48,642,000
ユニプレス	7,300	1,993.00	14,548,900
ダイニチ工業	2,000	731.00	1,462,000
日東精工	5,600	553.00	3,096,800

三洋工業	400	1,883.00	753,200
岡部	7,600	972.00	7,387,200
ジーテクト	4,100	1,713.00	7,023,300
中国工業	800	563.00	450,400
東プレ	7,000	2,460.00	17,220,000
高周波熱錬	7,200	883.00	6,357,600
東京製綱	2,600	1,037.00	2,696,200
サンコール	2,100	699.00	1,467,900
モリテック スチール	2,800	444.00	1,243,200
パイオラックス	5,500	2,374.00	13,057,000
エイチワン	3,500	1,124.00	3,934,000
日本発條	36,900	1,052.00	38,818,800
中央発條	400	2,954.00	1,181,600
アドバネクス	600	1,762.00	1,057,200
三浦工業	16,000	2,549.00	40,784,000
タクマ	12,700	1,467.00	18,630,900
テクノプロ・ホールディングス	6,800	5,970.00	40,596,000
アトラ	700	402.00	281,400
インターワークス	700	731.00	511,700
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	1,449.00	1,593,900
Keeper 技研	1,400	1,139.00	1,594,600
ファーストロジック	400	688.00	275,200
三機サービス	400	1,482.00	592,800
Gunosy	2,000	2,633.00	5,266,000
デザインワン・ジャパン	600	339.00	203,400
イー・ガーディアン	1,700	2,117.00	3,598,900
リブセンス	2,500	280.00	700,000
ジャパンマテリアル	9,900	1,443.00	14,285,700
ベクトル	4,400	1,466.00	6,450,400
ウチヤマホールディングス	2,400	441.00	1,058,400
チャーム・ケア・コーポレーション	900	1,719.00	1,547,100
ライクキッズネクスト	800	870.00	696,000
キャリアリンク	1,200	392.00	470,400
I B J	2,300	913.00	2,099,900
アサンテ	1,400	2,211.00	3,095,400
N・フィールド	2,200	921.00	2,026,200
バリューHR	800	2,210.00	1,768,000
M&Aキャピタルパートナーズ	900	5,610.00	5,049,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,700	1,211.00	2,058,700
ERIホールディングス	900	829.00	746,100
アピスト	500	3,320.00	1,660,000
シグマクシス	1,400	936.00	1,310,400
ウィルグループ	1,600	1,170.00	1,872,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,000	271.00	1,355,000
日本ビューホテル	700	1,131.00	791,700
リクルートホールディングス	260,100	3,025.00	786,802,500
エラン	2,000	1,513.00	3,026,000
ツガミ	10,000	764.00	7,640,000
オークマ	4,300	6,030.00	25,929,000

東芝機械	4,200	2,315.00	9,723,000
アマダホールディングス	57,200	1,152.00	65,894,400
アイダエンジニアリング	9,500	823.00	7,818,500
滝澤鉄工所	1,100	1,723.00	1,895,300
F U J I	11,200	1,578.00	17,673,600
牧野フライス製作所	3,800	4,575.00	17,385,000
オーエスジー	18,200	2,244.00	40,840,800
ダイジェット工業	400	1,641.00	656,400
旭ダイヤモンド工業	11,100	810.00	8,991,000
D M G 森精機	23,200	1,514.00	35,124,800
ソディック	8,100	835.00	6,763,500
ディスコ	5,000	16,330.00	81,650,000
日東工器	2,300	2,371.00	5,453,300
日進工具	1,000	2,501.00	2,501,000
パンチ工業	3,000	639.00	1,917,000
富士ダイス	1,400	721.00	1,009,400
土木管理総合試験所	1,200	538.00	645,600
日本郵政	296,400	1,356.00	401,918,400
ベルシステム24ホールディングス	6,000	1,515.00	9,090,000
鎌倉新書	2,000	1,782.00	3,564,000
一蔵	400	626.00	250,400
L I T A L I C O	500	2,064.00	1,032,000
グローバルグループ	400	873.00	349,200
エポラブルアジア	700	2,617.00	1,831,900
アトラエ	800	3,080.00	2,464,000
ストライク	800	2,111.00	1,688,800
ソラスト	6,600	1,112.00	7,339,200
セラク	500	610.00	305,000
インソース	800	2,369.00	1,895,200
豊田自動織機	30,400	5,620.00	170,848,000
豊和工業	1,900	894.00	1,698,600
O K K	1,300	861.00	1,119,300
石川製作所	1,200	1,198.00	1,437,600
東洋機械金属	2,800	609.00	1,705,200
津田駒工業	800	1,985.00	1,588,000
エンシュウ	1,100	1,248.00	1,372,800
島精機製作所	4,700	3,855.00	18,118,500
オプトラ	3,300	2,292.00	7,563,600
N C ホールディングス	1,100	490.00	539,000
フリー	2,500	1,039.00	2,597,500
ヤマシンフィルタ	5,500	711.00	3,910,500
日阪製作所	5,300	899.00	4,764,700
やまびこ	7,200	1,044.00	7,516,800
平田機工	1,800	6,810.00	12,258,000
ベガサスミシン製造	3,500	697.00	2,439,500
マルマエ	1,000	715.00	715,000
タツモ	1,200	790.00	948,000
ナプテスコ	20,400	3,005.00	61,302,000
三井海洋開発	4,000	3,045.00	12,180,000

レオン自動機	3,300	1,595.00	5,263,500
S M C	11,200	39,410.00	441,392,000
新川	2,900	561.00	1,626,900
ホソカワミクロン	1,300	4,830.00	6,279,000
ユニオンツール	1,600	3,025.00	4,840,000
オイレス工業	4,800	1,942.00	9,321,600
日精エー・エス・ビー機械	1,100	4,045.00	4,449,500
サトーホールディングス	4,900	2,710.00	13,279,000
技研製作所	2,100	3,410.00	7,161,000
日本エアテック	1,400	596.00	834,400
カワタ	900	1,393.00	1,253,700
日精樹脂工業	3,400	932.00	3,168,800
オカダアイヨン	1,200	1,481.00	1,777,200
ワイエイシイホールディングス	1,100	795.00	874,500
小松製作所	172,500	2,733.00	471,442,500
住友重機械工業	21,500	3,860.00	82,990,000
日立建機	16,200	2,893.00	46,866,600
日工	1,000	2,147.00	2,147,000
巴工業	1,600	2,386.00	3,817,600
井関農機	3,800	1,656.00	6,292,800
T O W A	3,200	713.00	2,281,600
丸山製作所	700	1,300.00	910,000
北川鉄工所	1,800	2,453.00	4,415,400
シンニッタン	6,000	355.00	2,130,000
ローツェ	2,000	1,725.00	3,450,000
タカキタ	1,300	618.00	803,400
クボタ	201,400	1,537.00	309,551,800
荏原実業	1,100	2,225.00	2,447,500
東洋エンジニアリング	5,400	769.00	4,152,600
三菱化工機	1,400	1,554.00	2,175,600
月島機械	7,500	1,402.00	10,515,000
帝国電機製作所	2,600	1,205.00	3,133,000
東京機械製作所	1,300	408.00	530,400
新東工業	9,000	1,012.00	9,108,000
澁谷工業	3,300	3,345.00	11,038,500
アイチ コーポレーション	6,300	713.00	4,491,900
小森コーポレーション	9,500	1,206.00	11,457,000
鶴見製作所	3,200	1,797.00	5,750,400
住友精密工業	700	2,884.00	2,018,800
酒井重工業	800	2,364.00	1,891,200
荏原製作所	16,600	3,185.00	52,871,000
石井鐵工所	500	1,822.00	911,000
西島製作所	4,200	946.00	3,973,200
北越工業	4,100	1,172.00	4,805,200
千代田化工建設	27,600	309.00	8,528,400
ダイキン工業	51,700	12,350.00	638,495,000
オルガノ	1,300	3,155.00	4,101,500
トーヨーカネツ	1,500	2,335.00	3,502,500
栗田工業	20,300	2,967.00	60,230,100

椿本チエイン	4,500	4,095.00	18,427,500
大同工業	1,600	906.00	1,449,600
日機装	12,200	1,187.00	14,481,400
木村化工機	2,900	379.00	1,099,100
新興プランテック	8,100	1,239.00	10,035,900
アネスト岩田	6,300	993.00	6,255,900
ダイフク	20,800	5,640.00	117,312,000
サムコ	1,000	959.00	959,000
加藤製作所	1,800	2,729.00	4,912,200
油研工業	800	1,897.00	1,517,600
タダノ	18,300	1,185.00	21,685,500
フジテック	11,700	1,221.00	14,285,700
C K D	10,500	1,070.00	11,235,000
キトー	2,800	1,815.00	5,082,000
平和	11,600	2,204.00	25,566,400
理想科学工業	3,800	1,948.00	7,402,400
S A N K Y O	9,400	4,055.00	38,117,000
日本金銭機械	3,400	1,086.00	3,692,400
マースグループホールディングス	2,400	2,197.00	5,272,800
福島工業	2,300	3,920.00	9,016,000
オーイズミ	2,000	368.00	736,000
ダイコク電機	1,700	1,496.00	2,543,200
竹内製作所	6,300	2,028.00	12,776,400
アマノ	11,600	2,379.00	27,596,400
J U K I	5,200	1,331.00	6,921,200
サンデンホールディングス	4,600	846.00	3,891,600
蛇の目マシン工業	3,300	485.00	1,600,500
ブラザー工業	49,300	2,111.00	104,072,300
マックス	5,800	1,513.00	8,775,400
モリタホールディングス	6,100	1,869.00	11,400,900
グローリー	11,300	2,640.00	29,832,000
新晃工業	3,800	1,550.00	5,890,000
大和冷機工業	5,400	1,265.00	6,831,000
セガサミーホールディングス	37,200	1,289.00	47,950,800
日本ピストンリング	1,500	1,691.00	2,536,500
リケン	1,700	5,210.00	8,857,000
T P R	4,200	2,479.00	10,411,800
ツバキ・ナカシマ	4,300	2,005.00	8,621,500
ホシザキ	11,000	7,410.00	81,510,000
大豊工業	3,000	1,064.00	3,192,000
日本精工	77,100	1,055.00	81,340,500
N T N	86,700	355.00	30,778,500
ジェイテクト	40,000	1,439.00	57,560,000
不二越	3,500	4,490.00	15,715,000
ミネベアミツミ	69,700	1,794.00	125,041,800
日本トムソン	12,100	564.00	6,824,400
T H K	23,400	2,829.00	66,198,600
ユーシン精機	3,200	1,043.00	3,337,600
前澤給装工業	1,500	1,856.00	2,784,000

イーグル工業	4,600	1,300.00	5,980,000
前澤工業	2,700	360.00	972,000
日本ピラー工業	3,800	1,403.00	5,331,400
キッツ	15,400	852.00	13,120,800
日立製作所	171,300	3,482.00	596,466,600
三菱電機	378,400	1,436.50	543,571,600
富士電機	24,600	3,490.00	85,854,000
東洋電機製造	1,600	1,353.00	2,164,800
安川電機	43,500	3,200.00	139,200,000
シンフォニアテクノロジー	4,900	1,388.00	6,801,200
明電舎	6,400	1,616.00	10,342,400
オリジン電気	1,100	2,295.00	2,524,500
山洋電気	1,800	4,060.00	7,308,000
デンヨー	3,500	1,433.00	5,015,500
ベikalレント・コンサルティング	1,900	3,295.00	6,260,500
Orchestra Holdings	500	860.00	430,000
アイモバイル	800	878.00	702,400
キャリアインデックス	800	946.00	756,800
MS - Japan	1,200	1,768.00	2,121,600
船場	500	915.00	457,500
グレイステクノロジー	800	2,403.00	1,922,400
ジャパンエレベーターサービスホールディング	2,100	2,027.00	4,256,700
フルテック	400	1,109.00	443,600
グリーンズ	900	1,431.00	1,287,900
ツナグ・ソリューションズ	400	612.00	244,800
日総工産	1,100	2,653.00	2,918,300
キュービーネットホールディングス	1,800	2,071.00	3,727,800
三櫻工業	4,700	557.00	2,617,900
マキタ	46,700	4,060.00	189,602,000
東芝テック	5,400	2,976.00	16,070,400
芝浦メカトロニクス	500	3,530.00	1,765,000
マブチモーター	10,400	3,850.00	40,040,000
日本電産	45,500	13,400.00	609,700,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,500	1,823.00	2,734,500
トレックス・セミコンダクター	1,200	1,147.00	1,376,400
東光高岳	2,100	1,417.00	2,975,700
ダブル・スコープ	5,400	1,339.00	7,230,600
宮越ホールディングス	1,800	1,090.00	1,962,000
ダイヘン	4,100	2,802.00	11,488,200
田淵電機	5,700	122.00	695,400
ヤーマン	5,500	1,337.00	7,353,500
JVCケンウッド	31,500	272.00	8,568,000
ミマキエンジニアリング	3,300	770.00	2,541,000
第一精工	1,500	1,059.00	1,588,500
日新電機	8,800	1,013.00	8,914,400
大崎電気工業	8,100	703.00	5,694,300
オムロン	39,900	4,950.00	197,505,000
日東工業	6,100	2,233.00	13,621,300
I D E C	4,700	2,100.00	9,870,000

正興電機製作所	700	808.00	565,600
不二電機工業	600	1,300.00	780,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	13,500	2,297.00	31,009,500
サクサホールディングス	1,100	1,866.00	2,052,600
メルコホールディングス	1,800	3,990.00	7,182,000
テクノメディカ	1,000	2,102.00	2,102,000
日本電気	48,600	3,755.00	182,493,000
富士通	36,900	7,518.00	277,414,200
沖電気工業	15,400	1,307.00	20,127,800
岩崎通信機	1,500	821.00	1,231,500
電気興業	2,100	2,660.00	5,586,000
サンケン電気	4,400	2,279.00	10,027,600
ナカヨ	800	1,412.00	1,129,600
アイホン	2,300	1,758.00	4,043,400
ルネサスエレクトロニクス	43,600	690.00	30,084,000
セイコーエプソン	48,600	1,680.00	81,648,000
ワコム	29,400	473.00	13,906,200
アルバック	8,700	3,240.00	28,188,000
アクセル	1,400	514.00	719,600
E I Z O	3,500	4,700.00	16,450,000
ジャパンディスプレイ	77,600	72.00	5,587,200
日本信号	10,400	981.00	10,202,400
京三製作所	8,600	400.00	3,440,000
能美防災	5,000	1,996.00	9,980,000
ホーチキ	2,700	1,154.00	3,115,800
星和電機	1,500	447.00	670,500
エレコム	3,400	3,345.00	11,373,000
パナソニック	432,300	1,043.50	451,105,050
シャープ	37,200	1,362.00	50,666,400
アンリツ	27,300	2,145.00	58,558,500
富士通ゼネラル	11,600	1,498.00	17,376,800
ソニー	253,700	5,274.00	1,338,013,800
T D K	19,600	8,780.00	172,088,000
帝国通信工業	1,600	1,201.00	1,921,600
タムラ製作所	14,600	594.00	8,672,400
アルプスアルパイン	41,000	2,308.00	94,628,000
池上通信機	1,300	1,179.00	1,532,700
パイオニア	62,700	66.00	4,138,200
日本電波工業	3,700	371.00	1,372,700
鈴木	1,400	673.00	942,200
日本トリム	800	5,570.00	4,456,000
ローランド ディー . ジー .	1,900	2,236.00	4,248,400
フォスター電機	4,400	1,574.00	6,925,600
クラリオン	3,900	2,500.00	9,750,000
S M K	900	2,631.00	2,367,900
ヨコオ	2,700	1,650.00	4,455,000
ティアック	3,000	200.00	600,000
ホシデン	9,500	928.00	8,816,000
ヒロセ電機	5,700	11,670.00	66,519,000

日本航空電子工業	9,600	1,502.00	14,419,200
TOA	4,000	1,040.00	4,160,000
マクセルホールディングス	7,500	1,669.00	12,517,500
古野電気	4,400	979.00	4,307,600
ユニデンホールディングス	1,000	2,302.00	2,302,000
スミダコーポレーション	3,200	1,515.00	4,848,000
アイコム	2,000	2,246.00	4,492,000
リオン	1,700	1,932.00	3,284,400
本多通信工業	2,800	555.00	1,554,000
船井電機	3,700	766.00	2,834,200
横河電機	37,600	2,138.00	80,388,800
新電元工業	1,300	4,460.00	5,798,000
アズビル	24,400	2,409.00	58,779,600
東亜ディーケーケー	1,900	847.00	1,609,300
日本光電工業	16,700	3,415.00	57,030,500
チノー	1,400	1,290.00	1,806,000
共和電業	4,600	374.00	1,720,400
日本電子材料	1,300	712.00	925,600
堀場製作所	7,500	5,840.00	43,800,000
アドバンテスト	25,800	2,704.00	69,763,200
小野測器	1,600	615.00	984,000
エスベック	3,300	2,065.00	6,814,500
キーエンス	18,600	62,570.00	1,163,802,000
日置電機	2,000	4,460.00	8,920,000
シスメックス	29,200	6,679.00	195,026,800
日本マイクロニクス	5,900	818.00	4,826,200
メガチップス	3,000	2,264.00	6,792,000
OBARA GROUP	2,200	3,920.00	8,624,000
IMAGICA GROUP	3,400	506.00	1,720,400
澤藤電機	400	1,596.00	638,400
デンソー	83,300	4,833.00	402,588,900
原田工業	1,200	945.00	1,134,000
コーセル	5,200	1,172.00	6,094,400
イリソ電子工業	3,200	4,830.00	15,456,000
オプテックスグループ	6,600	2,137.00	14,104,200
千代田インテグレ	1,600	2,144.00	3,430,400
アイ・オー・データ機器	1,700	1,212.00	2,060,400
レーザーテック	7,800	4,140.00	32,292,000
スタンレー電気	28,600	3,220.00	92,092,000
岩崎電気	1,400	1,375.00	1,925,000
ウシオ電機	22,700	1,312.00	29,782,400
岡谷電機産業	1,700	387.00	657,900
ヘリオス テクノ ホールディング	3,100	707.00	2,191,700
エノモト	800	882.00	705,600
日本セラミック	3,800	2,785.00	10,583,000
遠藤照明	1,900	712.00	1,352,800
古河電池	2,600	725.00	1,885,000
双信電機	1,800	443.00	797,400
山一電機	2,700	1,209.00	3,264,300

図研	2,400	1,599.00	3,837,600
日本電子	6,900	1,896.00	13,082,400
カシオ計算機	33,500	1,513.00	50,685,500
ファナック	36,000	19,410.00	698,760,000
日本シイエムケイ	6,500	674.00	4,381,000
エンプラス	1,700	3,050.00	5,185,000
大真空	1,400	896.00	1,254,400
ローム	17,800	7,560.00	134,568,000
浜松ホトニクス	26,900	3,985.00	107,196,500
三井ハイテック	5,000	1,014.00	5,070,000
新光電気工業	14,300	835.00	11,940,500
京セラ	58,200	6,240.00	363,168,000
協栄産業	600	1,599.00	959,400
太陽誘電	18,200	2,366.00	43,061,200
村田製作所	39,700	17,475.00	693,757,500
ユーシン	6,200	983.00	6,094,600
双葉電子工業	6,200	1,756.00	10,887,200
日東電工	28,400	6,061.00	172,132,400
北陸電気工業	1,600	1,060.00	1,696,000
東海理化電機製作所	10,000	2,020.00	20,200,000
ニチコン	11,900	1,001.00	11,911,900
日本ケミコン	3,100	2,151.00	6,668,100
K O A	5,200	1,585.00	8,242,000
三井E & Sホールディングス	13,700	1,268.00	17,371,600
日立造船	30,000	353.00	10,590,000
三菱重工業	62,900	4,350.00	273,615,000
川崎重工業	29,200	2,853.00	83,307,600
I H I	28,800	3,265.00	94,032,000
名村造船所	11,300	432.00	4,881,600
サノヤスホールディングス	4,800	177.00	849,600
スプリックス	1,100	2,729.00	3,001,900
日本車輛製造	1,400	2,634.00	3,687,600
三菱ロジスネクスト	4,400	1,372.00	6,036,800
近畿車輛	600	2,095.00	1,257,000
F P G	11,900	1,056.00	12,566,400
島根銀行	700	701.00	490,700
じもとホールディングス	24,500	123.00	3,013,500
全国保証	10,400	4,060.00	42,224,000
めぶきフィナンシャルグループ	192,300	306.00	58,843,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,000	1,632.00	8,160,000
九州フィナンシャルグループ	61,500	460.00	28,290,000
かんぼ生命保険	14,000	2,478.00	34,692,000
ゆうちょ銀行	104,900	1,260.00	132,174,000
富山第一銀行	9,200	388.00	3,569,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	237,700	457.00	108,628,900
ジェイリース	800	395.00	316,000
西日本フィナンシャルホールディングス	24,000	999.00	23,976,000
マーキュリアインベストメント	900	685.00	616,500
イントラスト	800	434.00	347,200

日本モーゲージサービス	500	1,311.00	655,500
C a s a	1,200	1,080.00	1,296,000
アルヒ	3,900	2,430.00	9,477,000
プレミアグループ	800	3,240.00	2,592,000
日産自動車	442,900	948.00	419,869,200
トヨタ自動車	422,100	6,790.00	2,866,059,000
日野自動車	53,500	1,035.00	55,372,500
三菱自動車工業	138,900	631.00	87,645,900
エフテック	2,600	1,005.00	2,613,000
レシップホールディングス	1,100	727.00	799,700
G M B	700	942.00	659,400
ファルテック	700	894.00	625,800
武蔵精密工業	8,100	1,574.00	12,749,400
日産車体	14,800	1,005.00	14,874,000
新明和工業	16,500	1,319.00	21,763,500
極東開発工業	7,000	1,498.00	10,486,000
日信工業	7,700	1,567.00	12,065,900
トピー工業	3,100	2,373.00	7,356,300
ティラド	1,300	2,313.00	3,006,900
曙ブレーキ工業	17,100	172.00	2,941,200
タチエス	6,400	1,680.00	10,752,000
N O K	20,100	1,807.00	36,320,700
フタバ産業	11,500	612.00	7,038,000
K Y B	3,900	3,055.00	11,914,500
市光工業	5,500	685.00	3,767,500
大同メタル工業	4,800	801.00	3,844,800
プレス工業	20,100	636.00	12,783,600
ミクニ	4,700	495.00	2,326,500
太平洋工業	7,900	1,690.00	13,351,000
ケーヒン	8,700	1,940.00	16,878,000
河西工業	4,500	873.00	3,928,500
アイシン精機	30,900	4,370.00	135,033,000
マツダ	117,800	1,290.00	151,962,000
今仙電機製作所	3,800	1,040.00	3,952,000
本田技研工業	320,200	3,033.00	971,166,600
スズキ	69,800	5,778.00	403,304,400
S U B A R U	116,600	2,823.00	329,161,800
安永	2,000	1,571.00	3,142,000
ヤマハ発動機	53,000	2,246.00	119,038,000
ショーワ	9,800	1,587.00	15,552,600
小糸製作所	22,500	6,860.00	154,350,000
T B K	4,400	427.00	1,878,800
エクセディ	4,600	2,704.00	12,438,400
ミツバ	6,900	711.00	4,905,900
豊田合成	13,600	2,491.00	33,877,600
愛三工業	6,600	751.00	4,956,600
盟和産業	500	1,051.00	525,500
日本プラスト	1,900	827.00	1,571,300
ヨロズ	3,800	1,639.00	6,228,200

エフ・シー・シー	6,200	2,638.00	16,355,600
新家工業	900	1,632.00	1,468,800
シマノ	15,100	17,150.00	258,965,000
テイ・エス テック	8,800	3,235.00	28,468,000
関西みらいフィナンシャルグループ	16,400	821.00	13,464,400
三十三フィナンシャルグループ	3,100	1,599.00	4,956,900
第四北越フィナンシャルグループ	6,300	3,525.00	22,207,500
ジャムコ	1,800	2,602.00	4,683,600
小野建	3,300	1,604.00	5,293,200
はるやまホールディングス	1,600	856.00	1,369,600
南陽	800	2,248.00	1,798,400
ノジマ	6,600	2,036.00	13,437,600
佐島電機	2,700	997.00	2,691,900
カッパ・クリエイト	4,600	1,412.00	6,495,200
エコートレーディング	1,000	599.00	599,000
伯東	2,500	1,234.00	3,085,000
コンドーテック	3,200	1,040.00	3,328,000
中山福	2,300	555.00	1,276,500
ライトオン	3,200	810.00	2,592,000
ナガイレーベン	5,300	2,352.00	12,465,600
ジーンズメイト	1,300	460.00	598,000
三菱食品	4,100	2,888.00	11,840,800
良品計画	5,300	26,700.00	141,510,000
三城ホールディングス	4,900	403.00	1,974,700
松田産業	2,600	1,471.00	3,824,600
第一興商	5,500	5,540.00	30,470,000
メディカルホールディングス	40,200	2,650.00	106,530,000
アドヴァン	4,100	1,010.00	4,141,000
S P K	800	2,311.00	1,848,800
萩原電気ホールディングス	1,400	3,055.00	4,277,000
アルビス	1,100	2,347.00	2,581,700
アズワン	2,900	8,330.00	24,157,000
スズデン	1,200	1,711.00	2,053,200
尾家産業	1,100	1,274.00	1,401,400
シモジマ	2,500	1,136.00	2,840,000
ドウシシャ	3,900	1,727.00	6,735,300
小津産業	700	1,871.00	1,309,700
コナカ	4,500	438.00	1,971,000
高速	2,400	1,184.00	2,841,600
ハウス オブ ローゼ	600	1,831.00	1,098,600
G - 7ホールディングス	1,200	2,258.00	2,709,600
たけびし	1,400	1,450.00	2,030,000
イオン北海道	3,700	787.00	2,911,900
コジマ	5,300	655.00	3,471,500
ヒマラヤ	1,100	994.00	1,093,400
コーナン商事	5,300	2,867.00	15,195,100
ネットワンシステムズ	15,200	2,544.00	38,668,800
エコス	1,400	1,703.00	2,384,200
ワタミ	4,400	1,616.00	7,110,400

マルシェ	700	773.00	541,100
リックス	700	1,663.00	1,164,100
システムソフト	9,500	100.00	950,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	22,300	6,830.00	152,309,000
丸文	3,200	711.00	2,275,200
西松屋チェーン	8,200	911.00	7,470,200
ゼンショーホールディングス	19,200	2,508.00	48,153,600
ハピネット	2,500	1,472.00	3,680,000
幸楽苑ホールディングス	2,300	2,324.00	5,345,200
ハークスレイ	800	1,138.00	910,400
橋本総業ホールディングス	700	1,491.00	1,043,700
日本ライフライン	10,700	1,759.00	18,821,300
サイゼリヤ	6,100	2,061.00	12,572,100
タカショー	1,900	428.00	813,200
エクセル	1,600	2,330.00	3,728,000
V Tホールディングス	12,500	421.00	5,262,500
マルカキカイ	1,200	2,128.00	2,553,600
アルゴグラフィックス	1,700	4,975.00	8,457,500
魚力	1,000	1,462.00	1,462,000
I D O M	10,900	363.00	3,956,700
日本エム・ディ・エム	2,400	1,151.00	2,762,400
ポプラ	700	572.00	400,400
フジ・コーポレーション	800	2,113.00	1,690,400
ユナイテッドアローズ	4,600	3,575.00	16,445,000
進和	2,100	2,202.00	4,624,200
エスケイジャパン	900	694.00	624,600
ダイトロン	1,600	1,698.00	2,716,800
ハイデイ日高	4,900	2,321.00	11,372,900
シークス	4,700	1,749.00	8,220,300
京都きもの友禅	2,200	440.00	968,000
コロワイド	12,400	2,363.00	29,301,200
ピーシーデポコーポレーション	5,400	458.00	2,473,200
田中商事	1,600	610.00	976,000
オーハシテクニカ	2,300	1,436.00	3,302,800
壱番屋	2,600	4,840.00	12,584,000
白銅	1,500	1,680.00	2,520,000
トップカルチャー	1,700	299.00	508,300
P L A N T	700	1,006.00	704,200
スギホールディングス	8,100	4,760.00	38,556,000
島津製作所	48,700	2,788.00	135,775,600
J M S	3,500	638.00	2,233,000
クボテック	1,100	354.00	389,400
長野計器	3,200	789.00	2,524,800
ブイ・テクノロジー	900	14,730.00	13,257,000
スター精密	6,000	1,719.00	10,314,000
東京計器	2,600	1,116.00	2,901,600
愛知時計電機	500	3,870.00	1,935,000
インターアクション	1,700	1,776.00	3,019,200
オーバル	4,300	250.00	1,075,000

東京精密	6,900	3,020.00	20,838,000
マニー	4,600	5,120.00	23,552,000
ニコン	65,400	1,753.00	114,646,200
トプコン	20,100	1,548.00	31,114,800
オリンパス	55,900	4,790.00	267,761,000
理研計器	3,600	2,246.00	8,085,600
S C R E E Nホールディングス	7,100	4,655.00	33,050,500
キヤノン電子	3,500	1,842.00	6,447,000
タムロン	3,400	1,968.00	6,691,200
HOYA	75,600	6,770.00	511,812,000
シード	1,200	1,333.00	1,599,600
ノーリツ鋼機	3,800	2,170.00	8,246,000
エー・アンド・デイ	3,600	738.00	2,656,800
朝日インテック	16,000	5,490.00	87,840,000
キヤノン	203,700	3,224.00	656,728,800
リコー	112,900	1,132.00	127,802,800
シチズン時計	44,700	634.00	28,339,800
リズム時計工業	1,200	1,657.00	1,988,400
大研医器	3,300	588.00	1,940,400
メニコン	5,200	2,879.00	14,970,800
シンシア	400	479.00	191,600
中本パックス	600	1,704.00	1,022,400
スノーピーク	1,200	1,390.00	1,668,000
パラマウントベッドホールディングス	4,000	5,010.00	20,040,000
トランザクション	1,900	721.00	1,369,900
S H O - B I	1,600	364.00	582,400
ニホンフラッシュ	1,700	2,060.00	3,502,000
前田工織	4,300	2,751.00	11,829,300
永大産業	5,000	438.00	2,190,000
アートネイチャー	3,900	632.00	2,464,800
バンダイナムコホールディングス	38,800	4,800.00	186,240,000
アイフィスジャパン	900	576.00	518,400
共立印刷	6,000	223.00	1,338,000
S H O E I	1,800	4,040.00	7,272,000
フランスベッドホールディングス	4,200	866.00	3,637,200
マーベラス	6,200	907.00	5,623,400
パイロットコーポレーション	6,600	5,250.00	34,650,000
萩原工業	2,100	1,651.00	3,467,100
エイベックス	6,900	1,419.00	9,791,100
トッパン・フォームズ	8,100	945.00	7,654,500
フジシールインターナショナル	8,500	4,165.00	35,402,500
タカラトミー	15,900	1,130.00	17,967,000
廣済堂	3,800	707.00	2,686,600
エステールホールディングス	1,000	671.00	671,000
アーク	16,800	94.00	1,579,200
レック	4,500	1,647.00	7,411,500
タカノ	1,700	859.00	1,460,300
三光合成	2,700	370.00	999,000
プロネクサス	3,200	1,209.00	3,868,800

ホクシン	3,100	139.00	430,900
ウッドワン	1,400	1,142.00	1,598,800
大建工業	2,900	1,919.00	5,565,100
きもと	6,100	189.00	1,152,900
凸版印刷	53,000	1,746.00	92,538,000
大日本印刷	53,300	2,563.00	136,607,900
図書印刷	2,400	939.00	2,253,600
共同印刷	1,100	2,486.00	2,734,600
N I S S H A	7,800	1,374.00	10,717,200
光村印刷	300	2,208.00	662,400
藤森工業	3,200	3,095.00	9,904,000
ヴィア・ホールディングス	4,100	666.00	2,730,600
宝印刷	1,900	1,657.00	3,148,300
前澤化成工業	2,800	1,003.00	2,808,400
未来工業	2,000	2,407.00	4,814,000
アシックス	37,200	1,487.00	55,316,400
ツツミ	1,300	1,990.00	2,587,000
ウェーブロックホールディングス	1,000	828.00	828,000
J S P	2,200	2,458.00	5,407,600
ニチハ	5,700	3,135.00	17,869,500
エフピコ	3,100	6,550.00	20,305,000
小松ウオール工業	1,200	1,937.00	2,324,400
ヤマハ	23,100	5,470.00	126,357,000
河合楽器製作所	1,200	3,355.00	4,026,000
クリナップ	3,400	635.00	2,159,000
ビジョン	22,700	4,680.00	106,236,000
天馬	2,900	2,028.00	5,881,200
兼松サステック	400	1,561.00	624,400
キングジム	3,400	825.00	2,805,000
象印マホービン	7,000	1,220.00	8,540,000
リンテック	9,000	2,517.00	22,653,000
信越ポリマー	7,700	835.00	6,429,500
東リ	9,200	277.00	2,548,400
イトーキ	6,900	577.00	3,981,300
任天堂	23,300	29,675.00	691,427,500
三菱鉛筆	6,200	2,291.00	14,204,200
松風	1,800	1,297.00	2,334,600
タカラスタンダード	7,800	1,723.00	13,439,400
コクヨ	18,200	1,694.00	30,830,800
ナカバヤシ	3,800	546.00	2,074,800
ニフコ	13,800	2,789.00	38,488,200
立川ブラインド工業	1,600	1,202.00	1,923,200
グローブライド	1,600	2,839.00	4,542,400
オカムラ	13,200	1,310.00	17,292,000
バルカー	3,100	2,306.00	7,148,600
M U T O Hホールディングス	500	1,873.00	936,500
伊藤忠商事	262,400	2,030.50	532,803,200
丸紅	367,500	821.20	301,791,000
スクロール	6,200	395.00	2,449,000

高島	700	1,840.00	1,288,000
ヨンドシーホールディングス	3,800	2,158.00	8,200,400
三陽商会	2,300	1,676.00	3,854,800
長瀬産業	22,200	1,661.00	36,874,200
ナイガイ	1,200	537.00	644,400
蝶理	2,300	1,585.00	3,645,500
豊田通商	41,300	3,615.00	149,299,500
オンワードホールディングス	23,000	667.00	15,341,000
三共生興	6,900	439.00	3,029,100
兼松	16,000	1,310.00	20,960,000
美津濃	3,700	2,606.00	9,642,200
ツカモトコーポレーション	900	1,021.00	918,900
ユニー・ファミリーマートホールディングス	10,700	12,770.00	136,639,000
ルックホールディングス	1,300	1,359.00	1,766,700
三井物産	307,000	1,803.00	553,521,000
日本紙パルプ商事	1,900	4,225.00	8,027,500
東京エレクトロン	25,000	15,665.00	391,625,000
日立ハイテクノロジーズ	12,800	4,300.00	55,040,000
カメイ	4,800	1,243.00	5,966,400
東都水産	500	2,553.00	1,276,500
OUGホールディングス	600	2,506.00	1,503,600
スターゼン	1,500	4,020.00	6,030,000
セイコーホールディングス	5,900	2,582.00	15,233,800
山善	14,600	1,197.00	17,476,200
椿本興業	900	3,615.00	3,253,500
住友商事	222,200	1,655.00	367,741,000
日本ユニシス	10,200	2,868.00	29,253,600
内田洋行	1,700	2,353.00	4,000,100
三菱商事	261,500	3,254.00	850,921,000
第一実業	1,700	3,490.00	5,933,000
キヤノンマーケティングジャパン	10,700	2,112.00	22,598,400
西華産業	2,200	1,537.00	3,381,400
佐藤商事	3,600	962.00	3,463,200
菱洋エレクトロ	3,400	1,551.00	5,273,400
東京産業	3,400	546.00	1,856,400
ユアサ商事	3,500	3,415.00	11,952,500
神鋼商事	900	2,518.00	2,266,200
小林産業	2,600	291.00	756,600
阪和興業	7,000	3,305.00	23,135,000
正栄食品工業	1,900	3,065.00	5,823,500
カナデン	3,500	1,299.00	4,546,500
菱電商事	2,600	1,481.00	3,850,600
ニプロ	25,900	1,486.00	38,487,400
フルサト工業	2,200	1,670.00	3,674,000
岩谷産業	8,300	3,655.00	30,336,500
すてきなイスグループ	1,700	891.00	1,514,700
昭光通商	1,300	624.00	811,200
ニチモウ	400	1,727.00	690,800
極東貿易	1,200	1,737.00	2,084,400

イワキ	4,300	419.00	1,801,700
兼松エレクトロニクス	2,300	3,295.00	7,578,500
三愛石油	10,000	987.00	9,870,000
稲畑産業	9,000	1,579.00	14,211,000
G S Iクレオス	900	1,214.00	1,092,600
明和産業	3,100	465.00	1,441,500
キムラタン	14,500	24.00	348,000
ゴールドウイン	3,400	13,690.00	46,546,000
ユニ・チャーム	79,600	3,540.00	281,784,000
デサント	9,100	2,411.00	21,940,100
キング	1,700	565.00	960,500
ワキタ	7,900	1,216.00	9,606,400
ヤマトインターナショナル	2,200	428.00	941,600
東邦ホールディングス	10,900	2,716.00	29,604,400
サンゲツ	12,200	2,090.00	25,498,000
ミツウロコグループホールディングス	5,200	818.00	4,253,600
シナネンホールディングス	1,500	2,216.00	3,324,000
伊藤忠エネクス	8,200	948.00	7,773,600
サンリオ	10,500	2,345.00	24,622,500
サンワテクノス	2,300	977.00	2,247,100
リョーサン	4,100	3,110.00	12,751,000
新光商事	4,100	1,900.00	7,790,000
トーヨー	1,800	2,096.00	3,772,800
三信電気	3,400	1,875.00	6,375,000
東陽テクニカ	4,200	892.00	3,746,400
モスフードサービス	4,900	2,759.00	13,519,100
加賀電子	3,400	2,130.00	7,242,000
三益半導体工業	2,900	1,484.00	4,303,600
ソーダニッカ	3,700	560.00	2,072,000
立花エレテック	2,500	1,688.00	4,220,000
木曽路	4,600	2,580.00	11,868,000
S R Sホールディングス	4,300	1,016.00	4,368,800
千趣会	7,300	242.00	1,766,600
タカキュー	3,300	187.00	617,100
ケーヨー	7,500	544.00	4,080,000
上新電機	4,400	2,321.00	10,212,400
日本瓦斯	6,800	4,035.00	27,438,000
ロイヤルホールディングス	6,600	2,690.00	17,754,000
東天紅	300	1,324.00	397,200
いなげや	4,100	1,353.00	5,547,300
島忠	8,400	2,991.00	25,124,400
チヨダ	4,400	1,891.00	8,320,400
ライフコーポレーション	2,800	2,446.00	6,848,800
リンガーハット	4,600	2,380.00	10,948,000
Mr M a x H D	4,500	508.00	2,286,000
テンアライド	3,400	414.00	1,407,600
A O K Iホールディングス	7,400	1,266.00	9,368,400
オークワ	5,000	1,127.00	5,635,000
コメリ	5,800	2,787.00	16,164,600

青山商事	7,200	2,775.00	19,980,000
しまむら	4,300	9,170.00	39,431,000
はせがわ	2,100	391.00	821,100
高島屋	29,000	1,491.00	43,239,000
松屋	7,500	1,088.00	8,160,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	17,700	1,560.00	27,612,000
近鉄百貨店	1,400	3,450.00	4,830,000
パルコ	3,500	1,149.00	4,021,500
丸井グループ	33,900	2,018.00	68,410,200
クレディセゾン	28,100	1,592.00	44,735,200
アクシアル リテイリング	3,100	3,500.00	10,850,000
井筒屋	1,700	211.00	358,700
イオン	142,300	2,390.00	340,097,000
イズミ	7,600	5,400.00	41,040,000
フォーバル	1,400	839.00	1,174,600
平和堂	7,600	2,521.00	19,159,600
フジ	4,400	1,868.00	8,219,200
ヤオコー	4,200	5,980.00	25,116,000
ゼビオホールディングス	5,000	1,301.00	6,505,000
ケーズホールディングス	38,700	1,002.00	38,777,400
PALTAC	6,700	5,700.00	38,190,000
三谷産業	3,900	281.00	1,095,900
Olympicグループ	1,900	767.00	1,457,300
日産東京販売ホールディングス	5,900	329.00	1,941,100
新生銀行	30,200	1,527.00	46,115,400
あおぞら銀行	22,000	3,235.00	71,170,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,599,200	587.00	1,525,730,400
りそなホールディングス	406,400	509.50	207,060,800
三井住友トラスト・ホールディングス	72,800	4,210.00	306,488,000
三井住友フィナンシャルグループ	263,700	4,041.00	1,065,611,700
千葉銀行	131,100	679.00	89,016,900
群馬銀行	73,900	479.00	35,398,100
武蔵野銀行	6,000	2,388.00	14,328,000
千葉興業銀行	10,000	336.00	3,360,000
筑波銀行	15,100	206.00	3,110,600
七十七銀行	11,600	1,852.00	21,483,200
青森銀行	2,900	2,861.00	8,296,900
秋田銀行	2,400	2,179.00	5,229,600
山形銀行	4,200	1,945.00	8,169,000
岩手銀行	2,600	3,325.00	8,645,000
東邦銀行	33,400	309.00	10,320,600
東北銀行	1,900	1,095.00	2,080,500
みちのく銀行	2,300	1,607.00	3,696,100
ふくおかフィナンシャルグループ	30,000	2,473.00	74,190,000
静岡銀行	93,200	886.00	82,575,200
十六銀行	5,000	2,311.00	11,555,000
スルガ銀行	38,300	540.00	20,682,000
八十二銀行	66,900	474.00	31,710,600
山梨中央銀行	4,600	1,421.00	6,536,600

大垣共立銀行	5,900	2,274.00	13,416,600
福井銀行	3,200	1,588.00	5,081,600
北國銀行	4,200	3,435.00	14,427,000
清水銀行	1,600	1,762.00	2,819,200
富山銀行	700	3,155.00	2,208,500
滋賀銀行	7,000	2,598.00	18,186,000
南都銀行	4,400	2,234.00	9,829,600
百五銀行	35,900	388.00	13,929,200
京都銀行	14,100	4,680.00	65,988,000
紀陽銀行	14,100	1,559.00	21,981,900
ほくほくフィナンシャルグループ	24,600	1,243.00	30,577,800
広島銀行	54,600	645.00	35,217,000
山陰合同銀行	22,200	819.00	18,181,800
中国銀行	25,900	1,055.00	27,324,500
鳥取銀行	1,300	1,398.00	1,817,400
伊予銀行	52,700	623.00	32,832,100
百十四銀行	4,000	2,454.00	9,816,000
四国銀行	5,700	1,030.00	5,871,000
阿波銀行	6,000	3,065.00	18,390,000
大分銀行	2,100	3,350.00	7,035,000
宮崎銀行	2,500	2,697.00	6,742,500
佐賀銀行	2,200	1,806.00	3,973,200
十八銀行	2,300	2,743.00	6,308,900
沖縄銀行	3,600	3,395.00	12,222,000
琉球銀行	8,100	1,163.00	9,420,300
セブン銀行	138,800	342.00	47,469,600
みずほフィナンシャルグループ	5,071,300	176.20	893,563,060
高知銀行	1,300	729.00	947,700
山口フィナンシャルグループ	46,200	1,058.00	48,879,600
芙蓉総合リース	4,200	5,590.00	23,478,000
興銀リース	7,000	2,703.00	18,921,000
東京センチュリー	7,400	5,190.00	38,406,000
SBIホールディングス	44,500	2,307.00	102,661,500
日本証券金融	15,200	624.00	9,484,800
アイフル	62,800	306.00	19,216,800
日本アジア投資	4,000	195.00	780,000
長野銀行	1,200	1,554.00	1,864,800
名古屋銀行	3,000	3,470.00	10,410,000
北洋銀行	56,400	306.00	17,258,400
愛知銀行	1,200	3,430.00	4,116,000
中京銀行	1,500	2,159.00	3,238,500
大光銀行	1,200	1,669.00	2,002,800
愛媛銀行	5,200	1,088.00	5,657,600
トマト銀行	1,400	1,062.00	1,486,800
京葉銀行	16,500	707.00	11,665,500
栃木銀行	19,200	239.00	4,588,800
北日本銀行	1,300	2,099.00	2,728,700
東和銀行	6,500	707.00	4,595,500
福島銀行	3,400	391.00	1,329,400

大東銀行	1,700	626.00	1,064,200
リコーリース	2,900	3,440.00	9,976,000
イオンフィナンシャルサービス	26,300	2,201.00	57,886,300
アコム	74,200	388.00	28,789,600
ジャックス	4,500	1,907.00	8,581,500
オリエントコーポレーション	80,800	117.00	9,453,600
日立キャピタル	10,300	2,542.00	26,182,600
アプラスフィナンシャル	19,900	86.00	1,711,400
オリックス	247,100	1,639.00	404,996,900
三菱UFJリース	93,900	576.00	54,086,400
ジャフコ	5,400	3,950.00	21,330,000
九州リースサービス	1,700	704.00	1,196,800
トモニホールディングス	30,800	403.00	12,412,400
大和証券グループ本社	304,100	579.90	176,347,590
野村ホールディングス	656,800	442.80	290,831,040
岡三証券グループ	32,000	489.00	15,648,000
丸三証券	11,900	817.00	9,722,300
東洋証券	12,900	163.00	2,102,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	41,500	499.00	20,708,500
光世証券	900	756.00	680,400
水戸証券	10,500	265.00	2,782,500
いちよし証券	7,800	874.00	6,817,200
松井証券	18,300	1,195.00	21,868,500
SOMP Oホールディングス	65,900	4,222.00	278,229,800
だいこう証券ビジネス	1,600	432.00	691,200
日本取引所グループ	102,400	1,999.00	204,697,600
マネックスグループ	38,100	436.00	16,611,600
カブドットコム証券	23,800	560.00	13,328,000
極東証券	5,000	1,194.00	5,970,000
岩井コスモホールディングス	3,700	1,266.00	4,684,200
藍澤證券	6,800	699.00	4,753,200
フィデアホールディングス	36,000	132.00	4,752,000
池田泉州ホールディングス	39,700	299.00	11,870,300
アニコム ホールディングス	2,600	2,990.00	7,774,000
M S & A Dインシュアランスグループホール	96,800	3,361.00	325,344,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	30,400	2,122.00	64,508,800
マネーパートナーズグループ	4,400	294.00	1,293,600
小林洋行	1,300	264.00	343,200
第一生命ホールディングス	209,500	1,705.00	357,197,500
東京海上ホールディングス	135,900	5,570.00	756,963,000
アドバンテッジリスクマネジメント	1,100	979.00	1,076,900
イー・ギャランティ	3,900	1,070.00	4,173,000
アサックス	1,800	542.00	975,600
NECキャピタルソリューション	1,500	1,649.00	2,473,500
T & Dホールディングス	114,500	1,374.50	157,380,250
アドバンスクリエイト	800	1,730.00	1,384,000
三井不動産	198,000	2,680.00	530,640,000
三菱地所	263,100	1,914.00	503,573,400
平和不動産	6,600	2,027.00	13,378,200

東京建物	40,400	1,281.00	51,752,400
ダイビル	9,600	1,098.00	10,540,800
京阪神ビルディング	6,100	918.00	5,599,800
住友不動産	84,700	4,252.00	360,144,400
太平洋興発	1,500	782.00	1,173,000
テーオーシー	12,900	786.00	10,139,400
東京楽天地	600	4,635.00	2,781,000
レオパレス21	44,700	205.00	9,163,500
スターツコーポレーション	5,100	2,420.00	12,342,000
フジ住宅	4,600	874.00	4,020,400
空港施設	4,200	545.00	2,289,000
明和地所	2,100	612.00	1,285,200
ゴールドクレスト	2,900	1,609.00	4,666,100
リログループ	19,600	2,973.00	58,270,800
日本エスリード	1,400	1,611.00	2,255,400
日神不動産	4,800	469.00	2,251,200
日本エスコン	6,600	764.00	5,042,400
タカラレーベン	17,300	357.00	6,176,100
サンヨーハウジング名古屋	2,000	943.00	1,886,000
イオンモール	20,200	1,881.00	37,996,200
毎日コムネット	600	773.00	463,800
ファースト住建	1,300	1,235.00	1,605,500
ランド	108,600	8.00	868,800
カチタス	4,300	3,695.00	15,888,500
東祥	2,200	3,500.00	7,700,000
トーセイ	5,100	1,050.00	5,355,000
穴吹興産	500	2,850.00	1,425,000
サンフロンティア不動産	4,400	1,226.00	5,394,400
エフ・ジェー・ネクスト	3,000	887.00	2,661,000
インテリックス	1,300	677.00	880,100
ランドビジネス	1,700	816.00	1,387,200
グランディハウス	3,400	441.00	1,499,400
東武鉄道	39,600	3,130.00	123,948,000
相鉄ホールディングス	12,000	3,335.00	40,020,000
東京急行電鉄	102,000	1,886.00	192,372,000
京浜急行電鉄	51,400	1,860.00	95,604,000
小田急電鉄	60,600	2,540.00	153,924,000
京王電鉄	21,000	6,420.00	134,820,000
京成電鉄	28,400	3,775.00	107,210,000
富士急行	5,200	3,970.00	20,644,000
新京成電鉄	1,000	2,079.00	2,079,000
東日本旅客鉄道	67,300	10,620.00	714,726,000
西日本旅客鉄道	33,700	8,252.00	278,092,400
東海旅客鉄道	33,900	24,835.00	841,906,500
西武ホールディングス	47,800	2,016.00	96,364,800
鴻池運輸	5,300	1,764.00	9,349,200
西日本鉄道	10,500	2,729.00	28,654,500
ハマキョウレックス	2,700	4,250.00	11,475,000
サカイ引越センター	2,000	6,590.00	13,180,000

近鉄グループホールディングス	35,600	4,960.00	176,576,000
阪急阪神ホールディングス	47,400	4,125.00	195,525,000
南海電気鉄道	16,800	2,996.00	50,332,800
京阪ホールディングス	15,800	4,575.00	72,285,000
神戸電鉄	900	3,965.00	3,568,500
名古屋鉄道	28,500	3,030.00	86,355,000
山陽電気鉄道	2,700	2,189.00	5,910,300
トランコム	1,000	6,810.00	6,810,000
日本通運	14,000	7,040.00	98,560,000
ヤマトホールディングス	62,300	2,987.50	186,121,250
山九	10,000	5,490.00	54,900,000
日新	3,100	1,957.00	6,066,700
丸運	2,800	304.00	851,200
丸全昭和運輸	2,500	2,850.00	7,125,000
センコーグループホールディングス	21,600	937.00	20,239,200
トナミホールディングス	900	6,490.00	5,841,000
ニッコンホールディングス	13,500	2,873.00	38,785,500
日本石油輸送	400	2,973.00	1,189,200
福山通運	5,200	4,500.00	23,400,000
セイノーホールディングス	26,600	1,562.00	41,549,200
エスライン	1,100	1,144.00	1,258,400
神奈川中央交通	900	3,745.00	3,370,500
日立物流	7,900	3,265.00	25,793,500
丸和運輸機関	1,900	3,550.00	6,745,000
C & F ロジホールディングス	3,900	1,295.00	5,050,500
日本郵船	29,700	1,794.00	53,281,800
商船三井	22,500	2,649.00	59,602,500
川崎汽船	13,000	1,610.00	20,930,000
N S ユナイテッド海運	1,700	2,637.00	4,482,900
明治海運	3,500	350.00	1,225,000
飯野海運	18,200	397.00	7,225,400
共栄タンカー	300	1,570.00	471,000
九州旅客鉄道	29,800	3,700.00	110,260,000
S G ホールディングス	33,600	3,185.00	107,016,000
日本航空	65,100	4,070.00	264,957,000
A N A ホールディングス	66,300	4,149.00	275,078,700
パスコ	600	922.00	553,200
西本W i s m e t t a c ホールディングス	800	4,410.00	3,528,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	1,199.00	479,600
Genky Drug Stores	1,400	2,612.00	3,656,800
国際紙パルプ商事	7,300	281.00	2,051,300
総合メディカルホールディングス	3,200	1,916.00	6,131,200
ブックオフグループホールディングス	1,900	790.00	1,501,000
三菱倉庫	12,300	2,764.00	33,997,200
三井倉庫ホールディングス	4,100	1,986.00	8,142,600
住友倉庫	12,500	1,446.00	18,075,000
澁澤倉庫	2,100	1,656.00	3,477,600
ヤマタネ	2,000	1,665.00	3,330,000
東陽倉庫	6,900	319.00	2,201,100

乾汽船	2,600	722.00	1,877,200
日本トランスシティ	8,400	443.00	3,721,200
ケイヒン	600	1,396.00	837,600
中央倉庫	2,200	1,055.00	2,321,000
川西倉庫	700	1,212.00	848,400
安田倉庫	3,500	904.00	3,164,000
ファイズ	500	874.00	437,000
東洋埠頭	1,200	1,491.00	1,789,200
宇徳	3,000	547.00	1,641,000
上組	21,900	2,521.00	55,209,900
サンリツ	1,200	705.00	846,000
キムラユニティー	800	1,113.00	890,400
キューソー流通システム	900	2,057.00	1,851,300
近鉄エクスプレス	6,800	1,839.00	12,505,200
東海運	2,700	283.00	764,100
エーアイティー	2,500	1,074.00	2,685,000
内外トランスライン	1,100	1,516.00	1,667,600
日本コンセプト	900	1,049.00	944,100
東京放送ホールディングス	24,600	1,931.00	47,502,600
日本テレビホールディングス	33,800	1,797.00	60,738,600
朝日放送グループホールディングス	3,600	773.00	2,782,800
テレビ朝日ホールディングス	10,200	1,998.00	20,379,600
スカパーJ S A Tホールディングス	28,400	498.00	14,143,200
テレビ東京ホールディングス	3,000	2,494.00	7,482,000
日本BS放送	1,100	1,066.00	1,172,600
ビジョン	1,000	4,750.00	4,750,000
スマートバリュー	800	866.00	692,800
USEN-NEXT HOLDINGS	1,100	941.00	1,035,100
ワイヤレスゲート	2,200	429.00	943,800
コネクシオ	2,600	1,443.00	3,751,800
日本通信	32,600	130.00	4,238,000
クロップス	800	666.00	532,800
日本電信電話	254,600	4,698.00	1,196,110,800
KDDI	327,200	2,718.50	889,493,200
ソフトバンク	295,300	1,350.00	398,655,000
光通信	4,300	20,290.00	87,247,000
NTTドコモ	266,600	2,607.50	695,159,500
エムティーアイ	4,700	630.00	2,961,000
GMOインターネット	13,600	1,825.00	24,820,000
アйдママーケティングコミュニケーション	500	506.00	253,000
カドカワ	10,800	1,120.00	12,096,000
学研ホールディングス	1,200	5,370.00	6,444,000
ゼンリン	6,700	3,125.00	20,937,500
昭文社	1,500	490.00	735,000
インプレスホールディングス	3,200	156.00	499,200
東京電力ホールディングス	299,700	670.00	200,799,000
中部電力	114,900	1,774.50	203,890,050
関西電力	153,200	1,659.00	254,158,800
中国電力	51,900	1,471.00	76,344,900

北陸電力	36,700	928.00	34,057,600
東北電力	87,900	1,488.00	130,795,200
四国電力	33,800	1,442.00	48,739,600
九州電力	82,900	1,337.00	110,837,300
北海道電力	38,100	817.00	31,127,700
沖縄電力	7,700	2,064.00	15,892,800
電源開発	29,900	2,827.00	84,527,300
エフオン	2,200	839.00	1,845,800
イーレックス	5,800	857.00	4,970,600
レノバ	3,800	1,075.00	4,085,000
東京瓦斯	75,300	3,060.00	230,418,000
大阪瓦斯	72,800	2,258.00	164,382,400
東邦瓦斯	18,600	4,955.00	92,163,000
北海道瓦斯	2,200	1,459.00	3,209,800
広島ガス	7,600	345.00	2,622,000
西部瓦斯	4,600	2,502.00	11,509,200
静岡ガス	11,500	905.00	10,407,500
メタウォーター	2,100	3,105.00	6,520,500
アイネット	2,300	1,413.00	3,249,900
松竹	2,400	11,430.00	27,432,000
東宝	24,200	4,045.00	97,889,000
エイチ・アイ・エス	6,400	4,295.00	27,488,000
東映	1,400	13,500.00	18,900,000
ラックランド	800	1,919.00	1,535,200
エヌ・ティ・ティ・データ	101,000	1,217.00	122,917,000
共立メンテナンス	6,400	5,350.00	34,240,000
イチネンホールディングス	4,000	1,341.00	5,364,000
建設技術研究所	2,700	1,508.00	4,071,600
スペース	2,500	1,345.00	3,362,500
長大	1,000	803.00	803,000
アインホールディングス	5,000	7,460.00	37,300,000
燦ホールディングス	900	2,531.00	2,277,900
ビー・シー・エー	500	2,347.00	1,173,500
スバル興業	300	5,900.00	1,770,000
東京テアトル	1,600	1,294.00	2,070,400
タナベ経営	700	1,225.00	857,500
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,155.00	1,508,500
ナガワ	700	5,550.00	3,885,000
よみうりランド	800	4,270.00	3,416,000
東京都競馬	2,400	3,570.00	8,568,000
常磐興産	1,400	1,602.00	2,242,800
カナモト	5,100	2,911.00	14,846,100
東京ドーム	14,700	984.00	14,464,800
D T S	3,900	4,090.00	15,951,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	17,100	3,170.00	54,207,000
シーイーシー	4,400	2,313.00	10,177,200
カプコン	15,800	2,239.00	35,376,200
西尾レントオール	3,600	3,395.00	12,222,000
アイ・エス・ビー	700	2,207.00	1,544,900

アゴラ・ホスピタリティー・グループ	29,000	29.00	841,000
日本空港ビルデング	11,900	4,335.00	51,586,500
トランス・コスモス	4,000	2,184.00	8,736,000
乃村工藝社	8,500	3,265.00	27,752,500
ジャステック	2,200	979.00	2,153,800
S C S K	9,800	4,860.00	47,628,000
藤田観光	1,400	2,674.00	3,743,600
K N T - C Tホールディングス	2,200	1,300.00	2,860,000
日本管財	3,900	1,909.00	7,445,100
トーカイ	3,500	2,839.00	9,936,500
白洋舎	400	2,894.00	1,157,600
セコム	38,100	9,519.00	362,673,900
日本システムウエア	1,400	1,978.00	2,769,200
セントラル警備保障	1,700	4,360.00	7,412,000
アイネス	4,700	1,309.00	6,152,300
丹青社	7,400	1,265.00	9,361,000
メイテック	4,200	5,000.00	21,000,000
T K C	3,100	3,785.00	11,733,500
富士ソフト	5,500	4,515.00	24,832,500
応用地質	3,900	1,162.00	4,531,800
船井総研ホールディングス	7,500	2,514.00	18,855,000
N S D	6,100	2,481.00	15,134,100
進学会ホールディングス	1,400	547.00	765,800
丸紅建材リース	400	2,035.00	814,000
オオバ	3,000	622.00	1,866,000
コナミホールディングス	15,000	4,455.00	66,825,000
いであ	800	985.00	788,000
学究社	900	1,360.00	1,224,000
ベネッセホールディングス	13,100	3,095.00	40,544,500
イオンディライト	4,500	4,095.00	18,427,500
ナック	2,400	1,048.00	2,515,200
福井コンピュータホールディングス	1,000	1,935.00	1,935,000
ニチイ学館	6,800	1,260.00	8,568,000
ダイセキ	6,100	2,652.00	16,177,200
ステップ	1,400	1,432.00	2,004,800
日鉄住金物産	2,900	4,755.00	13,789,500
泉州電業	1,300	2,688.00	3,494,400
元気寿司	900	3,870.00	3,483,000
トラスコ中山	7,800	3,110.00	24,258,000
ヤマダ電機	126,300	533.00	67,317,900
オートバックスセブン	14,900	1,854.00	27,624,600
モリト	2,600	788.00	2,048,800
アークランドサカモト	6,300	1,444.00	9,097,200
ニトリホールディングス	16,100	14,050.00	226,205,000
グルメ杵屋	2,600	1,179.00	3,065,400
愛眼	3,800	312.00	1,185,600
ケーユーホールディングス	1,900	846.00	1,607,400
吉野家ホールディングス	12,300	1,854.00	22,804,200
加藤産業	5,800	3,675.00	21,315,000

北恵	700	939.00	657,300
イノテック	3,100	1,054.00	3,267,400
イエローハット	3,500	2,936.00	10,276,000
松屋フーズホールディングス	1,800	3,685.00	6,633,000
JBCホールディングス	2,800	1,637.00	4,583,600
JKホールディングス	3,700	602.00	2,227,400
サガミホールディングス	4,900	1,367.00	6,698,300
日伝	3,100	1,557.00	4,826,700
関西スーパーマーケット	3,100	1,006.00	3,118,600
ミロク情報サービス	3,300	2,818.00	9,299,400
北沢産業	4,000	260.00	1,040,000
杉本商事	1,900	1,775.00	3,372,500
因幡電機産業	4,900	4,520.00	22,148,000
王将フードサービス	2,700	7,380.00	19,926,000
プレナス	4,200	1,804.00	7,576,800
ミニストップ	2,700	1,917.00	5,175,900
アークス	7,000	2,565.00	17,955,000
パローホールディングス	8,700	2,737.00	23,811,900
パイテックホールディングス	1,800	2,034.00	3,661,200
東テック	1,200	2,281.00	2,737,200
ミスミグループ本社	46,600	2,756.00	128,429,600
藤久	500	745.00	372,500
アルテック	2,400	229.00	549,600
ベルク	1,700	5,070.00	8,619,000
大庄	2,000	1,563.00	3,126,000
タキヒヨー	1,400	1,816.00	2,542,400
ファーストリテイリング	5,000	50,340.00	251,700,000
ソフトバンクグループ	155,500	10,400.00	1,617,200,000
蔵王産業	600	1,324.00	794,400
スズケン	16,900	6,010.00	101,569,000
サンドラッグ	13,900	3,490.00	48,511,000
サックスパーホールディングス	3,800	1,116.00	4,240,800
ジェコス	2,500	1,068.00	2,670,000
ヤマザワ	700	1,786.00	1,250,200
やまや	800	2,401.00	1,920,800
ルネサスイーストン	3,200	447.00	1,430,400
ベルーナ	9,100	909.00	8,271,900
合計	43,982,600		87,254,422,410

## 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	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		256,551	6,348,210
コール・ローン		1,099,911,629	765,794,398
国債証券		101,557,895,400	126,300,082,900
地方債証券		7,852,188,373	9,741,616,281
特殊債券		11,175,213,696	13,775,783,507
社債券		5,320,964,000	5,250,780,400
未収入金		103,881,000	
未収利息		413,691,176	425,665,291
前払費用		4,375,269	4,497,000
流動資産合計		127,528,377,094	156,270,567,987
資産合計		127,528,377,094	156,270,567,987
負債の部			
流動負債			
未払金			355,226,000
未払解約金		1,382,979,965	26,530,212
未払利息		2,695	1,953
その他未払費用		95	1,342
流動負債合計		1,382,982,755	381,759,507
負債合計		1,382,982,755	381,759,507
純資産の部			
元本等			
元本	1	99,715,707,801	121,137,400,893
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		26,429,686,538	34,751,407,587
元本等合計		126,145,394,339	155,888,808,480
純資産合計		126,145,394,339	155,888,808,480
負債純資産合計		127,528,377,094	156,270,567,987

(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、当ファンドの計算期間と異なります。

## (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、特殊債券、社債券</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>
-------------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	（2018年 2月20日現在）	（2019年 2月20日現在）
1 期首元本額	103,517,691,052円	99,715,707,801円
期中追加設定元本額	17,732,273,109円	55,349,194,064円
期中一部解約元本額	21,534,256,360円	33,927,500,972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）	1,006,162,896円	1,020,195,393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＞	3,586,235,380円	3,615,695,748円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	30,849,977円	21,900,440円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	1,035,255,293円	663,477,977円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	702,802円	437,092円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	24,790,746円	13,505,890円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	36,860,650円	29,841,502円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	17,765,699,391円	14,495,610,506円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	23,622,178円	12,865,543円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	8,233,886,115円	6,841,375,099円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	2,831,356,862円	2,419,966,112円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	22,020,887円	15,921,237円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	701,164,753円	474,719,901円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	3,198,327,242円	2,221,078,550円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,392,818,592円	939,989,765円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	9,042,112,542円	7,361,808,915円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	456,552,345円	188,030,514円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	3,172,360,950円	578,297,898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＞	202,188,099円	155,553,273円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	83,056,159円	70,703,672円

グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	43,638,123円	39,696,976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>	5,002,950,387円	6,792,854,941円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	60,756,589円	49,375,605円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	4,497,224,939円	3,874,480,652円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	38,652,737円	28,932,161円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	14,497,941円	13,388,464円
バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	1,516,511,445円	1,436,495,240円
日本債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	11,116,788,105円	7,123,113,299円
日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	2,179,184,462円	1,810,746,155円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	3,430,130,927円	3,001,698,395円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	13,002,151,756円	11,140,648,736円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	16,277,413円	15,375,763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>	722,236,665円	401,942,513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>	483,217,779円	935,906,250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>	212,258,461円	355,242,299円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,085,186,725円	1,536,983,302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>	円	37,553,578,731円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	186,963,923円	5,252,354円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	2,736,358,134円	2,310,346,637円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	146,428,074円	118,121,700円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	48,933,976円	44,733,785円
ワールドバランスVA0809<適格機関投資家限定>	230,170,765円	円
ワールドバランスVA0902<適格機関投資家限定>	99,164,616円	89,088,574円
世界株式VCファンド<適格機関投資家限定>	円	1,318,423,334円
計	99,715,707,801円	121,137,400,893円

2 受益権の総数	99,715,707,801口	121,137,400,893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	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。
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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	(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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左
	(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(3)デリバティブ取引 同左
	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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	449,430,000	945,190,300
地方債証券	52,822,476	4,122,583
特殊債券	61,945,875	2,697,583
社債券	38,152,200	9,510,600
合計	602,350,551	942,499,866

(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)

	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	1.2651円	1.2869円
(1万口当たり純資産額)	(12,651円)	(12,869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
----	----	---------	--------	----

第100回利付国債(20年)	200,000,000	241,678,000	
第101回利付国債(20年)	100,000,000	122,668,000	
第102回利付国債(20年)	200,000,000	246,256,000	
第103回利付国債(20年)	200,000,000	244,380,000	
第104回利付国債(20年)	150,000,000	180,469,500	
第105回利付国債(20年)	100,000,000	120,750,000	
第106回利付国債(20年)	200,000,000	243,424,000	
第107回利付国債(20年)	200,000,000	242,226,000	
第108回利付国債(20年)	100,000,000	119,140,000	
第109回利付国債(20年)	200,000,000	239,002,000	
第10回利付国債(40年)	100,000,000	108,125,000	
第110回利付国債(20年)	200,000,000	243,044,000	
第111回利付国債(20年)	200,000,000	245,942,000	
第112回利付国債(20年)	200,000,000	243,872,000	
第113回利付国債(20年)	200,000,000	244,556,000	
第114回利付国債(20年)	300,000,000	368,013,000	
第115回利付国債(20年)	600,000,000	742,518,000	
第116回利付国債(20年)	500,000,000	620,780,000	
第118回利付国債(20年)	300,000,000	366,915,000	
第11回利付国債(40年)	120,000,000	125,413,200	
第122回利付国債(20年)	500,000,000	601,415,000	
第123回利付国債(20年)	640,000,000	794,259,200	
第124回利付国債(5年)	500,000,000	501,925,000	
第125回利付国債(5年)	500,000,000	502,255,000	
第126回利付国債(20年)	600,000,000	739,530,000	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	488,224,000	
第128回利付国債(20年)	700,000,000	856,541,000	
第128回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,006,650,000	
第129回利付国債(5年)	1,750,000,000	1,762,915,000	
第12回利付国債(30年)	300,000,000	382,908,000	
第130回利付国債(20年)	400,000,000	485,372,000	
第130回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,209,720,000	
第131回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,118,501,000	
第132回利付国債(20年)	400,000,000	481,360,000	
第132回利付国債(5年)	2,000,000,000	2,019,060,000	
第133回利付国債(20年)	300,000,000	364,821,000	
第133回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,515,660,000	
第134回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,516,770,000	
第135回利付国債(20年)	300,000,000	361,710,000	
第135回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,922,211,000	
第136回利付国債(20年)	200,000,000	238,560,000	
第136回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,721,114,000	
第137回利付国債(20年)	100,000,000	120,802,000	
第137回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,570,382,500	
第139回利付国債(20年)	200,000,000	238,980,000	
第13回利付国債(30年)	300,000,000	379,398,000	
第140回利付国債(20年)	200,000,000	242,056,000	
第141回利付国債(20年)	200,000,000	242,486,000	
第142回利付国債(20年)	300,000,000	367,800,000	

国債証券	第143回利付国債(20年)	300,000,000	360,204,000	
	第144回利付国債(20年)	200,000,000	237,376,000	
	第145回利付国債(20年)	350,000,000	425,782,000	
	第146回利付国債(20年)	220,000,000	268,072,200	
	第147回利付国債(20年)	860,000,000	1,037,108,400	
	第148回利付国債(20年)	500,000,000	595,985,000	
	第149回利付国債(20年)	680,000,000	811,450,800	
	第14回利付国債(30年)	300,000,000	397,740,000	
	第150回利付国債(20年)	670,000,000	790,265,000	
	第151回利付国債(20年)	600,000,000	689,406,000	
	第152回利付国債(20年)	650,000,000	747,149,000	
	第153回利付国債(20年)	750,000,000	874,207,500	
	第154回利付国債(20年)	640,000,000	736,192,000	
	第155回利付国債(20年)	500,000,000	558,750,000	
	第156回利付国債(20年)	550,000,000	559,383,000	
	第157回利付国債(20年)	400,000,000	392,764,000	
	第158回利付国債(20年)	500,000,000	515,835,000	
	第159回利付国債(20年)	400,000,000	418,888,000	
	第15回利付国債(30年)	200,000,000	268,802,000	
	第160回利付国債(20年)	350,000,000	372,403,500	
	第161回利付国債(20年)	350,000,000	365,697,500	
	第162回利付国債(20年)	100,000,000	104,360,000	
	第163回利付国債(20年)	500,000,000	521,155,000	
	第164回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,042,695,000	
	第165回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,020,680,000	
	第166回利付国債(20年)	410,000,000	433,509,400	
	第167回利付国債(20年)	300,000,000	305,229,000	
	第16回利付国債(30年)	200,000,000	269,494,000	
	第17回利付国債(30年)	200,000,000	267,092,000	
	第18回利付国債(30年)	300,000,000	396,873,000	
	第19回利付国債(30年)	200,000,000	265,142,000	
	第1回利付国債(30年)	300,000,000	388,239,000	
	第1回利付国債(40年)	160,000,000	238,072,000	
	第20回利付国債(30年)	100,000,000	136,032,000	
	第21回利付国債(30年)	200,000,000	266,206,000	
	第22回利付国債(30年)	200,000,000	273,240,000	
	第23回利付国債(30年)	100,000,000	136,910,000	
	第24回利付国債(30年)	320,000,000	439,382,400	
	第25回利付国債(30年)	100,000,000	134,185,000	
	第26回利付国債(30年)	150,000,000	204,354,000	
	第27回利付国債(30年)	320,000,000	443,104,000	
	第28回利付国債(30年)	300,000,000	417,192,000	
	第29回利付国債(30年)	200,000,000	275,374,000	
	第2回利付国債(30年)	380,000,000	479,765,200	
	第2回利付国債(40年)	500,000,000	721,270,000	
	第306回利付国債(10年)	200,000,000	203,422,000	
	第308回利付国債(10年)	700,000,000	713,811,000	
	第309回利付国債(10年)	800,000,000	813,664,000	
	第30回利付国債(30年)	350,000,000	477,113,000	

第310回利付国債(10年)	900,000,000	916,875,000	
第311回利付国債(10年)	600,000,000	609,348,000	
第312回利付国債(10年)	800,000,000	820,312,000	
第313回利付国債(10年)	700,000,000	721,637,000	
第314回利付国債(10年)	900,000,000	924,075,000	
第315回利付国債(10年)	750,000,000	774,262,500	
第316回利付国債(10年)	500,000,000	515,005,000	
第317回利付国債(10年)	600,000,000	619,968,000	
第318回利付国債(10年)	250,000,000	257,672,500	
第319回利付国債(10年)	300,000,000	310,956,000	
第31回利付国債(30年)	400,000,000	539,456,000	
第320回利付国債(10年)	700,000,000	723,576,000	
第321回利付国債(10年)	300,000,000	310,989,000	
第322回利付国債(10年)	700,000,000	723,478,000	
第323回利付国債(10年)	200,000,000	207,262,000	
第324回利付国債(10年)	400,000,000	413,184,000	
第325回利付国債(10年)	500,000,000	517,735,000	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	310,233,000	
第327回利付国債(10年)	700,000,000	726,572,000	
第328回利付国債(10年)	500,000,000	516,005,000	
第329回利付国債(10年)	500,000,000	521,360,000	
第32回利付国債(30年)	430,000,000	590,510,400	
第330回利付国債(10年)	800,000,000	836,184,000	
第331回利付国債(10年)	500,000,000	518,000,000	
第332回利付国債(10年)	600,000,000	622,788,000	
第333回利付国債(10年)	900,000,000	935,946,000	
第334回利付国債(10年)	700,000,000	729,358,000	
第335回利付国債(10年)	800,000,000	830,648,000	
第336回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,040,040,000	
第337回利付国債(10年)	700,000,000	719,782,000	
第338回利付国債(10年)	650,000,000	672,945,000	
第339回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,244,136,000	
第33回利付国債(30年)	500,000,000	658,905,000	
第340回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,432,798,800	
第341回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,239,384,000	
第342回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,121,659,000	
第343回利付国債(10年)	900,000,000	918,018,000	
第344回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,224,396,000	
第345回利付国債(10年)	1,040,000,000	1,061,008,000	
第346回利付国債(10年)	900,000,000	918,009,000	
第347回利付国債(10年)	750,000,000	764,512,500	
第348回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,120,482,000	
第349回利付国債(10年)	960,000,000	977,097,600	
第34回利付国債(30年)	550,000,000	750,040,500	
第350回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,433,843,100	
第351回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,422,330,000	
第352回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,278,799,200	
第353回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,064,500,500	
第35回利付国債(30年)	450,000,000	596,623,500	

第36回利付国債(30年)	420,000,000	558,999,000	
第37回利付国債(30年)	430,000,000	564,710,400	
第388回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,806,516,000	
第38回利付国債(30年)	500,000,000	647,315,000	
第392回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,314,388,000	
第394回利付国債(2年)	200,000,000	200,968,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	435,392,100	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	376,716,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	363,327,500	
第40回利付国債(30年)	280,000,000	363,652,800	
第41回利付国債(30年)	350,000,000	447,202,000	
第42回利付国債(30年)	410,000,000	524,291,600	
第43回利付国債(30年)	650,000,000	832,825,500	
第44回利付国債(30年)	300,000,000	384,693,000	
第45回利付国債(20年)	650,000,000	668,115,500	
第45回利付国債(30年)	240,000,000	296,592,000	
第46回利付国債(30年)	400,000,000	495,120,000	
第47回利付国債(20年)	600,000,000	622,686,000	
第47回利付国債(30年)	380,000,000	480,031,200	
第48回利付国債(20年)	300,000,000	314,790,000	
第48回利付国債(30年)	200,000,000	243,084,000	
第49回利付国債(20年)	100,000,000	104,769,000	
第49回利付国債(30年)	250,000,000	303,940,000	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	365,957,500	
第50回利付国債(20年)	50,000,000	52,176,000	
第50回利付国債(30年)	350,000,000	372,813,000	
第51回利付国債(20年)	350,000,000	367,843,000	
第51回利付国債(30年)	450,000,000	421,771,500	
第52回利付国債(20年)	100,000,000	105,925,000	
第52回利付国債(30年)	400,000,000	394,736,000	
第53回利付国債(30年)	400,000,000	404,824,000	
第54回利付国債(30年)	410,000,000	435,985,800	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	533,805,000	
第55回利付国債(30年)	390,000,000	414,402,300	
第56回利付国債(30年)	220,000,000	233,582,800	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	855,816,000	
第57回利付国債(30年)	240,000,000	254,611,200	
第58回利付国債(30年)	620,000,000	657,200,000	
第59回利付国債(30年)	550,000,000	567,963,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	125,928,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	183,777,100	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	742,623,000	
第60回利付国債(30年)	310,000,000	336,743,700	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	366,947,000	
第61回利付国債(30年)	80,000,000	82,440,800	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	543,160,000	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	440,408,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	560,790,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	334,938,000	

第6回利付国債(30年)	180,000,000	232,392,600	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	208,708,500	
第70回利付国債(20年)	600,000,000	683,058,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	676,890,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	340,179,000	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	225,408,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	339,954,000	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	283,092,500	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	385,743,000	
第7回利付国債(40年)	160,000,000	213,784,000	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	114,516,000	
第81回利付国債(20年)	200,000,000	228,870,000	
第83回利付国債(20年)	300,000,000	346,920,000	
第85回利付国債(20年)	200,000,000	232,422,000	
第88回利付国債(20年)	400,000,000	472,940,000	
第89回利付国債(20年)	400,000,000	469,976,000	
第8回利付国債(30年)	300,000,000	367,680,000	
第8回利付国債(40年)	50,000,000	62,231,000	
第90回利付国債(20年)	300,000,000	354,174,000	
第91回利付国債(20年)	300,000,000	356,475,000	
第92回利付国債(20年)	340,000,000	400,431,600	
第93回利付国債(20年)	300,000,000	352,281,000	
第94回利付国債(20年)	300,000,000	354,732,000	
第95回利付国債(20年)	150,000,000	180,528,000	
第96回利付国債(20年)	100,000,000	118,670,000	
第97回利付国債(20年)	150,000,000	180,006,000	
第98回利付国債(20年)	100,000,000	119,138,000	
第99回利付国債(20年)	200,000,000	239,078,000	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	117,171,000	
第9回利付国債(40年)	1,700,000,000	1,559,053,000	
国債証券 小計	115,240,000,000	126,300,082,900	

第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,885,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,587,000	
第10回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	121,042,000	
第10回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	119,064,000	
第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,903,000	
第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,865,000	
第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,126,000	
第11回川崎市公募公債(30年)	100,000,000	103,711,000	
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	102,829,000	
第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,339,000	
第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,491,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,643,000	
第135回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,291,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,200,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,998,000	
第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,510,000	
第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,344,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,325,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,429,000	
第188回神奈川県公募公債	100,000,000	103,161,000	
第24回千葉県公募公債	100,000,000	101,745,000	
第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,135,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	133,942,000	
第30回2号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	102,894,000	
第323回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	40,010,800	
第324回大阪府公募公債(10年)	8,000,000	8,013,040	
第325回大阪府公募公債(10年)	6,000,000	6,017,460	
第326回大阪府公募公債(10年)	56,000,000	56,243,040	
第346回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,371,000	
第368回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,150,000	
第36回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	102,241,000	
第374回大阪府公募公債(10年)	134,000,000	139,385,460	
第387回大阪府公募公債(10年)	44,040,000	45,229,080	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	136,831,000	
第3回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,665,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,733,000	
第468回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,798,000	
第480回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,880,000	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	135,150,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,228,000	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	122,492,000	
第6回京都市公募公債(20年)	100,000,000	119,987,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,012,000	
第739回東京都公募公債	100,000,000	101,572,000	
第746回東京都公募公債	100,000,000	103,027,000	

地方債証券	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,386,000	
	第759回東京都公募公債	200,000,000	200,906,000	
	第762回東京都公募公債	100,000,000	101,250,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,572,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	101,371,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,052,000	
	第82回川崎市公募公債	30,000,000	30,262,200	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,445,000	
	第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,489,000	
	第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,671,000	
	第90回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,761,000	
	第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,663,000	
	平成21年度第1回埼玉県公募公債	20,000,000	20,051,400	
	平成21年度第1回千葉県公募公債	40,000,000	40,106,000	
	平成21年度第2回熊本県公募公債 (10年)	10,000,000	10,092,100	
	平成21年度第2回広島県公募公債	16,160,000	16,258,414	
	平成21年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,117,800	
	平成21年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	100,560,000	
	平成21年度第2回千葉県公募公債	40,000,000	40,158,400	
	平成21年度第3回埼玉県公募公債	20,000,000	20,111,400	
	平成21年度第6回北海道公募公債	60,000,000	60,489,000	
	平成21年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,153,000	
	平成22年度第1回静岡市公募公債	12,000,000	12,209,760	
	平成22年度第3回京都府公募公債 (20年)	100,000,000	120,743,000	
	平成23年度第2回北九州市公募公債	11,000,000	11,324,170	
	平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	102,640,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債 (10年)	100,000,000	102,985,000	
	平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,132,000	
	平成24年度第12回愛知県公募公債 (30年)	10,000,000	13,166,000	
	平成24年度第14回愛知県公募公債 (15年)	100,000,000	111,037,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,271,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	102,867,000	
	平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,092,000	
	平成24年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,914,000	
	平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	30,858,600	
	平成24年度第8回愛知県公募公債 (10年)	100,000,000	102,867,000	
	平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	30,814,500	
	平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	102,695,000	
	平成24年度第9回北海道公募公債	7,400,000	7,607,422	
	平成25年度第1回岡山県公募公債 (10年)	100,000,000	103,606,000	
平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,350,000		
	100,000,000	103,722,000		

平成25年度第6回愛知県公募公債 (10年)			
平成26年度第1回広島県公募公債 (20年)	100,000,000	115,472,000	
平成26年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	103,206,000	
平成26年度第9回静岡県公募公債	20,000,000	20,604,600	
平成27年度第13回北海道公募公債	100,000,000	102,998,000	
平成27年度第1回岡山県公募公債 (10年)	100,000,000	102,598,000	
平成27年度第4回札幌市公募公債 (10年)	100,000,000	103,097,000	
平成27年度第9回北海道公募公債	100,000,000	103,040,000	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,434,000	
平成28年度第5回広島市公募公債	100,000,000	101,801,000	
平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,252,000	
平成29年度第1回秋田県公募公債	145,900,000	147,745,635	
平成29年度第22回兵庫県公募公債	100,000,000	101,063,000	
平成29年度第3回札幌市公募公債 (10年)	100,000,000	101,702,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,372,000	
平成29年度第5回広島県公募公債	100,000,000	101,733,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債 (10年)	100,000,000	101,597,000	
平成29年度第8回愛知県公募公債 (10年)	100,000,000	101,359,000	
平成30年度第2回福岡県公募公債 (15年)	100,000,000	103,714,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債 (30年)	100,000,000	102,506,000	
地方債証券 小計	9,200,500,000	9,741,616,281	

F 1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,550,000	
F 1 8 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,978,000	
い第 7 7 2 号農林債	100,000,000	100,141,000	
い第 7 8 7 号農林債	200,000,000	200,828,000	
第 1 0 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,919,000	81,024,072	
第 1 0 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,450,000	
第 1 0 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,639,000	86,247,141	
第 1 0 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,147,000	
第 1 0 回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	121,383,000	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,800,000	91,762,480	
第 1 1 8 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,175,000	
第 1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,261,000	93,524,975	
第 1 1 回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,605,000	
第 1 1 回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	102,683,000	
第 1 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,821,000	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,663,000	95,723,225	
第 1 2 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,243,000	
第 1 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,115,000	
第 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,914,000	97,819,176	
第 1 3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,682,000	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,250,000	99,126,390	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,751,000	100,238,190	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,203,000	100,928,140	
第 1 3 回沖縄振興開発金融公庫債券	10,000,000	10,053,700	
第 1 3 回公営企業債券（20年）	10,000,000	11,341,800	
第 1 4 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,489,000	
第 1 4 9 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,336,000	
第 1 4 回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	123,125,000	
第 1 5 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,247,000	

特殊債券	第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,594,000	20,174,962	
	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	117,289,000	
	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	128,506,000	
	第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,779,000	20,405,994	
	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	102,906,000	
	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	102,456,000	
	第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,915,000	
	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	105,673,000	
	第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,975,000	20,544,087	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,988,000	
	第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,235,000	
	第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,426,000	40,478,674	
	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	1,039,040	
	第203回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,323,000	
	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	103,416,000	
	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	103,588,000	
	第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	119,054,000	
	第215回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,137,000	
	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	2,074,260	
	第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	103,012,000	
	第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,664,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	148,297,000	
	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	103,123,000	
	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	13,389,480	
	第23回国際協力銀行債券	100,000,000	113,957,000	
	第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	220,000,000	262,449,000	
	第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,893,000	

第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,988,000	56,556,705	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	20,000,000	20,025,200	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,082,000	
第26回日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	13,840,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,596,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,454,000	31,693,387	
第28回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	114,604,000	
第28回道路債券	200,000,000	271,258,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	200,000,000	203,402,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,517,000	14,990,980	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,018,000	34,492,671	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,423,000	
第2回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	26,974,000	27,753,548	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,950,000	34,707,882	
第300回信金中金債(5年)	100,000,000	100,165,000	
第303回信金中金債(5年)	100,000,000	100,245,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,818,000	
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	74,000,000	76,116,400	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,541,000	33,948,209	
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	101,328,000	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,451,500	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,460,000	34,848,406	
第321回信金中金債(5年)	100,000,000	99,965,000	
第326回信金中金債(5年)	100,000,000	100,014,000	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,138,000	33,319,528	
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	102,099,000	
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	102,463,000	
第338回信金中金債(5年)	100,000,000	100,176,000	

第340回政府保証道路債券	100,000,000	102,072,000	
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	13,183,560	
第342回東京交通債券	30,000,000	32,355,300	
第343回信金中金債(5年)	100,000,000	100,173,000	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,136,000	18,959,374	
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	102,682,000	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,662,000	36,878,634	
第36回中日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	100,000,000	102,663,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,125,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,326,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,296,000	15,912,887	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,469,000	39,674,050	
第39回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,575,000	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,779,000	38,794,489	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	235,064,000	
第3回都市再生債券	100,000,000	115,141,000	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,089,000	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,521,000	49,206,192	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,080,000	95,906,374	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,438,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,490,000	40,034,071	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	33,000,000	33,958,980	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,444,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,520,000	
第4回公営企業債券(30年)	100,000,000	137,661,000	
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	108,082,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,581,000	
第55回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	100,121,000	

第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,364,000	52,303,626	
第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,428,000	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	119,152,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,707,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,194,000	53,053,050	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,668,000	
第66回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,106,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,765,000	56,293,567	
第68回政府保証地方公共団体金融機構債券	14,000,000	14,302,960	
第68回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,981,000	
第68回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,025,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,445,000	58,530,514	
第6回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,622,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,254,000	14,965,702	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,072,000	21,284,195	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,406,000	51,969,183	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,525,000	49,581,406	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,085,000	
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	101,336,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,273,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,804,000	53,043,948	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	112,841,000	
第7回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,439,000	
第7回道路債券	50,000,000	54,421,500	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,050,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	66,000,000	66,279,840	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,255,000	56,685,624	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,798,000	

第 8 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	100,543,000	
第 8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,459,000	
第 8 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,268,000	
第 8 回公営企業債券(30年)	10,000,000	13,285,600	
第 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,008,000	17,848,025	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,979,000	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,672,000	80,013,810	
第 9 6 回都市再生債券	100,000,000	103,164,000	
第 9 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,502,000	
第 9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,728,000	
第 9 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,276,000	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,658,000	
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	104,084,000	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	29,888,000	31,359,087	
第 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,648,000	18,611,757	
特殊債券 小計	12,809,947,000	13,775,783,507	

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	230,912,000	
	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	100,037,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	106,070,000	
	第11回電源開発	100,000,000	110,756,000	
	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	101,797,000	
	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	100,368,000	
	第13回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	117,131,000	
	第14回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2017)	100,000,000	99,743,000	
	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	103,609,000	
	第14回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	100,000,000	100,206,000	
	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	100,493,000	
	第17回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,578,000	
	第18回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2018)	100,000,000	99,416,000	
	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	100,381,000	
	第20回大阪瓦斯	100,000,000	102,835,000	
	第245回四国電力	100,000,000	104,549,000	
	第25回日本郵船	100,000,000	114,465,000	
	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	103,604,000	
	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	100,518,000	
	第28回東京瓦斯	100,000,000	117,910,000	
	第298回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,744,000	
	第323回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,738,000	
	第32回東日本旅客鉄道	100,000,000	111,100,000	
	第350回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,161,000	
	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	100,629,000	
	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	102,251,000	
	第3回富士フイ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	102,977,000	
	第400回九州電力	100,000,000	102,042,000	
	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	121,331,000	

第473回関西電力	100,000,000	100,301,000	
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	133,099,000	
第4回ヒューリック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,053,000	
第4回東京地下鉄	10,000,000	11,662,400	
第506回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,947,000	
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	100,820,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	107,738,000	
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	98,774,000	
第60回トヨタファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同等)	100,000,000	100,071,000	
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	102,582,000	
第65回三菱地所	100,000,000	120,378,000	
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	101,730,000	
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	102,048,000	
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	100,504,000	
第7回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2014)	200,000,000	200,298,000	
第7回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,679,000	
第7回三井住友信託銀行株式会社無担保社債(社債間限定同順位特)	100,000,000	100,035,000	
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	100,138,000	
第8回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2014)	100,000,000	100,190,000	
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	103,382,000	
社債券 小計	5,010,000,000	5,250,780,400	
合計	142,260,447,000	155,068,263,088	

## 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	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		892,829,658	566,996,968
金銭信託			11,241,281
コール・ローン		4,530,697,273	1,412,354,372
株式		153,042,430,168	144,448,525,789
投資証券		3,623,186,283	3,851,568,208
派生商品評価勘定		99,391,487	118,424,625
未収入金		1,439,634	2,197,698
未収配当金		209,561,993	186,951,328
差入委託証拠金		895,040,069	667,590,932
流動資産合計		163,294,576,565	151,265,851,201
資産合計		163,294,576,565	151,265,851,201
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		140,780,253	1,927,395
未払解約金		1,928,780,000	215,519,000
未払利息		11,103	3,602
その他未払費用		226	1,705
流動負債合計		2,069,571,582	217,451,702
負債合計		2,069,571,582	217,451,702
純資産の部			
元本等			
元本	1	64,427,801,459	57,955,317,361
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		96,797,203,524	93,093,082,138
元本等合計		161,225,004,983	151,048,399,499
純資産合計		161,225,004,983	151,048,399,499
負債純資産合計		163,294,576,565	151,265,851,201

(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、当ファンドの計算期間と異なります。

## (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、投資証券 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。
-------------------	--

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	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
1 期首元本額	68,935,347,698円	64,427,801,459円
期中追加設定元本額	17,170,143,297円	13,291,705,497円
期中一部解約元本額	21,677,689,536円	19,764,189,595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	6,494,449,767円	6,351,967,197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	6,922,080,519円	6,834,819,365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	47,838,688円	54,493,281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)	80,041,008円	84,890,489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)	1,851,805,206円	1,783,752,639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)	78,138,925円	63,262,650円
バランスファンドVA30A<適格機関 投資家限定>	3,069,980円	2,283,581円
バランスファンドVA30B<適格機関 投資家限定>	225,151,644円	143,505,321円
バランスファンドVA40A<適格機関 投資家限定>	115,660円	75,948円
バランスファンドVA40B<適格機関 投資家限定>	8,195,161円	4,704,169円
バランスファンドVA50A<適格機関 投資家限定>	9,021,973円	7,784,215円
バランスファンドVA50B<適格機関 投資家限定>	8,690,368,318円	7,434,532,177円
バランスファンドVA50C<適格機関 投資家限定>	5,043,713円	3,012,858円
バランスファンドVA25A<適格機関 投資家限定>	994,556,731円	857,697,908円
バランスファンドVA37.5A<適格機 関投資家限定>	795,777,369円	715,814,160円
バランスファンドVA75A<適格機関 投資家限定>	84,795,372円	65,951,557円
4資産バランス20VA<適格機関投資 家限定>	88,342,572円	62,169,274円
4資産バランス40VA<適格機関投資 家限定>	1,074,930,389円	750,531,735円
4資産バランス30VA<適格機関投資 家限定>	300,904,207円	204,167,933円
バランスファンドVA35A<適格機関 投資家限定>	1,882,113,034円	1,593,945,296円
バランスファンドVA40C<適格機関 投資家限定>	154,568,705円	64,403,370円
世界4資産バランスVA45<適格 機関投資家限定>	1,116,819,464円	205,784,567円
グローバル4資産30VA<適格機 関投資家限定>	40,748,257円	36,739,533円
グローバル4資産45VA<適格機 関投資家限定>	42,109,272円	41,602,412円
4資産バランス30VA2<適格機 関投資家限定>	20,404,854円	16,904,300円
バランスファンドVA25B<適格 機関投資家限定>	286,051,192円	254,008,190円
バランスファンドVA20A<適格 機関投資家限定>	1,516,588円	1,163,655円
バランスファンドVA35B<適格 機関投資家限定>	1,424,135円	1,387,236円
バランスファンドVA10A<適格 機関投資家限定>	40,264,929円	41,185,183円
外国株式インデックス・ファンドV A3<適格機関投資家限定>	11,359,065,436円	7,729,137,849円

4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	274,103,762円	252,574,108円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	39,400,756円	34,281,699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>	67,765,689円	30,226,231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>	20,175,459円	26,728,893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	825,789,268円	383,521,283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)	1,576,225,499円	2,550,036,343円
全世界株式インデックス・ファンド	161,689,144円	296,801,828円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	107,730,896円	3,229,393円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	984,258,941円	878,515,606円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	87,852,193円	71,012,688円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	31,471,770円	31,725,349円
ワールドバランスVA0809<適格機関投資家限定>	125,108,928円	円
ワールドバランスVA0902<適格機関投資家限定>	45,206,073円	40,619,126円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	17,381,310,013円	17,944,366,766円
計	64,427,801,459円	57,955,317,361円
2 受益権の総数	64,427,801,459口	57,955,317,361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、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	(2018年 2月20日現在)	(2019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>(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 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>(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>(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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	3,038,445,157	3,113,179,848
投資証券	307,852,333	180,037,043
合計	2,730,592,824	3,293,216,891

(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	(2018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	2,996,885,964		3,037,819,200	40,933,236
	S&P 60	188,467,290		186,174,877	2,292,413
	SPI 200	162,973,666		162,322,169	651,497
	FTSE100INDEX	374,930,412		366,310,915	8,619,497
	FSMI INDEX	178,167,078		172,199,698	5,967,380
	EURO STOXX 50	625,721,337		609,074,310	16,647,027
	合 計	4,527,145,747		4,533,901,169	6,755,422

(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

## (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	(2018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	2,905,918,491		2,857,426,000	48,492,491
	カナダ・ドル	146,977,240		144,449,000	2,528,240
	オーストラリア・ドル	118,633,442		117,468,900	1,164,542
	イギリス・ポンド	322,542,780		318,222,000	4,320,780
	ユーロ	643,681,359		634,914,500	8,766,859
	売建				
	アメリカ・ドル	1,109,533,395		1,099,010,000	10,523,395
	カナダ・ドル	49,104,330		48,432,900	671,430
	オーストラリア・ドル	48,783,143		48,170,700	612,443
	イギリス・ポンド	97,315,896		95,616,000	1,699,896
	ユーロ	244,862,560		241,241,000	3,621,560
	合 計	5,687,352,636		5,604,951,000	48,144,188

(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

## (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)

	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	2.5024円	2.6063円
(1万口当たり純資産額)	(25,024円)	(26,063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	ANADARKO PETROLEUM CORP	18,845	45.45	856,505.25
	ANTERO RESOURCES CORP	7,261	9.66	70,141.26
	APACHE CORP	14,039	33.31	467,639.09
	BEAR NEWCO INC-CLASS A	15,549	26.09	405,673.41
	CABOT OIL GAS CORP	17,321	25.18	436,142.78
	CHENIERE ENERGY INC	7,611	66.91	509,252.01
	CHEVRON CORPORATION	70,895	119.31	8,458,482.45
	CIMAREX ENERGY CO	3,800	75.07	285,266.00
	CONCHO RESOURCES INC	7,400	121.00	895,400.00
	CONOCOPHILLIPS	42,906	69.49	2,981,537.94
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,500	44.41	155,435.00
	DEVON ENERGY CORPORATION	19,340	28.31	547,515.40
	DIAMONDBACK ENERGY	5,700	104.80	597,360.00
	ENBRIDGE INC	21,450	36.29	778,420.50
	EOG RESOURCES INC	21,506	99.71	2,144,363.26
	EXXON MOBIL CORPORATION	156,751	78.23	12,262,630.73
	HALLIBURTON CO	33,214	31.70	1,052,883.80
	HELMERICH & PAYNE	4,000	58.05	232,200.00
	HESS CORP	9,800	57.59	564,382.00
	HOLLYFRONTIER CORP	6,343	57.58	365,229.94
	KINDER MORGAN INC	75,272	19.15	1,441,458.80
	MARATHON OIL CORP	32,057	17.03	545,930.71
	MARATHON PETROLEUM CORP	25,430	65.01	1,653,204.30
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	14,331	29.23	418,895.13
	NOBLE ENERGY INC	18,000	23.70	426,600.00
	OCCIDENTAL PETROLEUM	28,502	67.63	1,927,590.26
	ONEOK INC NEW	15,600	68.58	1,069,848.00
	PARSLEY ENERGY A	9,300	18.82	175,026.00
	PHILLIPS 66	16,483	96.75	1,594,730.25
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,324	145.56	920,521.44
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	6,041	24.47	147,823.27
	SCHLUMBERGER LTD	51,562	45.54	2,348,133.48
	TARGA RESOURCES CORP	8,000	47.89	383,120.00
	TECHNIPFMC PLC	9,800	23.95	234,710.00
	VALERO ENERGY CORP	16,103	84.79	1,365,373.37
	WILLIAMS COS	45,141	27.42	1,237,766.22
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	8,147	175.11	1,426,621.17
	ALBEMARLE CORP	4,100	83.13	340,833.00
	AVERY DENNISON CORP	3,257	104.98	341,919.86
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,000	26.76	240,840.00
BALL CORP	11,904	54.06	643,530.24	
CELANESE CORPORATION	5,072	100.95	512,018.40	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,700	42.01	365,487.00	
CHEMOURS CO/THE	7,200	37.60	270,720.00	
CROWN HOLDINGS INC	4,800	53.76	258,048.00	
DOWDUPONT INC	85,405	54.59	4,662,258.95	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,255	82.87	435,481.85	
ECOLAB INC	9,626	167.31	1,610,526.06	

FMC CORP	5,100	86.49	441,099.00
FREEMPORT MCMORAN INC	52,066	13.09	681,543.94
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	2,889	128.11	370,109.79
INT'L PAPER CO	14,790	47.43	701,489.70
LINDE PLC	10,673	167.86	1,791,569.78
LYONDELLBASELL INDU CL A	12,145	87.48	1,062,444.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,400	189.01	453,624.00
MOSAIC CO/THE	13,401	32.28	432,584.28
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	20,647	34.53	712,940.91
NUCOR CORP	11,771	59.89	704,965.19
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,600	98.44	354,384.00
PPG INDUSTRIES	8,847	108.73	961,934.31
SEALED AIR CORP	6,203	42.19	261,704.57
SHERWIN-WILLIAMS CO	3,163	437.55	1,383,970.65
STEEL DYNAMICS INC	8,800	37.26	327,888.00
VULCAN MATERIALS CO	4,956	113.16	560,820.96
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,400	77.03	107,842.00
WESTROCK COMPANY	9,825	39.26	385,729.50
3M CO	21,682	208.41	4,518,745.62
ACUITY BRANDS INC	1,500	129.76	194,640.00
AERCAP HOLDINGS NV	4,469	48.29	215,808.01
ALLEGION PLC W/I	3,400	88.02	299,268.00
AMETEK INC	8,900	79.04	703,456.00
ARCONIC INC	15,129	18.06	273,229.74
BOEING CO	20,170	416.26	8,395,964.20
CATERPILLAR	22,271	135.80	3,024,401.80
CUMMINS ENGINE CO	5,812	153.66	893,071.92
DEERE & CO	11,395	157.26	1,791,977.70
DOVER CORP	5,614	91.42	513,231.88
EATON CORP PLC	15,961	78.80	1,257,726.80
EMERSON ELECTRIC CO	23,549	67.89	1,598,741.61
FASTENAL CO	10,500	62.46	655,830.00
FLOWSERVE CORP	5,200	47.23	245,596.00
FLUOR CORP	5,311	37.00	196,507.00
FORTIVE CORPORATION	11,034	80.48	888,016.32
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	5,900	48.06	283,554.00
GENERAL DYNAMICS CORP	9,260	174.78	1,618,462.80
GENERAL ELECTRIC CO	323,702	10.13	3,279,101.26
GRAINGER (WW)	1,767	314.65	555,986.55
HARRIS CORP	4,300	164.59	707,737.00
HD SUPPLY HOLDINGS	6,200	44.13	273,606.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,417	153.28	4,202,477.76
HUNTINGTON INGALLS IND	1,600	218.00	348,800.00
IDEX CORP	2,800	142.54	399,112.00
ILLINOIS TOOL WORKS	11,418	143.25	1,635,628.50
INGERSOLL-RAND PLC	9,231	105.00	969,255.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,500	71.25	320,625.00

JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,300	71.04	589,632.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	8,500	39.67	337,195.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	34,324	34.91	1,198,250.84
L3 TECHNOLOGIES INC	2,900	211.87	614,423.00
LENNOX INTERNATIONAL	1,400	246.68	345,352.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	9,598	305.18	2,929,117.64
MASCO CORP	11,490	37.91	435,585.90
MIDDLEBY CORP	2,300	117.50	270,250.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,240	287.35	1,793,064.00
OWENS CORNING	4,400	55.44	243,936.00
PACCAR INC	13,306	68.22	907,735.32
PARKER HANNIFIN CORP	4,928	173.33	854,170.24
PENTAIR PLC	6,834	42.48	290,308.32
RAYTHEON COMPANY	10,726	184.62	1,980,234.12
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,722	177.46	837,966.12
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,800	311.23	1,182,674.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	49.45	306,590.00
SMITH (A.O.) CORP	5,600	51.99	291,144.00
SNAP-ON	2,204	159.13	350,722.52
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	3,800	96.28	365,864.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,560	136.56	759,273.60
TEXTRON	9,052	54.60	494,239.20
TRANSDIGM GROUP INC	1,800	436.54	785,772.00
UNITED RENTALS INC	3,296	134.29	442,619.84
UNITED TECHNOLOGIES CORP	30,256	128.64	3,892,131.84
WABCO HOLDINGS INC	1,900	115.91	220,229.00
WABTEC CORPORATION	3,125	74.57	233,031.25
XYLEM INC	6,754	73.26	494,798.04
CINTAS CORP	3,399	203.49	691,662.51
COPART INC	7,800	53.32	415,896.00
COSTAR GROUP	1,300	409.78	532,714.00
EQUIFAX INC	4,403	109.32	481,335.96
IHS MARKIT LIMITED	15,102	53.13	802,369.26
MANPOWER GROUP	2,354	84.59	199,124.86
NIELSEN HOLDINGS PLC	13,650	25.95	354,217.50
REPUBLIC SERVICES INC	8,502	77.27	656,949.54
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	4,640	67.45	312,968.00
ROLLINS	5,250	39.71	208,477.50
TRANSUNION	6,000	62.79	376,740.00
VERISK ANALYTICS INC	6,000	124.43	746,580.00
WASTE CONNECTIONS INC	10,163	82.47	838,142.61
WASTE MANAGEMENT (NEW)	15,820	99.08	1,567,445.60
AMERCO	300	377.46	113,238.00
AMERICAN AIRLINES GROUP	4,502	35.47	159,685.94
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,200	91.95	478,140.00
CSX CORP	30,105	72.51	2,182,913.55
DELTA AIR LINES INC	6,900	51.82	357,558.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,484	75.02	486,429.68

FEDEX CORP	9,440	180.25	1,701,560.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,457	113.81	393,441.17
KANSAS CITY SOUTHERN	3,749	109.55	410,702.95
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	5,400	34.20	184,680.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,569	182.76	1,931,590.44
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,400	149.53	358,872.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,710	57.67	329,295.70
UNION PACIFIC CORP	27,366	171.33	4,688,616.78
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	2,527	89.24	225,509.48
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	25,597	110.77	2,835,379.69
XPO LOGISTICS INC	4,500	54.64	245,880.00
APTIV PLC	10,112	81.30	822,105.60
AUTOLIV INC	3,500	79.80	279,300.00
BORGWARNER INC	8,100	41.79	338,499.00
FORD MOTOR COMPANY	137,725	8.83	1,216,111.75
GENERAL MOTORS CO	46,999	39.53	1,857,870.47
GOODYEAR TIRE & RUBBER	9,500	19.00	180,500.00
HARLEY-DAVIDSON	6,058	37.11	224,812.38
LEAR CORP	2,550	156.37	398,743.50
TESLA INC	4,800	305.64	1,467,072.00
CAPRI HOLDINGS LIMITED	6,100	44.03	268,583.00
DR HORTON INC	13,666	40.43	552,516.38
GARMIN LTD	4,200	70.97	298,074.00
HANESBRANDS INC	13,724	18.79	257,873.96
HASBRO INC	4,500	87.46	393,570.00
LEGGETT & PLATT INC	5,091	45.20	230,113.20
LENNAR CORP-CL A	10,712	49.38	528,958.56
LULULEMON ATHLETICA INC	3,800	147.57	560,766.00
MATTEL	13,461	14.01	188,588.61
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,300	139.71	321,333.00
NEWELL BRANDS INC	18,044	17.01	306,928.44
NIKE B	47,304	84.57	4,000,499.28
NVR INC	130	2,622.70	340,951.00
POLARIS INDUSTRIES INC	2,189	86.79	189,983.31
PULTE GROUP INC	10,263	27.04	277,511.52
PVH CORP	3,000	112.72	338,160.00
RALPH LAUREN CORP	1,974	125.45	247,638.30
TAPESTRY INC	10,683	35.53	379,566.99
UNDER ARMOUR INC CLASS A	6,924	21.36	147,896.64
UNDER ARMOUR INC CLASS C	6,973	19.39	135,206.47
VF CORP	12,498	86.73	1,083,951.54
WHIRLPOOL CORP	2,374	141.55	336,039.70
ARAMARK	9,300	32.60	303,180.00
BLOCK (H&R)	7,484	24.21	181,187.64
CARNIVAL CORP	14,066	58.30	820,047.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	901	599.46	540,113.46
DARDEN RESTAURANTS	4,719	111.34	525,413.46

DOMINO'S PIZZA INC	1,500	279.23	418,845.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	10,517	81.39	855,978.63
LAS VEGAS SANDS CORP	15,000	61.15	917,250.00
MARRIOTT INT'L A	10,844	122.03	1,323,293.32
MCDONALD'S CORP	28,728	179.25	5,149,494.00
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	9,036	22.19	200,508.84
MGM RESORTS INTERNATIONAL	17,900	28.47	509,613.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	6,893	53.38	367,948.34
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,300	119.36	751,968.00
STARBUCKS CORP	49,852	70.20	3,499,610.40
VAIL RESORTS	1,600	207.79	332,464.00
WYNN RESORTS LTD	3,100	128.36	397,916.00
YUM! BRANDS INC	11,658	94.52	1,101,914.16
ACTIVISION BLIZZARD INC	26,800	44.48	1,192,064.00
ALPHABET INC-CL A	11,112	1,126.51	12,517,779.12
ALPHABET INC-CL C	11,681	1,118.56	13,065,899.36
CBS CORP-CL B	12,377	50.57	625,904.89
CHARTER COMMUNICATION-A	6,025	348.43	2,099,290.75
COMCAST CORP-CL A	169,212	37.55	6,353,910.60
DISCOVERY INC-A	6,145	29.06	178,573.70
DISCOVERY INC-C	11,151	27.36	305,091.36
DISH NETWORK CORP-A	8,272	30.74	254,281.28
DISNEY (WALT) CO NEW	55,086	113.51	6,252,811.86
ELECTRONIC ARTS	11,624	102.96	1,196,807.04
FACEBOOK INC-A	89,452	162.29	14,517,165.08
IAC/INTERACTIVECORP	2,900	217.90	631,910.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	15,439	23.29	359,574.31
LIBERTY BROADBAND CORP-C	4,200	88.69	372,498.00
LIBERTY GLOBAL PLC A	7,599	25.54	194,078.46
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	20,180	24.73	499,051.40
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,800	30.70	239,460.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,073	40.37	124,057.01
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	6,662	40.35	268,811.70
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,500	55.69	306,295.00
NETFLIX INC	16,207	361.92	5,865,637.44
NEWS CORP - CLASS A	15,956	12.76	203,598.56
OMNICOM GROUP	8,188	74.97	613,854.36
SIRIUS XM HOLDINGS INC	57,464	6.00	344,784.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,200	93.27	391,734.00
TRIPADVISOR INC	3,871	56.43	218,440.53
TWENTY FIRST CENTURY FOX	16,814	50.17	843,558.38
TWENTY FIRST CENTURY FOX INC	39,207	50.53	1,981,129.71
TWITTER INC	25,447	31.65	805,397.55
VIACOM INC-CLASS B	14,017	29.15	408,595.55
ZILLOW GROUP INC-C	4,200	36.23	152,166.00
ADOVANCE AUTO PARTS	2,750	167.14	459,635.00

AMAZON COM INC	15,388	1,627.58	25,045,201.04
AUTOZONE INC	981	916.68	899,263.08
BEST BUY COMPANY INC	9,186	60.34	554,283.24
BOOKING HOLDINGS INC	1,743	1,935.50	3,373,576.50
BURLINGTON STORES INC	2,500	162.99	407,475.00
CARMAX INC	6,450	61.99	399,835.50
DOLLAR GENERAL CORP	10,109	119.15	1,204,487.35
DOLLAR TREE INC	8,803	99.05	871,937.15
EBAY INC	34,522	37.05	1,279,040.10
EXPEDIA GROUP INC	4,627	128.25	593,412.75
GAP	9,054	25.19	228,070.26
GENUINE PARTS CO	5,500	109.18	600,490.00
GRUBHUB INC	3,300	83.54	275,682.00
HOME DEPOT	42,339	192.33	8,143,059.87
KOHL'S CORP	6,121	66.24	405,455.04
L BRANDS INC	9,560	27.50	262,900.00
LKQ CORP	11,565	27.00	312,255.00
LOWE'S COMPANIES	30,006	105.06	3,152,430.36
MACY'S INC	12,062	25.33	305,530.46
MERCADOLIBRE	1,600	367.21	587,536.00
NORDSTROM INC	4,700	45.25	212,675.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,928	384.54	1,125,933.12
QURATE RETAIL INC	16,987	21.76	369,637.12
ROSS STORES INC	13,812	93.67	1,293,770.04
TARGET CORP	18,405	73.30	1,349,086.50
TIFFANY & CO	4,225	90.38	381,855.50
TJX COMPANIES INC	45,822	50.48	2,313,094.56
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,544	97.07	441,086.08
ULTA BEAUTY INC	2,116	304.65	644,639.40
WAYFAIR INC- CLASS A	2,000	120.13	240,260.00
COSTCO WHOLESALE CORP	16,387	218.12	3,574,332.44
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	11,600	8.97	104,052.00
KROGER CO	29,292	29.55	865,578.60
SYSCO CORP	18,403	67.01	1,233,185.03
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	31,329	74.43	2,331,817.47
WALMART INC	54,616	102.20	5,581,755.20
ALTRIA GROUP INC	69,732	48.99	3,416,170.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	20,684	41.85	865,625.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC- SP ADR	9,075	36.65	332,598.75
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,780	48.36	472,960.80
BUNGE LIMITED	5,375	52.65	282,993.75
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,110	35.01	248,921.10
COCA-COLA CO	149,607	44.83	6,706,881.81
CONAGRA BRANDS INC	14,727	24.01	353,595.27
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,216	174.72	1,086,059.52
GENERAL MILLS	21,761	45.74	995,348.14
HORMEL FOODS CORP	10,600	43.30	458,980.00

INGREDION INC	2,700	93.08	251,316.00
JM SMUCKER CO	4,388	104.01	456,395.88
KELLOGG CO	9,587	57.42	550,485.54
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,300	70.30	372,590.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,449	129.69	576,990.81
MOLSON COORS BREWING CO-B	7,100	61.11	433,881.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	54,161	48.10	2,605,144.10
MONSTER BEVERAGE CORP	15,440	58.23	899,071.20
PEPSICO INC	52,336	115.93	6,067,312.48
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	57,951	83.39	4,832,533.89
THE HERSHEY COMPANY	5,500	109.69	603,295.00
THE KRAFT HEINZ CO/THE	22,655	47.77	1,082,229.35
TYSON FOODS INC-CL A	11,426	62.94	719,152.44
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,100	64.96	591,136.00
CLOROX CO	4,683	156.01	730,594.83
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,962	66.72	2,065,784.64
COTY INC	19,092	11.04	210,775.68
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,313	155.40	1,291,840.20
KIMBERLY-CLARK CORP	12,857	119.57	1,537,311.49
PROCTER & GAMBLE CO	92,139	99.99	9,212,978.61
ABBOTT LABORATORIES	65,077	75.00	4,880,775.00
ABIOMED INC	1,600	359.37	574,992.00
ALIGN TECHNOLOGY	2,900	255.24	740,196.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,042	86.85	524,747.70
ANTHEM INC	9,555	311.60	2,977,338.00
BAXTER INTERNATIONAL	19,143	73.47	1,406,436.21
BECTON DICKINSON	9,909	248.04	2,457,828.36
BOSTON SCIENTIFIC CORP	51,148	39.86	2,038,759.28
CARDINAL HEALTH INC	11,871	56.79	674,154.09
CENTENE CORP	15,400	64.41	991,914.00
CERNER CORP	11,088	57.54	638,003.52
CIGNA CORP	14,128	198.28	2,801,299.84
CVS HEALTH CORPORATION	47,921	69.88	3,348,719.48
DANAHER CORP	23,369	111.32	2,601,437.08
DAVITA INC	4,800	59.14	283,872.00
DENTSPLY SIRONA INC	8,400	43.84	368,256.00
DEXCOM INC	3,200	147.90	473,280.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,800	177.03	1,380,834.00
HCA HEALTHCARE INC	10,233	143.59	1,469,356.47
HENRY SCHEIN INC	6,000	63.11	378,660.00
HOLOGIC INC	10,116	46.29	468,269.64
HUMANA	5,149	305.40	1,572,504.60
IDEXX LABORATORIES	3,200	211.32	676,224.00
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	4,138	548.17	2,268,327.46
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,944	149.79	590,771.76
MCKESSON CORP	7,358	136.30	1,002,895.40
MEDTRONIC PLC	50,005	92.33	4,616,961.65

QUEST DIAGNOSTICS INC	5,246	88.05	461,910.30
RESMED INC	5,233	99.75	521,991.75
STRYKER CORP	12,567	186.11	2,338,844.37
TELEFLEX	1,700	282.00	479,400.00
THE COOPER COS INC	1,831	283.42	518,942.02
UNITED HEALTH GROUP INC	35,591	270.41	9,624,162.31
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,320	135.27	449,096.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,460	131.71	455,716.60
VEEVA SYSTEMS A	4,400	120.40	529,760.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,800	277.05	498,690.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,631	123.56	942,886.36
ABBVIE INC	56,023	80.52	4,510,971.96
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,720	77.52	908,534.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,263	128.93	1,065,348.59
ALKERMES PLC	5,900	34.09	201,131.00
ALLERGAN PLC	12,325	137.96	1,700,357.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,500	80.38	281,330.00
AMGEN INC	23,914	186.97	4,471,200.58
BEIGENE LTD-ADR	1,100	138.93	152,823.00
BIOGEN INC	7,401	333.00	2,464,533.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,521	91.85	598,953.85
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	60,863	51.36	3,125,923.68
CELGENE CORP	25,913	90.69	2,350,049.97
GILEAD SCIENCES INC	47,910	66.76	3,198,471.60
ILLUMINA INC	5,500	302.26	1,662,430.00
INCYTE CORP	7,108	84.08	597,640.64
IQIVA HOLDINGS INC	5,432	141.49	768,573.68
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,201	126.98	279,482.98
JOHNSON & JOHNSON	99,325	135.69	13,477,409.25
LILLY (ELI) & CO	35,773	122.13	4,368,956.49
MERCK & CO	98,460	79.24	7,801,970.40
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	907	671.86	609,377.02
MYLAN NV	18,600	32.10	597,060.00
NEKTAR THERAPEUTICS	6,000	42.81	256,860.00
PERRIGO CO PLC	4,879	49.55	241,754.45
PFIZER	217,088	42.60	9,247,948.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,977	420.60	1,252,126.20
SEATTLE GENETICS	3,900	70.15	273,585.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,200	18.02	39,644.00
THERMO ELECTRON CORP	14,971	250.83	3,755,175.93
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,706	118.77	202,621.62
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,410	186.86	1,758,352.60
WATERS CORPORATION	2,927	234.44	686,205.88
ZOETIS INC	17,795	94.91	1,688,923.45
BANK OF AMERICA CORP	351,387	29.13	10,235,903.31
BB&T CORPORATION	28,500	51.11	1,456,635.00
CIT GROUP INC	4,800	51.11	245,328.00
CITIGROUP INC	93,151	64.38	5,997,061.38

CITIZENS FINANCIAL GROUP	18,000	37.08	667,440.00
COMERICA	6,522	87.44	570,283.68
EAST WEST BANCORP	5,300	54.96	291,288.00
FIFTH THIRD BANCORP	24,520	27.51	674,545.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,006	102.00	612,612.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	42,615	14.12	601,723.80
JPMORGAN CHASE & CO	124,490	105.18	13,093,858.20
KEYCORP	40,091	17.74	711,214.34
M & T BANK CORP	4,991	173.48	865,838.68
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	12,000	17.53	210,360.00
PNC BANK CORP	17,187	124.95	2,147,515.65
REGIONS FINANCIAL CORP	42,445	16.14	685,062.30
SIGNATURE BANK	2,000	135.89	271,780.00
SUNTRUST BANKS	16,964	65.65	1,113,686.60
SVB FINANCIAL GROUP	1,900	248.85	472,815.00
US BANCORP	57,235	51.31	2,936,727.85
WELLS FARGO COMPANY	169,397	49.38	8,364,823.86
ZIONS BANCORPORATION	7,400	50.72	375,328.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,000	109.00	218,000.00
ALLY FINANCIAL INC.	15,375	27.19	418,046.25
AMERICAN EXPRESS	27,215	106.50	2,898,397.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,196	131.96	685,664.16
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	8,500	19.42	165,070.00
BANK NEW YORK MELLO CORP	37,557	52.99	1,990,145.43
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	47,634	205.69	9,797,837.46
BLACKROCK INC	4,490	431.07	1,935,504.30
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,599	82.20	1,446,637.80
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,100	94.16	386,056.00
CME GROUP INC	12,689	174.30	2,211,692.70
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,632	71.59	904,324.88
E*TRADE FINANCIAL CORP	9,800	48.65	476,770.00
EATON VANCE CORP	4,400	41.23	181,412.00
FRANKLIN RESOURCES INC	12,105	32.33	391,354.65
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,284	198.67	2,639,132.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,125	74.86	1,581,417.50
INVESCO LTD	15,680	18.91	296,508.80
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	11,600	21.02	243,832.00
MOODY'S CORPORATION	6,549	167.96	1,099,970.04
MORGAN STANLEY	48,288	42.16	2,035,822.08
MSCI INC	3,370	174.80	589,076.00
NASDAQ INC	4,340	87.82	381,138.80
NORTHERN TRUST CORP	7,805	93.00	725,865.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,115	82.93	424,186.95
S&P GLOBAL INC	9,478	197.65	1,873,326.70
SCHWAB (CHARLES) CORP	45,116	47.06	2,123,158.96
SEI INVESTMENTS CO COM	5,200	52.48	272,896.00
STATE STREET CORP	13,931	71.37	994,255.47
SYNCHRONY FINANCIAL	25,815	31.76	819,884.40

T ROWE PRICE GROUP INC	9,293	97.40	905,138.20
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	9,800	56.96	558,208.00
VOYA FINANCIAL INC	5,754	49.67	285,801.18
AFLAC	28,310	48.99	1,386,906.90
ALLEGHANY CORP	548	650.06	356,232.88
ALLSTATE CORP	12,728	94.62	1,204,323.36
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,700	98.70	266,490.00
AMERICAN INT'L GROUP	33,517	42.99	1,440,895.83
AON PLC	9,134	172.66	1,577,076.44
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,750	32.07	473,032.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,900	80.37	554,553.00
ASSURANT INC	2,000	98.24	196,480.00
ATHENE HLDG LTD CLASS A	4,600	44.41	204,286.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	3,488	42.76	149,146.88
CHUBB LTD	17,284	133.76	2,311,907.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,937	85.61	508,266.57
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	219.57	351,312.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,102	34.66	350,135.32
HARTFORD FINANCIAL SVCS	13,209	49.12	648,826.08
LINCOLN NATIONAL CORP	8,215	62.05	509,740.75
LOEWS CORP	10,505	47.06	494,365.30
MARKEL CORP	515	1,016.87	523,688.05
MARSH & MCLENNAN COS	18,575	91.53	1,700,169.75
METLIFE INC	31,171	44.74	1,394,590.54
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,186	51.36	574,512.96
PROGRESSIVE CORP	21,589	71.81	1,550,306.09
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,335	93.95	1,440,723.25
REINSURANCE GRP AMERICA	2,500	142.88	357,200.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,628	144.14	234,659.92
TORCHMARK CORP	4,150	83.64	347,106.00
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	9,834	129.10	1,269,569.40
UNUM GROUP	8,632	36.73	317,053.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,928	170.72	841,308.16
WR BERKLEY CORP	3,610	81.96	295,875.60
CBRE GROUP INC-A	11,884	50.13	595,744.92
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,000	7.09	311,960.00
JONES LANG LASALLE INC	1,600	164.86	263,776.00
ACCENTURE PLC-CL A	23,697	159.48	3,779,197.56
ADOBE INC	18,128	257.81	4,673,579.68
AKAMAI TECHNOLOGIES	6,172	70.47	434,940.84
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,800	174.83	314,694.00
ANSYS INC	3,100	174.46	540,826.00
AUTODESK INC	8,037	160.68	1,291,385.16
AUTOMATIC DATA PROCESS	16,163	150.31	2,429,460.53
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,500	99.83	449,235.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,400	52.64	547,456.00
CDK GLOBAL INC	5,200	58.30	303,160.00

CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	4,503	120.34	541,891.02	
CITRIX SYSTEMS INC	5,070	106.28	538,839.60	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,855	73.18	1,599,348.90	
DXC TECHNOLOGY CO	10,607	65.83	698,258.81	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	12,130	108.71	1,318,652.30	
FIRST DATA CORP A	15,200	25.50	387,600.00	
FISERV INC	14,906	85.62	1,276,251.72	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,381	226.07	764,342.67	
FORTINET INC	5,600	83.93	470,008.00	
GARTNER INC	3,400	141.63	481,542.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,900	124.37	733,783.00	
GODADDY INC-CLASS A	5,200	72.68	377,936.00	
IBM CORP	33,761	138.70	4,682,650.70	
INTUIT CORP	9,026	234.63	2,117,770.38	
JACK HENRY & ASSOCIATES, INC.	2,800	132.84	371,952.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,200	62.31	324,012.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	34,114	220.59	7,525,207.26	
MICRO FOCUS INTL-SPN ADR	6,945	23.88	165,846.60	
MICROSOFT CORP	269,932	108.17	29,198,544.44	
ORACLE CORP	110,459	52.02	5,746,077.18	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,440	229.90	790,856.00	
PAYCHEX INC	12,251	75.13	920,417.63	
PAYPAL HOLDINGS INC	41,622	95.02	3,954,922.44	
PTC INC	4,100	92.62	379,742.00	
RED HAT INC	6,600	181.81	1,199,946.00	
SABRE CORP	6,900	22.45	154,905.00	
SALESFORCE COM INC COM	25,570	160.61	4,106,797.70	
SERVICENOW INC	6,484	234.58	1,521,016.72	
SPLUNK INC	5,300	136.16	721,648.00	
SQUARE INC - A	10,000	76.64	766,400.00	
SS&C TECHNOLOGIES HLDGS	7,200	60.46	435,312.00	
SYMANTEC CORP	23,700	22.99	544,863.00	
SYNOPSIS INC	5,715	101.86	582,129.90	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6,016	92.78	558,164.48	
VERISIGN INC	3,299	175.68	579,568.32	
VISA INC-CLASS A SHARES	65,795	144.44	9,503,429.80	
VMWARE INC	2,700	170.04	459,108.00	
WESTERN UNION CO	16,716	17.84	298,213.44	
WIX.COM LTD	1,500	125.75	188,625.00	
WORKDAY INC CLASS A	5,172	192.74	996,851.28	
WORLDPAY INC-CL A	6,787	88.43	600,174.41	
AMPHENOL CORP-CL A	11,000	92.47	1,017,170.00	
APPLE INC	178,967	170.93	30,590,829.31	
ARISTA NETWORKS	1,900	269.58	512,202.00	
ARROW ELECTRONICS INC	3,300	81.05	267,465.00	
CDW CORP/DE	5,900	94.68	558,612.00	
CISCO SYSTEMS	174,082	49.65	8,643,171.30	

COGNEX CORP	6,800	51.49	350,132.00
COMMSCOPE HOLDING CO	8,000	23.18	185,440.00
CORNING	29,728	34.20	1,016,697.60
DELL TECHNOLOGIES INC-C	4,877	55.04	268,430.08
FLEX LTD	20,245	10.40	210,548.00
FLIR SYSTEMS INC	5,300	52.04	275,812.00
FS NETWORKS INC	2,300	169.81	390,563.00
HEWLETT-PACKARD CO	58,303	23.25	1,355,544.75
HP ENTERPRISE CO	54,376	16.09	874,909.84
IPG PHOTONICS CORP	1,500	153.00	229,500.00
JUNIPER NETWORKS INC	12,808	27.15	347,737.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,000	80.66	564,620.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,243	138.91	867,215.13
NETAPP INC	9,448	64.25	607,034.00
SEAGATE TECHNOLOGY	10,178	45.89	467,068.42
TE CONNECTIVITY LTD	13,062	82.17	1,073,304.54
TRIMBLE INC	9,243	39.39	364,081.77
WESTERN DIGITAL CORP	10,992	48.00	527,616.00
XEROX CORP	8,642	30.65	264,877.30
AT & T INC	268,883	30.63	8,235,886.29
CENTURYLINK INC	35,489	14.10	500,394.90
SPRINT CORP W/I	28,412	6.33	179,847.96
T MOBILE US INC	11,608	72.52	841,812.16
VERIZON COMMUNICATIONS	152,984	55.44	8,481,432.96
ZAYO GROUP HOLDINGS	7,900	25.45	201,055.00
AES CORPORATION	25,262	17.18	434,001.16
ALLIANT ENERGY CORP	8,590	45.15	387,838.50
AMEREN CORPORATION	8,977	70.09	629,197.93
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,285	80.08	1,464,262.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,600	98.70	651,420.00
ATMOS ENERGY CORP	3,858	97.30	375,383.40
CENTERPOINT ENERGY INC	15,456	31.21	482,381.76
CMS ENERGY CORP	11,000	52.79	580,690.00
CONSOLIDATED EDISON	11,759	78.87	927,432.33
DOMINION ENERGY INC	27,660	73.54	2,034,116.40
DTE ENERGY	6,666	120.51	803,319.66
DUKE ENERGY CORP	26,065	87.94	2,292,156.10
EDISON INTERNATIONAL	12,016	61.65	740,786.40
ENERGY CORP	6,620	90.05	596,131.00
EVERGY INC	10,300	59.29	610,687.00
EVERSOURCE ENERGY	11,971	70.40	842,758.40
EXELON CORP	35,809	48.15	1,724,203.35
FIRSTENERGY CORP	17,116	39.60	677,793.60
NEXTERA ENERGY INC	17,490	185.37	3,242,121.30
NISOURCE INC	12,100	26.94	325,974.00
NRG ENERGY INC	11,000	42.45	466,950.00
OGE ENERGY CORP	7,212	41.93	302,399.16
PINNACLE WEST CAPITAL	4,197	90.65	380,458.05

	PPL CORPORATION	26,166	30.68	802,772.88	
	PUBLIC SV ENTERPRISE CO	18,702	56.22	1,051,426.44	
	SEMPRA ENERGY	9,241	116.27	1,074,451.07	
	SOUTHERN CO	37,439	48.92	1,831,515.88	
	UGI CORP	6,500	53.54	348,010.00	
	VISTRA ENERGY CORP	9,600	26.59	255,264.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	11,886	74.91	890,380.26	
	XCEL ENERGY INC	18,844	53.79	1,013,618.76	
	ADVANCED MICRO DEVICES	34,800	23.95	833,460.00	
	ANALOG DEVICES	13,748	104.22	1,432,816.56	
	APPLIED MATERIALS	36,241	39.30	1,424,271.30	
	BROADCOM INC	15,946	281.66	4,491,350.36	
	INTEL CORP	170,728	51.40	8,775,419.20	
	KLA-TENCOR CORPORATION	5,748	108.26	622,278.48	
	LAM RESEARCH CORP	6,000	180.31	1,081,860.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,900	19.31	442,199.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	10,400	55.52	577,408.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,810	90.69	798,978.90	
	MICRON TECHNOLOGY	42,430	41.96	1,780,362.80	
	NVIDIA CORP	21,500	156.64	3,367,760.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,591	92.50	1,164,667.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,000	22.78	364,480.00	
	QORVO INC	4,625	64.87	300,023.75	
	QUALCOMM	52,018	52.01	2,705,456.18	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC.	6,751	82.62	557,767.62	
	TEXAS INSTRUMENTS	35,986	107.28	3,860,578.08	
	XILINX INC	9,610	118.96	1,143,205.60	
アメリカ・ドル	小計	11,234,793		883,990,377.07 (97,901,934,260)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	15,139	10.20	154,417.80	
	CAMECO CORP	13,522	15.64	211,484.08	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,690	37.17	1,661,127.30	
	CENOVUS ENERGY INC	40,248	11.62	467,681.76	
	ENBRIDGE INC	53,471	47.89	2,560,726.19	
	ENCANA CORP	38,345	9.01	345,488.45	
	HUSKY ENERGY INC	12,627	15.80	199,506.60	
	IMPERIAL OIL LTD	9,985	36.76	367,048.60	
	INTER PIPELINE LTD	13,489	21.00	283,269.00	
	KEYERA CORP	7,042	29.16	205,344.72	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,849	48.68	917,569.32	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,236	19.15	138,569.40	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	9,500	10.53	100,035.00	
	SUNCOR ENERGY INC	59,830	45.49	2,721,666.70	
	TOURMALINE OIL CORP	7,700	20.14	155,078.00	
	TRANSCANADA CORP	32,612	56.90	1,855,622.80	
	VERMILION ENERGY TRUST	4,600	33.29	153,134.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,355	57.26	478,407.30	
	BARRICK GOLD CORP	63,080	17.91	1,129,762.80	

CCL INDUSTRIES INC	5,500	56.87	312,785.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,228	14.19	372,175.32
FRANCO NEV CORP	7,062	101.61	717,569.82
GOLDCORP INC	32,283	14.88	480,371.04
KINROSS GOLD CORP	44,963	4.97	223,466.11
LUNDIN MINING CORP	29,200	6.61	193,012.00
METHANEX CORP	2,381	75.30	179,289.30
NUTRIEN LTD	22,553	70.49	1,589,760.97
TECK RESOURCES LTD	19,208	29.06	558,184.48
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	33,539	2.47	82,841.33
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,100	69.90	146,790.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,400	28.81	472,484.00
BOMBARDIER INC.	69,741	2.76	192,485.16
CAE Inc.	9,750	27.66	269,685.00
FINNING INTERNATIONAL INC	6,102	26.27	160,299.54
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,613	34.24	226,429.12
WSP GLOBAL INC	3,700	70.23	259,851.00
THOMSON REUTERS CORPORATION	10,862	69.86	758,819.32
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,025	112.05	3,028,151.25
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,313	273.01	1,450,502.13
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,738	68.45	803,466.10
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,315	45.35	331,735.25
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,433	85.80	723,551.40
STARS GROUP INC/THE	5,900	21.87	129,033.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,356	27.13	470,868.28
CANADIAN TIRE CORP.	2,431	142.98	347,584.38
DOLLARAMA INC	12,285	36.41	447,296.85
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	15,800	73.09	1,154,822.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,466	30.58	197,730.28
LOBLAW COMPANIES LTD	7,072	66.69	471,631.68
METRO INC	8,918	48.72	434,484.96
WESTON (GEORGE)	2,890	97.67	282,266.30
SAPUTO INC	7,907	42.02	332,252.14
AURORA CANNABIS INC	24,400	9.15	223,260.00
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	12,591	33.37	420,161.67
CANOPY GROWTH CORP	7,600	61.08	464,208.00
BANK OF MONTREAL	23,894	98.16	2,345,435.04
BANK OF NOVA SCOTIA	44,522	74.89	3,334,252.58
CANADIAN IMPERIAL BANK	16,314	113.22	1,847,071.08
NATIONAL BANK OF CANADA	12,846	62.34	800,819.64
ROYAL BANK OF CANADA	53,142	101.79	5,409,324.18
TRONTO-DOMINION BANK	67,435	75.69	5,104,155.15
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	31,030	58.56	1,817,116.80
CI FINANCIAL CORP	9,853	19.18	188,980.54
IGM FINANCIAL INC	2,833	34.33	97,256.89
ONEX CORPORATION	3,009	77.47	233,107.23
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,057	641.34	677,896.38
GREAT-WEST LIFECO INC	11,246	29.95	336,817.70

	IA FINANCIAL CORP INC	3,993	50.33	200,967.69	
	INTACT FINANCIAL CORP	5,300	111.16	589,148.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	73,320	21.83	1,600,575.60	
	POWER CORP OF CANADA	12,988	27.32	354,832.16	
	POWER FINANCIAL CORP	9,058	28.46	257,790.68	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	22,491	49.11	1,104,533.01	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,141	21.74	111,765.34	
	BLACKBERRY LTD	18,500	11.57	214,045.00	
	CGI INC	9,084	88.02	799,573.68	
	CONSTELLATION SOFTWARE	755	1,132.24	854,841.20	
	OPEN TEXT CORP	9,584	49.59	475,270.56	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,200	239.75	767,200.00	
	BCE INC	5,415	57.63	312,066.45	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	13,204	72.55	957,950.20	
	TELUS CORP	6,932	47.15	326,843.80	
	ALTAGAS LTD	11,413	15.86	181,010.18	
	ATCO LTD -CLASS I	3,514	41.78	146,814.92	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,700	33.36	190,152.00	
	EMERA	2,000	46.17	92,340.00	
	FORTIS INC	15,600	46.36	723,216.00	
	HYDRO ONE	11,700	20.65	241,605.00	
カナダ・ドル 小計		1,526,018		65,710,018.68 (5,509,127,966)	
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	10,482	28.25	296,116.50	
	OIL SEARCH LTD	53,914	8.04	433,468.56	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	66,964	7.66	512,944.24	
	SANTOS	65,542	6.87	450,273.54	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,349	29.30	98,125.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	33,931	37.01	1,255,786.31	
	WORLEYPARSONS LTD	10,536	15.13	159,409.68	
	ALUMINA LTD	88,343	2.67	235,875.81	
	AMCOR	41,950	14.85	622,957.50	
	BHP GROUP LIMITED	109,192	37.01	4,041,195.92	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,351	12.16	247,468.16	
	BORAL LIMITED	40,934	4.84	198,120.56	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,190	6.35	356,806.50	
	INCITEC PIVOT LTD	64,405	3.27	210,604.35	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	17,696	17.66	312,511.36	
	NEWCREST MINING	29,806	24.97	744,255.82	
	ORICA	13,043	18.14	236,600.02	
	RIO TINTO LTD	13,512	92.52	1,250,130.24	
	SOUTH32 LTD	183,960	3.89	715,604.40	
	CIMIC GROUP LTD	3,202	49.30	157,858.60	
	BRAMBLES LTD	59,125	11.39	673,433.75	
	SEEK LTD	11,699	16.99	198,766.01	
	AURIZON HOLDINGS LTD	70,756	4.67	330,430.52	
	SYDNEY AIRPORT	42,048	6.90	290,131.20	
	TRANSURBAN GROUP	98,310	12.24	1,203,314.40	

ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	22,072	24.87	548,930.64	
CROWN RESORTS LTD	13,347	12.20	162,833.40	
DOMINO'S PIZZA ENT	2,172	45.90	99,694.80	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,483	42.30	105,030.90	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	67,303	4.51	303,536.53	
REA GROUP LTD	1,843	78.26	144,233.18	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,601	3.57	91,395.57	
WESFARMERS LIMITED	41,976	33.26	1,396,121.76	
COLES GROUP LTD	41,976	12.08	507,070.08	
WOOLWORTHS GROUP LTD	49,295	30.25	1,491,173.75	
COCA-COLA AMATIL	21,581	8.38	180,848.78	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,946	14.98	418,631.08	
COCHLEAR LIMITED	2,155	178.58	384,839.90	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,710	59.73	341,058.30	
SONIC HEALTHCARE LIMITED	15,003	23.51	352,720.53	
CSL LIMITED	16,799	184.00	3,091,016.00	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	105,826	27.35	2,894,341.10	
BANK OF QUEENSLAND LTD	15,461	9.02	139,458.22	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,189	9.84	198,659.76	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	65,216	71.67	4,674,030.72	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	100,894	24.62	2,484,010.28	
WESTPAC BANKING	126,520	26.62	3,367,962.40	
AMP LTD	113,241	2.22	251,395.02	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	7,593	68.53	520,348.29	
CHALLENGER LTD	21,308	7.44	158,531.52	
MACQUARIE GROUP LIMITED	11,925	126.16	1,504,458.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	88,331	7.47	659,832.57	
MEDIBANK PRIVATE LTD.	102,132	2.90	296,182.80	
QBE INSURANCE GROUP	50,407	11.40	574,639.80	
SUNCORP GROUP LTD	47,148	13.30	627,068.40	
LENDLEASE GROUP	20,890	13.87	289,744.30	
COMPUTERSHARE LIMITED	16,784	18.08	303,454.72	
TELSTRA CORP	148,676	3.25	483,197.00	
TPG TELECOM LTD	12,694	6.88	87,334.72	
AGL ENERGY LIMITED	24,348	22.06	537,116.88	
APA GROUP	44,520	9.40	418,488.00	
AUSNET SERVICES	77,077	1.74	134,113.98	
オーストラリア・ドル 小計	2,787,682		45,455,693.33 (3,601,454,582)	

イギリス・ポンド	BP PLC	742,209	5.37	3,984,177.91
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	169,859	24.11	4,095,300.49
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	139,512	24.23	3,379,678.20
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	27,660	5.13	141,895.80
	ANGLO AMERICAN PLC	39,755	19.55	777,051.23
	ANTOFAGASTA PLC	14,347	8.90	127,688.30
	BHP GROUP PLC	78,257	17.96	1,405,339.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,171	50.74	262,376.54
	FRESNILLO PLC	9,924	9.83	97,572.76
	GLENCORE PLC	427,802	3.03	1,295,170.55
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,144	31.04	221,749.76
	MONDI PLC	13,618	18.82	256,222.67
	RIO TINTO PLC REG	43,203	44.04	1,902,660.12
	ASHTREAD GROUP PLC	17,428	20.10	350,302.80
	BAE SYSTEMS PLC	117,422	5.12	600,730.95
	BUNZL PLC	12,037	24.90	299,721.30
	DCC (GB)	3,349	66.85	223,880.65
	FERGUSON PLC	8,860	53.58	474,718.80
	MEGGITT PLC	30,402	5.59	170,007.98
	MELROSE INDUSTRIES PLC	186,079	1.69	314,194.39
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	63,874	9.75	622,643.75
	SMITHS GROUP PLC	14,885	14.61	217,469.85
	WEIR GROUP PLC/THE	9,441	15.56	146,854.75
	BABCOCK INTL GROUP PLC	9,592	5.48	52,544.97
	EXPERIAN PLC	34,615	20.18	698,530.70
	G4S PLC	57,203	2.08	118,696.22
	INTERTEK GROUP PLC	5,997	51.52	308,965.44
	RELX PLC	39,894	16.77	668,822.91
	EASYJET PLC	5,750	12.71	73,053.75
	ROYAL MAIL PLC	32,804	2.72	89,128.46
	BARRATT DEVELOPMENTS	35,730	5.69	203,232.24
	BURBERRY GROUP PLC	15,545	19.60	304,604.27
	PERSIMMON PLC	12,323	24.31	299,572.13
	TAYLOR WIMPEY PLC	127,603	1.66	211,948.58
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	4,859	38.40	186,585.60
	CARNIVAL PLC	6,552	43.73	286,518.96
	COMPASS GROUP PLC	58,498	17.16	1,003,825.68
	GVC HOLDINGS PLC	21,347	6.15	131,284.05
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,380	46.04	293,735.20
	MERLIN ENTERTAINMENTS	31,315	3.63	113,704.76
TUI AG	16,657	8.53	142,050.89	
WHITBREAD PLC	6,964	49.60	345,414.40	
AUTO TRADER GROUP PLC	38,826	4.61	178,871.38	
INFORMA PLC	47,728	7.07	337,532.41	
ITV PLC	133,313	1.32	176,373.09	
PEARSON	28,874	9.02	260,443.48	
WPP PLC	46,556	8.46	393,677.53	

KINGFISHER PLC	82,829	2.29	189,844.06
MARKS & SPENCER GROUP PLC	56,940	2.90	165,126.00
NEXT PLC	5,186	48.61	252,091.46
MORRISON SUPERMARKETS	79,249	2.40	190,197.60
SAINSBURY (J) PLC	58,994	2.88	169,843.72
TESCO	359,386	2.27	814,368.67
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,788	23.58	301,541.04
BRITISH AMERICAN TOBACCO	76,515	28.09	2,149,306.35
COCA COLA HBC AG CDI	6,716	26.33	176,832.28
DIAGEO	91,512	30.20	2,763,662.40
IMPERIAL BRANDS PLC	34,930	26.31	919,008.30
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,812	61.50	1,525,938.00
UNILEVER PLC	41,674	42.09	1,754,058.66
CONVATEC GROUP	49,517	1.21	60,014.60
NMC HEALTH PLC	3,745	27.46	102,837.70
SMITH&NEOHEW PLC	33,572	14.38	482,765.36
ASTRAZENECA PLC	47,103	60.93	2,869,985.79
GLAXOSMITHKLINE PLC	184,529	15.71	2,898,212.47
BARCLAYS PLC	628,096	1.59	998,672.64
HSBC HOLDINGS PLC	736,183	6.37	4,690,221.89
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,618,017	0.58	1,528,136.52
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	182,770	2.56	467,525.66
STANDARD CHARTERED PLC	105,883	6.15	651,392.21
3I GROUP PLC	37,138	9.44	350,656.99
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,112	16.80	169,881.60
INVESTEC PLC	23,156	4.81	111,449.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,724	46.03	539,655.72
SCHRODERS PLC	5,217	26.68	139,189.56
ST JAMES'S PLACE PLC	19,491	9.27	180,759.53
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	87,517	2.31	202,208.02
ADMIRAL GROUP PLC	8,283	21.53	178,332.99
AVIVA PLC	147,829	4.20	621,473.11
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	51,919	3.50	181,820.33
LEGAL & GENERAL GROUP	216,747	2.69	583,699.67
PRUDENTIAL PLC	96,050	15.21	1,460,920.50
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,647	5.37	218,355.68
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	8,521	18.12	154,400.52
SAGE GROUP PLC/THE	42,648	6.60	281,476.80
WORLDPAY INC-CL A	4,229	66.75	282,285.75
BT GROUP PLC	310,509	2.32	720,380.88
VODAFONE GROUP PLC	990,850	1.42	1,402,052.75
CENTRICA PLC	207,769	1.39	288,383.37
NATIONAL GRID PLC	127,620	8.45	1,078,771.86
SEVERN TRENT PLC	9,476	20.16	191,036.16
SSE PLC	38,356	12.01	460,655.56
UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,957	8.46	219,648.13

イギリス・ポンド 小計		11,049,874		64,385,604.53 (9,314,021,551)
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	7,136	20.90	149,142.40
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	299	555.50	166,094.50
	GIVAUDAN-REG	339	2,444.00	828,516.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	17,645	48.40	854,018.00
	SIKA AG-BEARER	4,980	131.30	653,874.00
	ABB LTD	67,651	19.75	1,335,768.99
	GEBERIT AG-REG	1,351	393.90	532,158.90
	SCHINDLER HLDG AG	730	219.20	160,016.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,458	224.40	327,175.20
	ADECCO GROUP AG-REG	6,207	52.50	325,867.50
	SGS S.A.	200	2,475.00	495,000.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,150	137.10	294,765.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	19,148	72.66	1,391,293.68
	THE SWATCH GROUP	1,897	55.05	104,429.85
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,178	283.30	333,727.40
	DUFREY AG-REG	1,277	100.10	127,827.70
	BARRY CALLEBAUT AG REG	86	1,722.00	148,092.00
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	41	6,385.00	261,785.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	73,100.00	292,400.00
	NESTLE SA-REG	113,354	89.50	10,145,183.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,002	186.20	372,772.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	400	770.00	308,000.00
	LOMZA AG-REG	2,801	286.10	801,366.10
	NOVARTIS AG-REG SHS	80,195	90.04	7,220,757.80
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	25,983	274.60	7,134,931.80
	VIFOR PHARMA AG	1,662	127.60	212,071.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	94,674	11.86	1,122,360.27
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,580	40.03	343,457.40
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1,347	78.80	106,143.60
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	667	709.00	472,903.00
UBS GROUP AG	143,129	12.85	1,838,492.00	
BALOISE HOLDING AG REG	1,942	156.60	304,117.20	
SWISS LIFE HOLDING AG	1,279	414.80	530,529.20	
SWISS RE LTD	11,153	97.14	1,083,402.42	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,567	322.60	1,795,914.20	
SWISS PRIME SITE REG	2,885	84.50	243,782.50	
TEMENOS GROUP AG-REG	2,222	141.40	314,190.80	
SWISSCOM	994	452.20	449,486.80	
スイス・フラン 小計		634,613		43,581,813.81 (4,822,763,516)

香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	99,623	81.40	8,109,312.20
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	65,540	19.28	1,263,611.20
	MTR CORP	55,148	44.10	2,432,026.80
	MINTH GROUP LTD	34,000	29.30	996,200.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	53,500	47.45	2,538,575.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	34,000	26.30	894,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	53.10	4,832,100.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	46,800	15.36	718,848.00
	SANDS CHINA LTD	94,944	37.35	3,546,158.40
	SHANGRI-LA ASIA	42,000	10.44	438,480.00
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	8.23	781,850.00
	WYNN MACAU LTD	56,961	18.70	1,065,170.70
	WH GROUP LIMITED	316,000	7.42	2,344,720.00
	BANK EAST ASIA	50,043	28.30	1,416,216.90
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	142,489	32.10	4,573,896.90
	HANG SENG BANK	28,700	186.20	5,343,940.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	43,541	257.40	11,207,453.40
	AIA GROUP LTD	449,484	74.20	33,351,712.80
	CK ASSET HOLDINGS LIMITED	95,133	65.70	6,250,238.10
	HANG LUNG GROUP	35,000	24.00	840,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	74,000	18.54	1,371,960.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,462	44.80	2,171,097.60
	HYSAN DEVELOPMENT	24,964	42.00	1,048,488.00
	KERRY PROPERTIES LTD	28,500	33.65	959,025.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	229,174	12.86	2,947,177.64
	SINO LAND	120,997	14.70	1,778,655.90
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	58,108	133.00	7,728,364.00
	SWIRE PACIFIC A	20,000	90.85	1,817,000.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,877	31.20	1,306,562.40
	WHARF HOLDINGS	49,125	24.70	1,213,387.50
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	43,125	54.55	2,352,468.75
	WHEELOCK & CO LTD	29,000	52.40	1,519,600.00
HKT TRUST AND HKT LTD	131,000	11.92	1,561,520.00	
PCCW LIMITED	188,000	4.75	893,000.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	24,000	64.05	1,537,200.00	
CLP HOLDINGS	59,817	94.70	5,664,669.90	
HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	92,161	8.09	745,582.49	
HONGKONG CHINA GAS	347,131	17.58	6,102,562.98	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	50,000	53.20	2,660,000.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,000	85.25	852,500.00	
香港・ドル 小計	3,598,347		139,175,532.56 (1,963,766,764)	

シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	53,700	6.12	328,644.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	29,660	2.57	76,226.20	
	SINGAPORE TECH ENGR.	52,800	3.73	196,944.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	86,000	1.39	119,540.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	82,000	2.43	199,260.00	
	SATS LIMITED	26,500	5.10	135,150.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	18,400	9.83	180,872.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	224,000	1.09	244,160.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	67,000	2.47	165,490.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,280	36.26	155,192.80	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	332,960	0.26	84,904.80	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	73,000	3.37	246,010.00	
	DBS GROUP HOLDING	66,368	25.10	1,665,836.80	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	118,146	11.64	1,375,219.44	
	UNITED OVERSEAS BANK	49,243	25.80	1,270,469.40	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,300	7.77	212,121.00	
	CAPITALAND LIMITED	100,585	3.39	340,983.15	
	CITY DEVELOPMENTS	13,600	9.45	128,520.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,900	6.69	146,511.00	
	VENTURE CORP LTD	9,700	16.11	156,267.00	
SINGAPORE TELECOM	307,174	3.00	921,522.00		
シンガポール・ドル 小計	1,764,316		8,349,843.59 (683,601,694)		
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,234	5.28	164,915.52	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	7.33	254,140.87	
	A2 MILK CO LTD	26,326	12.87	338,815.62	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,557	13.44	276,286.08	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	13,260	11.32	150,103.20	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	69,089	4.03	278,428.67	
	MERIDIAN ENERGY LTD	56,024	3.72	208,409.28	
ニュージーランド・ドル 小計	251,185		1,671,099.24 (127,220,785)		
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,791	302.90	2,056,993.90	
	BOLIDEN AB	10,491	237.95	2,496,333.45	
	ALFA LAVAL AB	10,391	201.50	2,093,786.50	
	ASSA ABLOY AB-B	36,790	189.60	6,975,384.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	24,591	249.45	6,134,224.95	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,442	231.45	3,574,050.90	
	EPIROC AB-A	26,071	90.14	2,350,039.94	
	EPIROC AB-B	15,442	84.27	1,301,297.34	
	SANDVIK AB	42,480	148.40	6,304,032.00	
	SKANSKA AB-B	12,783	161.45	2,063,815.35	
	SKF AB-B SHARES	14,989	155.40	2,329,290.60	
	VOLVO AB-B SHS	59,166	134.20	7,940,077.20	
	SECURITAS B	10,859	145.25	1,577,269.75	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,549	239.50	2,286,985.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,029	75.62	1,363,352.98	
HENNES & MAURITZ B	32,774	138.00	4,522,812.00		

	ICA GRUPPEN AB	2,626	355.00	932,230.00	
	SWEDISH MATCH	6,704	452.80	3,035,571.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,302	262.40	6,114,444.80	
	NORDEA BANK ABP	112,048	86.35	9,675,344.80	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	61,913	99.10	6,135,578.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	57,288	103.70	5,940,765.60	
	SWEDBANK AB	32,998	210.80	6,955,978.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,013	189.45	1,139,162.85	
	INVESTOR AB SER B NPV	17,123	414.70	7,100,908.10	
	KINNEVIK INV AB	9,233	222.40	2,053,419.20	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	2,984	288.20	859,988.80	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	112,956	84.72	9,569,632.32	
	HEXAGON AB B SHS	9,931	474.60	4,713,252.60	
	MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 US D1.5	2,554	559.00	1,427,686.00	
	TELE2 AB-B SHS	13,035	119.35	1,555,727.25	
	TELIA COMPANY AB	105,058	39.94	4,196,016.52	
スウェーデン・クローナ 小計		922,404		126,775,453.10 (1,508,627,892)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	3,823	292.80	1,119,374.40	
	EQUINOR ASA	42,928	197.60	8,482,572.80	
	NORSK HYDRO	50,825	34.60	1,758,545.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,264	346.40	2,169,849.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,292	298.50	982,662.00	
	MOWI ASA	14,280	199.90	2,854,572.00	
	ORKLA ASA	28,896	67.66	1,955,103.36	
	DNB ASA	34,920	162.40	5,671,008.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,500	151.80	1,290,300.00	
	TELENOR ASA	28,118	165.00	4,639,470.00	
ノルウェー・クローネ 小計		221,846		30,923,457.16 (399,531,066)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,842	651.80	2,504,215.60	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	8,412	297.90	2,505,934.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,066	553.20	3,908,911.20	
	ISS A/C	6,717	199.20	1,338,026.40	
	"DSV, DE SAMMENSLUT VOGN"	7,118	535.20	3,809,553.60	
	A P MOLLER MAERSK A/S	242	9,150.00	2,214,300.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	139	8,600.00	1,195,400.00	
	PANDORA A/S	4,456	319.50	1,423,692.00	
	CARLSBERG B	3,882	789.40	3,064,450.80	
	COLOPLAST B	4,418	627.00	2,770,086.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,640	200.40	729,456.00	
	GENMAB A/S	2,259	990.00	2,236,410.00	
	H. LUNDBECK A/S	2,404	290.40	698,121.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	67,048	327.00	21,924,696.00	
	DANSKE BANK A/S	27,552	126.10	3,474,307.20	
	TRYG A/S	4,970	173.80	863,786.00	
ORSTED A/S	7,185	479.70	3,446,644.50		

デンマーク・クローネ 小計		161,350		58,107,991.70 (979,119,660)
イスラエル・シェケル	INTL FLAVORS AND FRAGR	374	471.00	176,154.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,712	20.31	420,660.72
	ELBIT SYSTEMS LTD	923	477.00	440,271.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	32,993	65.08	2,147,184.44
	BANK HAPOALIM BM	39,163	24.44	957,143.72
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,809	23.86	1,236,162.74
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,788	67.94	393,236.72
	AZRIELI GROUP	1,403	198.10	277,934.30
	NICE LTD	2,072	416.00	861,952.00
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	72,807	3.14	228,395.55
イスラエル・シェケル 小計		228,044		7,139,095.19 (218,456,312)
ユーロ	ENAGAS	8,825	24.66	217,624.50
	ENI SPA	94,295	15.20	1,433,095.41
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	19,749	14.41	284,583.09
	NESTE OYJ	4,680	86.22	403,509.60
	OMV AG	5,438	45.96	249,930.48
	REPSOL SA	51,324	15.11	775,505.64
	SNAM SPA	84,309	4.20	353,929.18
	TECHNIPFMC PLC	6,886	20.87	143,710.82
	TENARIS SA	17,691	11.95	211,318.99
	TOTAL SA	88,621	49.51	4,387,625.71
	VOPAK	2,328	43.45	101,151.60
	AIR LIQUIDE	15,893	106.80	1,697,372.40
	AKZO NOBEL	8,246	82.24	678,151.04
	ARKEMA	2,434	83.88	204,163.92
	BASF SE	34,162	65.86	2,249,909.32
	COVESTRO	7,514	50.32	378,104.48
	CRH	30,950	27.42	848,649.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,589	25.14	165,647.46
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,442	41.12	100,415.04
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,711	64.40	367,788.40
	IMERYS SA	1,606	49.76	79,914.56
	KONINKLIJKE DSM N.V	6,694	93.56	626,290.64
	LANXESS AG	3,179	48.50	154,181.50
	LINDE PLC	9,641	148.75	1,434,098.75
	NLG) ARCELORMITTAL	24,031	19.83	476,582.79
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,322	26.50	220,533.00
	SOLVAY	2,746	99.32	272,732.72
	STORA ENSO OYJ-R SHS	21,462	11.93	256,041.66
	SYMRISE AG	4,674	76.92	359,524.08
	THYSSENKRUPP AG	15,587	13.16	205,124.92
	UMICORE	7,922	35.72	282,973.84
	UPM-KYMMENE	19,547	26.75	522,882.25
	VOESTALPINE AG	4,269	25.58	109,201.02
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,299	37.50	348,712.50	

ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	9,299	0.49	4,594.63
AIRBUS SE	21,579	111.14	2,398,290.06
ALSTOM	5,510	37.59	207,120.90
ANDRITZ AG	3,120	44.44	138,652.80
BOUYGUES SA	8,005	30.82	246,714.10
BRENTAG AG	5,838	43.27	252,610.26
CIE DE SAINT-GOBAIN	18,301	32.79	599,998.28
CNH INDUSTRIAL NV	39,212	9.27	363,338.39
DASSAULT AVIATION	90	1,339.00	120,510.00
EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV IS10	2,896	83.26	241,120.96
FERROVIAL SA	17,836	19.86	354,222.96
GEA GROUP AG NPV	5,542	20.87	115,661.54
HOCHTIEF	724	134.80	97,595.20
KINGSPAN GROUP PLC	5,384	38.90	209,437.60
KION GROUP AG	2,904	54.04	156,932.16
KONE OYJ	12,362	44.40	548,872.80
LEGRAND PROMESSES EUR4	9,674	57.42	555,481.08
LEONARDO SPA	16,864	8.80	148,403.20
METSO OYJ	3,699	28.85	106,716.15
MTU AERO ENGINES AG	1,924	196.10	377,296.40
OSRAM LICHT AG	3,817	39.96	152,527.32
PRYSMIAN SPA EURO.10	8,540	18.74	159,996.90
REXEL SA	11,359	11.13	126,368.87
SAFRAN SA	12,258	115.80	1,419,476.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,384	67.88	1,383,665.92
SIEMENS AG	28,471	94.05	2,677,697.55
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	9,970	13.54	134,993.80
THALES SA	3,835	106.95	410,153.25
VINCI SA	18,653	80.28	1,497,462.84
WARTSILA OYJ	16,662	14.36	239,266.32
BIC	1,100	82.35	90,585.00
BUREAU VERITAS	10,721	19.51	209,113.10
EDENRED	8,597	37.50	322,387.50
RANDSTAD NV	4,471	45.73	204,458.83
RELX PLC	32,751	19.27	631,111.77
TELEPERFORMANCE	2,134	154.10	328,849.40
WOLTERS KLUWER CVA	10,875	55.20	600,300.00
ADP	1,095	172.20	188,559.00
AENA SME SA	2,445	153.90	376,285.50
ATLANTIA SPA	18,674	20.84	389,166.16
BOLLORE	29,695	3.63	107,911.63
DEUTSCHE POST AG-REG	36,291	26.39	957,719.49
FRAPORT AG NPV	1,722	70.60	121,573.20
GETLINK SE	17,009	12.70	215,929.25
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	22,795	7.40	168,591.82
LUFTHANSA	9,306	22.38	208,268.28
BAYER MOTOREN WERKEUR1	12,217	71.04	867,895.68

BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	2,336	62.00	144,832.00
CONTINENTAL	4,049	139.00	562,811.00
DAIMLER AG	33,759	50.46	1,703,479.14
FAURECIA	2,768	40.90	113,211.20
FERRARI NV	4,485	111.20	498,732.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	39,546	13.01	514,493.46
MICHELIN B	6,256	101.30	633,732.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,789	29.96	143,478.44
PEUGEOT SA	20,567	21.57	443,630.19
PIRELLI & C SPA	13,965	5.89	82,253.85
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	5,856	55.58	325,476.48
RENAULT SA	7,227	58.92	425,814.84
VALEO SA	8,697	27.16	236,210.52
VOLKSWAGEN STAMM	1,284	146.80	188,491.20
VOLKSWAGEN VORZUG	6,850	143.18	980,783.00
ADIDAS AG	6,920	201.80	1,396,456.00
ESSILORLUXOTTICA	10,505	105.90	1,112,479.50
HERMES INTERNATIONAL	1,150	545.40	627,210.00
HUGO BOSS AG -ORD	2,514	64.06	161,046.84
KERING	2,778	475.20	1,320,105.60
LVMH	10,248	297.25	3,046,218.00
MONCLER SPA	6,569	34.84	228,863.96
PUMA SE	245	459.50	112,577.50
SEB	886	138.90	123,065.40
ACCOR SA	6,978	39.85	278,073.30
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,903	69.25	201,032.75
SODEXO	3,342	94.94	317,289.48
AXEL SPRINGER SE	1,652	52.60	86,895.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,348	18.23	115,692.30
JC DECAUX SA	2,913	27.56	80,282.28
PROSIEBEN SAT 1 MEDIA SE	9,642	15.33	147,763.65
PUBLICIS GROUPE	7,630	48.64	371,123.20
RTL GROUP	1,727	47.00	81,169.00
SES	12,867	17.74	228,260.58
TELENET GROUP HOLDING NV	1,970	39.28	77,381.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,804	67.86	190,279.44
VIVENDI SA	39,162	23.84	933,622.08
DELIVERY HERO SE	3,268	35.24	115,164.32
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	40,350	25.77	1,039,819.50
ZALANDO SE	3,912	26.67	104,333.04
CARREFOUR	22,319	18.07	403,304.33
CASINO ORD	1,748	43.80	76,562.40
COLRUYT NV	2,574	62.28	160,308.72
JERONIMO MARTINS	10,993	12.54	137,852.22
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	45,699	23.04	1,052,676.46
METRO AG	6,776	14.89	100,894.64

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	28,326	67.76	1,919,369.76
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	7,800	41.40	322,920.00
DANONE	22,676	66.39	1,505,459.64
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	20,050	8.25	165,412.50
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	4,005	84.35	337,821.75
HEINEKEN NV	9,548	87.78	838,123.44
KERRY GROUP A	5,755	89.20	513,346.00
PERNOD RICARD	7,846	149.45	1,172,584.70
REMY COINTREAU	796	111.60	88,833.60
BEIERSDORF	3,614	91.40	330,319.60
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	6,547	87.84	575,088.48
HENKEL KGAA	3,965	81.30	322,354.50
L'OREAL	9,355	223.10	2,087,100.50
UNILEVER NV CVA	57,400	49.02	2,813,748.00
BIOMERIEUX	1,392	69.70	97,022.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	7,914	67.48	534,036.72
FRESENIUS SE & CO KGaA	15,368	46.68	717,378.24
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,825	34.75	1,209,994.62
SARTORIUS AG-VORZUG	1,288	153.20	197,321.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5,894	35.88	211,447.25
BAYER AG	34,379	67.80	2,330,896.20
EUROFINS SCIENTIFIC	430	350.20	150,586.00
GRIFOLS SA	11,668	23.83	278,048.44
IPSEN	1,318	124.95	164,684.10
MERCK KGAA	4,940	96.96	478,982.40
ORION OYJ	3,906	28.72	112,180.32
QIAGEN N.V.	8,251	34.20	282,184.20
RECORDATI	4,449	33.35	148,374.15
SANOFI	41,595	74.67	3,105,898.65
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	902	102.50	92,455.00
UCB SA	4,531	78.78	356,952.18
ABN AMRO GROUP	15,750	20.90	329,175.00
AIB GROUP PLC	29,132	3.94	114,780.08
BANCA INTESA SPA	555,253	2.06	1,141,322.54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	247,150	5.19	1,282,461.35
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192		
BANCO SANTANDER SA	605,069	4.08	2,471,101.79
BANK OF IRELAND GROUP PLC	36,992	5.48	202,716.16
BANKIA SA	36,633	2.59	94,769.57
BANKINTER, S.A.	26,337	6.93	182,462.73
BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV	211,266	0.95	200,575.94
BNP PARIBAS	41,762	42.24	1,764,026.88
CAIXABANK	134,690	3.05	410,804.50
COMMERZBANK AG	37,296	6.62	246,713.04
CREDIT AGRICOLE SA	41,496	10.46	433,882.17

ERSTE GROUP BANK AG	11,231	31.98	359,167.38
ING GROUP N.V.	144,196	11.07	1,596,538.11
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	9,453	62.00	586,086.00
MEDIOBANCA	23,487	8.29	194,660.25
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,358	22.65	121,358.70
SOCIETE GENERALE-A	28,346	25.04	709,783.84
UNICREDIT SPA	74,172	11.42	846,747.55
AMUNDI SA	2,166	55.56	120,342.96
DEUTSCHE BANK AG-REG	74,072	7.59	562,428.69
DEUTSCHE BOERSE AG	7,108	110.75	787,211.00
EURAZEO	1,565	64.50	100,942.50
EXOR NV	3,988	56.00	223,328.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,025	82.92	250,833.00
NATIXIS	34,559	4.41	152,232.39
WENDEL	1,178	104.80	123,454.40
AEGON NV	63,732	4.64	295,397.82
AGEAS	6,758	41.96	283,565.68
ALLIANZ	15,870	191.04	3,031,804.80
ASSICURAZIONI GENERALI	44,078	15.17	668,442.87
AXA	71,912	20.79	1,495,050.48
CNP ASSURANCES	6,177	20.44	126,257.88
HANNOVER RUECK SE	2,358	130.00	306,540.00
MAPFRE SA	44,197	2.46	108,547.83
MUENCHENER RUECK AG-REG	5,483	205.00	1,124,015.00
NN GROUP NV	10,990	37.99	417,510.10
POSTE ITALIANE	18,953	7.75	146,885.75
SAMPO INSURANCE CO A	16,279	42.50	691,857.50
SCOR SE	6,412	38.32	245,707.84
AROUNDTOWN SA	27,084	7.54	204,213.36
DEUTSCHE WOHNEN SE	13,558	42.41	574,994.78
VONOVIA SE	18,290	44.15	807,503.50
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	16,082	68.74	1,105,476.68
ATOS SE	3,595	83.08	298,672.60
CAPGEMINI SA	6,026	102.00	614,652.00
DASSAULT SYSTEMES	4,742	127.35	603,893.70
SAP SE	36,589	94.02	3,440,097.78
WIRECARD AG	4,489	120.25	539,802.25
INGENICO GROUP	2,503	56.48	141,369.44
NOKIA OYJ	206,340	5.40	1,113,410.64
1&1 DRILLISCH AG	1,710	34.22	58,516.20
DEUTSCHE TELEKOM	123,642	14.48	1,790,336.16
ELISA CORP-A SHARES	5,535	36.28	200,809.80
ILIAD SA	1,039	91.30	94,860.70
KPN (KON. PTT NEDERLAND	124,344	2.73	339,832.15
ORANGE S.A.	73,724	13.66	1,006,701.22
PROXIMUS	5,161	22.66	116,948.26
TELECOM ITALIA SPA	422,077	0.54	226,317.68
TELECOM ITALIA-RNC	260,935	0.46	120,082.28

TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	3.03	83,837.83	
TELEFONICA S.A.	171,681	7.60	1,304,775.60	
UNITED INTERNET	4,853	32.37	157,091.61	
E.ON SE	82,995	9.70	804,968.50	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	92,540	3.27	302,605.80	
ELEC DE FRANCE EURO.5	22,220	13.39	297,525.80	
ENDESA SA	12,380	21.65	268,027.00	
ENEL SPA	299,001	5.23	1,562,579.22	
ENGIE	67,349	14.09	948,610.66	
FORTUM OYJ	16,606	19.58	325,145.48	
IBERDROLA SA	231,034	7.23	1,669,913.75	
INNOGY SE-NEW	5,459	37.38	204,030.12	
NATURGY ENERGY GROUP SA	13,145	23.84	313,376.80	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,439	19.35	298,667.45	
RWE AG	18,796	22.38	420,654.48	
SUEZ	12,964	11.41	147,919.24	
TERNA SPA	51,695	5.32	274,914.01	
UNIPER SE	7,326	26.05	190,842.30	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,422	19.30	355,544.60	
VERBUND AG	2,201	43.18	95,039.18	
ASML HOLDING NV	15,192	161.14	2,448,038.88	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	42,974	19.77	849,595.98	
STMICROELECTRONICS NV	24,753	14.48	358,423.44	
ユーロ 小計	7,507,497		138,553,131.89 (17,418,899,741)	
合計	41,887,969		144,448,525,789 (144,448,525,789)	

(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	14,000	247,660.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	3,700	502,053.00	
		AMERICAN TOWER CORP	16,392	2,911,219.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	42,800	435,704.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,115	1,004,841.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,850	787,468.50	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	5,466	109,483.98	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,706	366,152.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	15,166	1,822,194.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,800	907,998.00	
		DUKE REALTY CORP	13,600	406,368.00	
		EQUINIX INC	2,927	1,260,336.93	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	13,643	1,003,169.79	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,437	682,944.88	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,700	465,817.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,700	365,391.00	
		HCP INC	17,200	532,512.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	27,648	512,040.96	
		INVITATION HOMES INC	12,000	283,560.00	
		IRON MOUNTAIN INC	10,457	370,073.23	
		KIMCO REALTY CORP	16,600	295,148.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,300	252,227.00	
		MACERICH CO/THE	3,841	169,772.20	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	4,437	461,448.00	
		NATIONAL RETAIL PPTYS	5,800	303,108.00	
		PROLOGIS INC	23,411	1,671,077.18	
		PUBLIC STORAGE	5,930	1,232,906.30	
		REALTY INCOME CORP	10,674	746,326.08	
		REGENCY CENTERS CORP	5,600	372,792.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,400	807,620.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	11,380	2,073,777.40	
		SL GREEN REALTY CORP	3,400	313,106.00	
		UDR INC	9,800	438,256.00	
		VENTAS INC COM	13,400	867,382.00	
VEREIT INC	35,292	291,511.92			
VORNADO REALTY TRUST	6,259	430,556.61			
WELLTOWER INC	13,691	1,050,921.16			
WEYERHAEUSER CO	28,060	718,055.40			
WP CAREY INC	6,000	451,140.00			
アメリカ・ドル 小計		440,582	27,924,121.17	(3,092,596,419)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TR-REIT UNIT	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TR-REIT UNIT	5,913	133,988.58	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,000	125,850.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,100	71,211.00	
カナダ・ドル 小計		13,013	331,049.58	(27,755,196)	

オーストラリア・ドル	DEXUS	35,987	434,003.22	
	GOODMAN GROUP	60,261	774,956.46	
	GPT GROUP	63,545	379,999.10	
	MIRVAC GROUP	135,147	351,382.20	
	SCENTRE GROUP	199,664	800,652.64	
	STOCKLAND	89,428	337,143.56	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-CDI	27,160	311,525.20	
	VINCINITY CENTERS	115,382	290,762.64	
オーストラリア・ドル 小計		726,574	3,680,425.02	(291,600,074)
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	34,396	200,666.26	
	HAMMERSON	33,098	124,812.55	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,622	234,646.30	
	SEGRO PLC	36,474	235,986.78	
イギリス・ポンド 小計		130,590	796,111.89	(115,165,546)
香港・ドル	LINK REIT	79,487	7,058,445.60	
香港・ドル 小計		79,487	7,058,445.60	(99,594,667)
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	106,523	296,133.94	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	112,946	212,338.48	
	CAPITALAND MALL TRUST	97,221	234,302.61	
	SUNTEC REAL ESTAIITE INVESTMENT TRUST	72,600	138,666.00	
シンガポール・ドル 小計		389,290	881,441.03	(72,163,577)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,671,480		
	COVIVIO	1,467	130,342.95	
	GECINA SA	1,691	215,602.50	
	ICADE	1,152	84,556.80	
	KLEPIERRE	7,517	229,118.16	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,866	554,925.64	
ユーロ 小計		1,687,173	1,214,546.05	(152,692,729)
投資証券 小計			3,851,568,208	(3,851,568,208)
合計			3,851,568,208	(3,851,568,208)

(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 595銘柄	96.9%		68.1%
	投資証券 39銘柄		3.1%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.5%		3.7%
	投資証券 3銘柄		0.5%	

オーストラリア・ドル	株式	62銘柄	92.5%		2.6%
	投資証券	8銘柄		7.5%	
イギリス・ポンド	株式	93銘柄	98.8%		6.4%
	投資証券	4銘柄		1.2%	
スイス・フラン	株式	38銘柄	100.0%		3.3%
香港・ドル	株式	40銘柄	95.2%		1.4%
	投資証券	1銘柄		4.8%	
シンガポール・ドル	株式	21銘柄	90.5%		0.5%
	投資証券	4銘柄		9.5%	
ニュージーランド・ドル	株式	7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%		0.3%
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	243銘柄	99.1%		11.8%
	投資証券	6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	（2018年 2月20日現在）	（2019年 2月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		299,740,364	260,140,815
金銭信託			785,872
コール・ローン		609,876,791	98,736,930
国債証券		170,414,230,356	144,429,871,714
派生商品評価勘定		3,366,020	12,000
未収入金		2,134,152,277	
未収利息		1,550,204,681	1,205,972,511
前払費用		69,433,004	59,399,221
流動資産合計		175,081,003,493	146,054,919,063
資産合計		175,081,003,493	146,054,919,063
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,636,780	33,000
未払解約金		2,656,367,475	60,374,892
未払利息		1,494	251
その他未払費用		27	210
流動負債合計		2,662,005,776	60,408,353

負債合計		2,662,005,776	60,408,353
純資産の部			
元本等			
元本	1	77,182,711,057	64,007,469,031
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		95,236,286,660	81,987,041,679
元本等合計		172,418,997,717	145,994,510,710
純資産合計		172,418,997,717	145,994,510,710
負債純資産合計		175,081,003,493	146,054,919,063

## (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	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
1 期首元本額	77,564,966,368円	77,182,711,057円
期中追加設定元本額	25,053,106,381円	17,652,006,111円
期中一部解約元本額	25,435,361,692円	30,827,248,137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	6,076,236,717円	6,151,926,579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	15,429,335円	16,224,013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)	833,067,117円	819,834,527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 >	1,596,144,047円	1,546,466,428円
外国債券パッシブ・ファンド < 適格機関投資家限定 >	4,518,555,346円	2,772,355,475円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	6,749,287円	4,992,225円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	583,058,359円	377,645,298円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	126,173円	84,219円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	13,651,893円	7,628,195円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	4,926,406円	4,251,183円
バランスファンドVA50B < 適格機関投資家限定 >	9,871,594,017円	8,259,856,676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 >	162,712,156円	106,604,554円
バランスファンドVA50C < 適格機関投資家限定 >	5,467,273円	3,165,556円
バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	3,995,096,333円	3,396,546,005円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	1,687,498,029円	1,492,658,471円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	48,699,879円	36,624,722円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	388,121,001円	269,254,164円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	1,770,606,375円	1,260,005,070円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	770,992,381円	533,211,369円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	4,305,192,661円	3,590,404,794円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	259,153,691円	107,507,805円
世界4資産バランスVA45 < 適格機関投資家限定 >	1,022,999,665円	187,022,504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 >	148,486,341円	148,688,336円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	115,433,041円	100,878,655円

グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	64,486,625円	58,728,277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>	2,756,934,395円	3,894,205,578円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	44,825,337円	37,363,302円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	739,755,576円	668,782,969円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	4,873,913円	3,809,488円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,356,085円	2,356,085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>	21,064,756,713円	13,787,084,927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>	342,097,231円	618,524,266円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	1,246,040,914円	1,136,987,195円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	2,154,852,285円	1,927,690,179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>	2,339,976,199円	1,094,196,514円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	38,350,078円	33,525,745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>	462,045,560円	136,849,852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>	818,036,666円	534,530,098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>	256,221,567円	393,259,414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>	135,817,547円	120,956,525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	99,659,339円	133,205,198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)	2,509,364,978円	3,618,286,122円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド(年金)/為替ヘッジ付<適格機関投資家限定>	201,979,430円	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>	2,666,123,350円	3,834,415,948円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	144,902,678円	4,182,372円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	756,530,244円	664,153,566円

グローバルバランス40VA3 <適格 機関投資家限定>	114,788,447円	93,605,621円
グローバルバランス50VA <適格機 関投資家限定>	17,938,377円	16,932,967円
計	77,182,711,057円	64,007,469,031円
2 受益権の総数	77,182,711,057口	64,007,469,031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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	(2018年 2月20日現在)	(2019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	3,768,215,864	958,577,648
合計	3,768,215,864	958,577,648

## (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	(2018年 2月20日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評価損益

市場取引 以外の取 引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	1,041,098,100		1,046,542,000	5,443,900
	カナダ・ドル	85,106,500		85,020,000	86,500
	オーストラリア・ドル	42,192,450		42,300,000	107,550
	イギリス・ポンド	149,850,200		149,440,000	410,200
	シンガポール・ドル	34,902,240		34,963,300	61,060
	メキシコ・ペソ	1,722,210		1,725,000	2,790
	ポーランド・ズロチ	9,590,520		9,612,000	21,480
	南アフリカ・ランド	2,742,570		2,742,000	570
	ユーロ	996,918,750		994,050,000	2,868,750
	合 計	2,364,123,540		2,366,394,300	2,270,760

(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。

## (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)

	(2018年 2月20日現在)	(2019年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	2.2339円	2.2809円
(1万口当たり純資産額)	(22,339円)	(22,809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	500,000	612,560.00	
		US TREASURY N/B 1.88% 21/11/30	4,000,000	3,935,920.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/11/30	8,000,000	7,862,800.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 23/05/31	4,000,000	3,862,040.00	
		US TREASURY N/B 2.13% 23/11/30	4,500,000	4,428,270.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	4,480,000	4,296,947.20	
		US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	3,200,000	3,637,632.00	
		US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	4,500,000	4,091,850.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	1,500,000	1,857,885.00	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000	1,209,618.00	
		US TREASURY N/B 3.63% 20/02/15	8,800,000	8,889,056.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 20/02/29	8,300,000	8,191,353.00	
		US TREASURY N/B 1.13% 20/03/31	9,200,000	9,059,516.00	
		US TREASURY N/B 1.13% 20/04/30	6,500,000	6,391,840.00	
		US TREASURY N/B 3.5% 20/05/15	7,000,000	7,079,310.00	
		US TREASURY N/B 1.38% 20/05/31	7,800,000	7,685,730.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 20/06/30	9,400,000	9,286,542.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 20/07/31	5,000,000	4,961,350.00	
		US TREASURY N/B 2.63% 20/08/15	6,900,000	6,908,073.00	
		US TREASURY N/B 1.38% 20/08/31	7,200,000	7,074,864.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 20/09/30	9,500,000	9,420,200.00	
		US TREASURY N/B 2.63% 20/11/15	7,500,000	7,509,675.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 20/11/30	10,200,000	10,105,956.00	
		US TREASURY N/B 2.38% 20/12/31	9,000,000	8,975,790.00	
		US TREASURY N/B 1.38% 21/01/31	7,500,000	7,337,100.00	
		US TREASURY N/B 3.63% 21/02/15	7,500,000	7,660,575.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/02/28	8,500,000	8,413,980.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 21/03/31	9,000,000	8,952,570.00	
		US TREASURY N/B 1.38% 21/04/30	2,900,000	2,830,574.00	
		US TREASURY N/B 3.13% 21/05/15	7,500,000	7,601,400.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/05/31	8,000,000	7,913,440.00	
		US TREASURY N/B 1.13% 21/06/30	8,500,000	8,239,390.00	
		US TREASURY N/B 2.13% 21/08/15	8,000,000	7,930,000.00	
		US TREASURY N/B 2.75% 21/09/15	3,800,000	3,825,536.00	
		US TREASURY N/B 2.13% 21/09/30	4,500,000	4,459,410.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/11/15	7,000,000	6,913,620.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/12/31	5,000,000	4,935,950.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/02/15	4,700,000	4,636,315.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/02/28	5,650,000	5,531,915.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/03/31	3,500,000	3,425,065.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/05/15	3,200,000	3,128,384.00	
		US TREASURY N/B 2.13% 22/06/30	5,500,000	5,439,005.00	
US TREASURY N/B 1.88% 22/07/31	5,500,000	5,392,365.00			
US TREASURY N/B 1.63% 22/08/15	2,000,000	1,943,440.00			

US TREASURY N/B 1.63% 22/08/31	3,900,000	3,788,499.00	
US TREASURY N/B 1.75% 22/09/30	8,000,000	7,800,640.00	
US TREASURY N/B 1.88% 22/10/31	3,500,000	3,425,905.00	
US TREASURY N/B 1.63% 22/11/15	7,000,000	6,788,390.00	
US TREASURY N/B 2.13% 22/12/31	6,000,000	5,922,180.00	
US TREASURY N/B 1.75% 23/01/31	4,800,000	4,669,104.00	
US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	7,000,000	6,872,880.00	
US TREASURY N/B 2.63% 23/02/28	5,500,000	5,530,525.00	
US TREASURY N/B 1.5% 23/03/31	5,500,000	5,290,945.00	
US TREASURY N/B 1.75% 23/05/15	8,200,000	7,959,740.00	
US TREASURY N/B 1.38% 23/06/30	2,500,000	2,386,325.00	
US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	5,500,000	5,504,950.00	
US TREASURY N/B 2.75% 23/08/31	3,000,000	3,035,520.00	
US TREASURY N/B 1.38% 23/09/30	6,000,000	5,712,900.00	
US TREASURY N/B 2.88% 23/09/30	1,800,000	1,830,726.00	
US TREASURY N/B 1.63% 23/10/31	3,500,000	3,368,085.00	
US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	5,000,000	5,059,550.00	
US TREASURY N/B 2.25% 23/12/31	3,800,000	3,760,062.00	
US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	3,000,000	3,036,930.00	
US TREASURY N/B 2.13% 24/02/29	4,000,000	3,932,360.00	
US TREASURY N/B 2.13% 24/03/31	3,500,000	3,439,450.00	
US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	4,500,000	4,501,575.00	
US TREASURY N/B 2.0% 24/06/30	4,000,000	3,900,800.00	
US TREASURY N/B 2.38% 24/08/15	5,000,000	4,966,800.00	
US TREASURY N/B 1.88% 24/08/31	4,500,000	4,356,405.00	
US TREASURY N/B 2.13% 24/09/30	4,400,000	4,312,000.00	
US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	5,500,000	5,421,350.00	
US TREASURY N/B 2.25% 24/12/31	5,000,000	4,927,350.00	
US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	7,500,000	7,279,425.00	
US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	7,000,000	7,087,780.00	
US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	4,000,000	4,021,240.00	
US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	5,000,000	4,880,450.00	
US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	3,400,000	3,467,082.00	
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	6,500,000	6,288,750.00	
US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	5,500,000	5,651,690.00	
US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	5,000,000	4,906,250.00	
US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	2,500,000	2,550,400.00	
US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	4,000,000	3,761,400.00	
US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	3,500,000	3,283,455.00	
US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	4,100,000	3,800,495.00	
US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	4,500,000	4,388,220.00	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	4,300,000	4,229,136.00	
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	4,700,000	4,570,374.00	
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	3,700,000	3,592,034.00	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	6,400,000	6,460,480.00	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	7,000,000	7,134,540.00	
US TREASURY N/B 5.5% 28/08/15	1,100,000	1,361,382.00	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	2,300,000	2,344,022.00	

US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	5,300,000	5,515,498.00	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	500,000	626,465.00	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	3,000,000	3,301,650.00	
US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	2,100,000	2,551,164.00	
US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	2,000,000	2,469,300.00	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	1,500,000	1,733,205.00	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	800,000	973,096.00	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,100,000	1,428,713.00	
US TREASURY N/B 4.38% 41/05/15	1,500,000	1,857,240.00	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	1,100,000	1,248,368.00	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	1,700,000	1,752,071.00	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	1,000,000	1,030,200.00	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	1,500,000	1,511,430.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	1,000,000	964,300.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	2,300,000	2,215,107.00	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	2,000,000	2,054,140.00	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	3,200,000	3,146,752.00	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	3,000,000	3,342,540.00	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	3,800,000	4,236,544.00	
US TREASURY N/B 3.38% 44/05/15	3,000,000	3,212,580.00	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	3,700,000	3,799,567.00	
US TREASURY N/B 3.0% 44/11/15	3,100,000	3,114,787.00	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	2,500,000	2,282,125.00	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	3,000,000	3,013,830.00	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	2,700,000	2,648,538.00	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	3,200,000	3,215,008.00	
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	5,200,000	4,480,944.00	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	4,500,000	4,410,180.00	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	6,300,000	6,326,838.00	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	3,100,000	3,110,044.00	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	3,200,000	3,051,616.00	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	3,000,000	2,859,270.00	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	1,800,000	1,802,466.00	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	2,400,000	2,462,352.00	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	3,800,000	4,093,018.00	
US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	700,000	863,135.00	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	500,000	660,100.00	
US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000	2,437,580.00	
US TREASURY N/B 6.5% 26/11/15	1,000,000	1,273,520.00	
US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	800,000	1,018,688.00	
US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	2,500,000	3,177,650.00	
US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	3,000,000	3,474,960.00	
US TREASURY N/B 8.0% 21/11/15	7,200,000	8,238,960.00	
アメリカ・ドル 小計	602,130,000	603,390,901.20 (66,825,542,307)	

カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/06/01	5,000,000	5,163,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	1,000,000	1,354,190.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 20/06/01	4,200,000	4,290,426.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.75% 20/09/01	2,600,000	2,560,142.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 22/06/01	4,000,000	4,120,840.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	2,900,000	2,864,649.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	1,500,000	1,551,960.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	1,450,000	1,485,380.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	650,000	633,958.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	1,400,000	1,412,040.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	1,080,000	1,371,070.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	1,400,000	1,583,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	400,000	473,620.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	1,000,000	1,460,320.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 41/06/01	1,000,000	1,323,370.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	1,100,000	1,578,951.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 8.0% 27/06/01	1,400,000	2,050,818.00	
カナダ・ドル 小計		32,080,000	35,278,234.80 (2,957,727,205)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/15	1,100,000	1,133,697.07	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 20/11/21	2,500,000	2,498,914.65	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 21/12/21	1,000,000	1,008,720.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 22/07/15	2,450,000	2,778,224.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	3,000,000	3,458,917.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,100,000	2,201,634.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	2,100,000	2,267,809.11	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,400,000	1,613,255.14	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	2,250,000	2,707,067.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	2,900,000	3,051,333.31	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	1,300,000	1,313,588.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 28/11/21	1,000,000	1,053,844.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	5,100,000	5,616,571.35	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,250,000	1,584,961.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	750,000	785,515.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	1,000,000	1,112,054.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	1,100,000	1,169,871.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	600,000	712,057.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 21/05/15	2,100,000	2,283,297.03	
オーストラリア・ドル 小計		35,000,000	38,351,335.48 (3,038,576,310)	

イギリス・ボンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	1,700,000	2,750,807.40	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	1,400,000	2,177,000.00	
	UK GILT BOND 8.0% 21/06/07	1,400,000	1,632,410.64	
	UK GILT BOND 3.75% 21/09/07	2,100,000	2,259,684.00	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	1,280,000	1,813,388.80	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	980,000	1,427,615.00	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	1,750,000	3,009,142.50	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,500,000	1,862,103.00	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	3,700,000	3,936,764.48	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	1,100,000	1,176,729.40	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,500,000	1,556,691.60	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	1,350,000	1,992,262.50	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	1,800,000	2,475,432.00	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	1,600,000	2,468,387.20	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	1,600,000	2,244,848.00	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	1,100,000	1,516,460.00	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	1,500,000	2,172,735.00	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	1,500,000	1,521,509.40	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	850,000	885,615.00	
	UK GILT BOND 1.75% 22/09/07	2,950,000	3,050,943.10	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	420,000	544,156.20	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	1,300,000	1,432,145.00	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	2,100,000	3,459,819.30	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	1,600,000	2,102,819.20	
	UK GILT BOND 4.0% 22/03/07	1,750,000	1,921,486.00	
	UK GILT BOND 3.75% 20/09/07	3,100,000	3,243,220.00	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	3,000,000	4,691,925.60	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,300,000	1,749,319.00	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,300,000	1,646,593.00	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	1,400,000	2,417,534.00	
UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	1,250,000	1,917,330.00		
UK GILT BOND 4.75% 20/03/07	200,000	208,301.60		
UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	1,100,000	1,122,539.00		
イギリス・ボンド 小計		52,480,000	68,387,716.92 (9,892,967,129)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	400,000	408,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	580,000	616,830.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	330,000	371,093.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	620,000	643,560.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	490,000	507,108.35	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.13% 22/09/01	1,500,000	1,559,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.25% 20/09/01	1,930,000	1,967,432.35	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	1,000,000	1,102,700.00	
シンガポール・ドル 小計		6,850,000	7,176,623.95 (587,550,202)	

マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	3,500,000	3,375,724.83	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.16% 21/07/15	1,300,000	1,317,372.55	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.42% 22/08/15	6,075,000	6,021,405.56	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	3,200,000	3,167,780.41	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	3,000,000	3,008,075.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,000,000	1,997,181.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	1,300,000	1,342,420.82	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.13% 32/04/15	1,750,000	1,727,434.62	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,400,000	1,448,256.74	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,200,000	1,199,315.78	
マレーシア・リンギット 小計		24,725,000	24,604,968.73 (669,255,149)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	4,500,000	4,781,484.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 22/06/01	9,900,000	11,133,421.20	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	7,900,000	8,520,928.94	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000	4,359,424.44	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	4,700,000	6,829,198.70	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 5.0% 20/12/01	7,500,000	8,230,791.00	
スウェーデン・クローナ 小計		38,700,000	43,855,248.28 (521,877,454)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	2,500,000	2,503,830.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/05/25	3,600,000	3,809,520.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	2,700,000	2,921,005.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 25/03/13	4,000,000	4,080,848.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	4,000,000	4,058,804.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	8,500,000	8,756,972.00	
ノルウェー・クローネ 小計		25,300,000	26,130,979.80 (337,612,259)	
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 3.0% 21/11/15	8,700,000	9,547,675.80	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15	7,000,000	7,622,790.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	5,000,000	5,658,345.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	4,000,000	4,167,800.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	10,300,000	18,340,476.64	
デンマーク・クローネ 小計		35,000,000	45,337,087.44 (763,929,923)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	12,000,000	11,331,000.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 20/06/11	20,000,000	19,956,200.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 21/06/10	38,000,000	36,715,220.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 23/12/07	25,000,000	24,875,750.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	32,000,000	34,748,160.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	21,800,000	20,779,978.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	11,000,000	11,096,470.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	7,500,000	8,416,350.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	7,500,000	7,353,150.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	14,500,000	13,085,815.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	10,500,000	9,683,095.59	
メキシコ・ペソ 小計		199,800,000	198,041,188.59 (1,144,678,070)	

ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 20/10/25	4,800,000	5,102,496.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 21/10/25	4,300,000	4,765,905.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25	4,800,000	5,222,160.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	3,800,000	4,000,070.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	2,600,000	2,594,618.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	3,500,000	4,464,740.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5% 19/10/25	1,300,000	1,338,688.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 22/09/23	3,000,000	3,402,270.00	
ポーランド・ズロチ 小計		28,100,000	30,890,947.00	(895,837,463)
南アフリカ・ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,200,000	9,130,080.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	21,500,000	23,383,400.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	21,000,000	17,263,050.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,000,000	10,679,400.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,000,000	10,081,511.55	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,500,000	10,764,750.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,000,000	22,182,500.00	
南アフリカ・ランド 小計		118,200,000	103,484,691.55	(816,494,216)
ユーロ	ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,800,000	2,056,723.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 21/09/28	1,600,000	1,796,745.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 22/09/28	1,450,000	1,692,135.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	1,400,000	1,553,105.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	1,940,000	2,215,809.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	1,300,000	1,357,324.54	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,500,000	1,955,636.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 26/06/22	500,000	527,220.40	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	1,000,000	1,032,145.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	1,380,000	1,413,349.08	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	900,000	915,833.70	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	600,000	831,198.12	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	850,000	877,971.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	400,000	410,570.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	430,000	471,306.91	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	1,300,000	2,001,498.20	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	760,000	1,127,132.44	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	950,000	950,487.35	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	430,000	460,165.79	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 22/03/28	1,200,000	1,364,855.52	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,900,000	2,750,367.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	1,550,000	2,434,065.75	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.85% 20/10/31	4,400,000	4,781,916.48	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 21/04/30	3,150,000	3,541,045.72	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.85% 22/01/31	3,800,000	4,463,385.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 0.45% 22/10/31	1,700,000	1,727,376.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	2,300,000	2,781,137.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,100,000	2,503,729.20		
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	1,600,000	1,950,352.00		

SPANISH GOVERNMENT BOND 3.8% 24/04/30	1,600,000	1,879,968.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	1,700,000	1,916,375.83	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	1,500,000	1,594,338.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	2,100,000	2,632,464.45	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	2,900,000	2,989,877.96	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,400,000	1,454,668.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	1,900,000	1,960,138.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	2,750,000	2,811,044.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	1,350,000	1,421,405.28	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,400,000	1,503,983.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,500,000	2,173,113.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	950,000	1,476,068.58	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	700,000	738,676.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	2,500,000	2,729,064.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/02/01	1,300,000	1,353,145.30	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 21/09/01	3,800,000	4,161,639.92	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	2,300,000	2,788,543.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	1,500,000	2,008,389.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	1,600,000	1,677,257.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	1,850,000	2,002,737.85	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	1,700,000	1,750,005.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	500,000	523,948.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 21/01/04	3,500,000	3,705,002.35	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	1,050,000	1,656,180.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	2,050,000	2,973,492.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.0% 20/07/04	2,600,000	2,727,841.22	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 20/09/04	3,000,000	3,130,950.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/04	2,600,000	2,836,230.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 21/09/04	2,000,000	2,143,474.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 22/01/04	2,700,000	2,898,949.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.75% 22/07/04	2,700,000	2,908,245.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 22/09/04	2,900,000	3,108,307.87	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	1,800,000	1,943,184.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	2,150,000	2,329,813.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/08/15	2,900,000	3,220,212.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	1,900,000	2,087,252.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	1,600,000	1,718,905.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,300,000	2,415,269.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	2,300,000	2,344,038.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	300,000	304,417.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	1,950,000	2,784,293.85	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	900,000	1,023,853.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	1,700,000	2,258,405.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/08/01	3,600,000	3,849,260.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	1,500,000	1,824,078.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	3,800,000	4,619,732.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	2,050,000	2,634,692.18	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	2,900,000	3,766,805.65	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/11/01	3,300,000	4,292,050.29	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 20/03/01	3,900,000	4,061,033.34	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 20/09/01	3,400,000	3,585,123.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/03/01	3,800,000	4,038,963.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.15% 21/12/15	1,300,000	1,341,453.36	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 22/03/01	2,800,000	3,119,284.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 22/08/01	100,000	98,715.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/09/01	2,700,000	3,084,652.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/11/01	3,500,000	4,007,860.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.95% 23/03/15	2,900,000	2,838,421.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	3,600,000	4,079,880.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.65% 23/10/15	500,000	478,571.76	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	1,800,000	2,026,600.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.85% 24/05/15	2,300,000	2,298,153.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 24/09/01	2,100,000	2,291,709.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	4,200,000	4,884,768.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	2,400,000	2,313,830.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	500,000	477,790.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	1,600,000	1,481,246.59	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,400,000	1,368,550.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	3,500,000	4,109,083.30	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	400,000	401,193.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	950,000	817,474.23	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	500,000	461,902.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	1,100,000	962,500.69	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	1,200,000	1,122,430.92	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	2,000,000	2,423,620.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	1,500,000	1,779,405.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	1,600,000	1,527,280.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	1,000,000	865,710.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	1,200,000	1,165,941.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	350,000	287,488.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,700,000	2,457,304.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	2,000,000	3,012,556.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	1,700,000	2,734,756.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	1,100,000	1,890,312.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,500,000	2,488,497.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,150,000	2,128,558.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,200,000	1,955,964.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	1,300,000	1,724,225.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	750,000	1,250,403.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,200,000	1,866,344.76	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	1,400,000	1,417,178.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.38% 20/04/15	1,000,000	1,045,046.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.5% 21/04/15	650,000	705,781.24	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	1,100,000	1,182,184.30	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.0% 24/04/15	600,000	667,416.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	350,000	360,545.15	

FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	250,000	255,372.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	350,000	429,112.25	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	350,000	356,774.95	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	300,000	316,142.10	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	470,000	641,145.80	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	190,000	206,266.66	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	780,000	982,082.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	2,800,000	4,552,952.32	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	1,000,000	1,685,660.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 20/02/25	300,000	301,612.71	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 20/04/25	4,400,000	4,608,841.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 22/04/25	5,700,000	6,314,745.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 22/10/25	1,600,000	1,751,110.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 23/03/25	1,600,000	1,615,475.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	3,000,000	3,255,886.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	3,800,000	4,272,210.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	2,400,000	2,470,015.44	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	4,000,000	4,964,528.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	2,500,000	2,636,925.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,900,000	3,497,777.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	3,800,000	3,898,990.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	500,000	510,448.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	2,500,000	2,995,445.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	400,000	414,936.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	1,700,000	1,734,526.15	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	900,000	981,250.74	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	800,000	888,600.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 21/10/25	4,500,000	4,947,201.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 21/04/25	4,200,000	4,586,954.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	2,400,000	3,757,080.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	2,800,000	4,181,688.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	3,300,000	5,406,310.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	2,500,000	3,487,382.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	2,800,000	2,968,716.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	1,800,000	1,953,000.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	2,150,000	3,010,645.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	2,250,000	3,375,882.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,641,790.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	1,650,000	2,713,170.90	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 20/10/25	6,800,000	7,144,848.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	3,800,000	4,597,179.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 24/11/25	3,050,000	3,364,702.05	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	3,800,000	3,799,368.44	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	1,000,000	996,466.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.8% 22/03/15	850,000	877,605.45	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	1,000,000	1,309,798.60	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	550,000	577,465.13	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	600,000	698,640.00	

IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	850,000	886,193.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	90,000	91,044.90	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	710,000	773,645.82	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	850,000	982,371.86	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	700,000	713,321.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	850,000	993,347.40	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	1,400,000	1,533,126.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	1,400,000	1,551,275.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	1,220,000	2,008,132.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	1,080,000	1,702,964.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.25% 22/07/15	2,100,000	2,295,058.29	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	1,550,000	1,694,241.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,650,000	1,849,795.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	1,200,000	1,228,459.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	1,100,000	1,141,991.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	1,000,000	1,053,773.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	1,000,000	1,050,286.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	1,000,000	1,269,651.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	1,000,000	1,489,046.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/15	1,900,000	2,074,809.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 23/01/15	800,000	931,844.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	1,300,000	1,922,810.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.5% 23/01/15	800,000	1,049,301.60	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	100,000	98,280.50	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	190,000	232,040.16	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.65% 22/04/20	1,450,000	1,636,207.11	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.4% 22/11/22	1,150,000	1,313,620.85	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	950,000	1,039,904.20	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	1,100,000	1,211,148.18	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	850,000	917,702.50	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	1,000,000	1,338,359.00	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	600,000	627,048.60	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	600,000	622,326.00	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	650,000	795,808.65	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	400,000	579,405.20	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	420,000	448,814.10	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	550,000	989,320.75	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.5% 21/09/15	900,000	992,812.50	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	950,000	1,463,122.36	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	1,500,000	2,256,328.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,550,000	2,083,332.06	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,400,000	2,070,943.14	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,500,000	2,045,683.65	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	1,900,000	2,582,514.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	630,000	749,759.09	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 20/04/30	2,000,000	2,102,200.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	2,400,000	3,468,886.08	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,750,000	2,628,868.20	

	IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/18	1,000,000	1,058,161.40	
	ユーロ 小計	379,170,000	445,257,906.68 (55,977,824,027)	
国債証券	小計		144,429,871,714 (144,429,871,714)	
合計			144,429,871,714 (144,429,871,714)	

(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 135銘柄	100.0%	46.3%
カナダ・ドル	国債証券 17銘柄	100.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	2.1%
イギリス・ポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	6.8%
シンガポール・ドル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リングgit	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%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.8%
ポーランド・ズロチ	国債証券 8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 222銘柄	100.0%	38.8%

(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

「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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(2019年3月29日現在)

資産総額	4,284,373,297円
負債総額	4,517,851円
純資産総額( - )	4,279,855,446円
発行済口数	3,446,003,384口
1口当たり純資産額( / )	1.2420円

## &lt;参考情報&gt;

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）

(2019年3月29日現在)

資産総額	87,138,010,535円
負債総額	393,633,383円
純資産総額( - )	86,744,377,152円
発行済口数	32,798,543,827口
1口当たり純資産額( / )	2.6448円

## &lt;参考情報&gt;

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）

(2019年3月29日現在)

資産総額	154,788,793,474円
負債総額	593,383,625円
純資産総額( - )	154,195,409,849円
発行済口数	119,165,574,108口
1口当たり純資産額( / )	1.2940円

## &lt;参考情報&gt;

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）

(2019年3月29日現在)

資産総額	151,114,657,510円
負債総額	203,163,421円
純資産総額( - )	150,911,494,089円
発行済口数	56,983,849,883口
1口当たり純資産額( / )	2.6483円

## &lt;参考情報&gt;

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）

(2019年3月29日現在)

資産総額	147,228,666,254円
負債総額	532,120,555円
純資産総額( - )	146,696,545,699円
発行済口数	63,423,582,275口
1口当たり純資産額( / )	2.3130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、)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。

## 第二部【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および業務監査を行います。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。

2019年3月29日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計134本であり、その純資産総額は2,019,050百万円です（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）ならびに同規則第38条及び第57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。
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21期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表ならびに第22期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY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 (平成29年3月31日現在)			当事業年度 (平成30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		1,072,151			2,376,164	
有価証券		24,597			22,684	
前払金		120,702			46,929	
前払費用		23,871			8,682	
未収入金		189,169			210,888	
未収還付法人税等		602,213			1,020	
未収委託者報酬		585,796			642,874	
未収収益		148,631			221,238	
繰延税金資産		544,801			669,807	
流動資産計		3,311,935	53.1		4,200,289	63.3
固定資産						
有形固定資産		115,733			106,070	
建物附属設備	1	92,276			79,548	
器具備品	1	20,717			26,521	
リース資産	1	1,736			-	
その他の有形固定資産		1,003			-	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア	2	0			0	
投資その他の資産		2,803,881			2,332,777	
長期差入保証金		71,695			66,014	
繰延税金資産		2,727,336			2,261,912	
その他投資		4,850			4,850	
固定資産計		2,919,615	46.9		2,438,847	36.7
資産合計		6,231,550	100.0		6,639,137	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成29年3月31日現在)			当事業年度 (平成30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		101,842			123,003	
未払金		557,620			295,067	
未払手数料	124,844			131,425		
その他未払金	432,776			163,642		
未払費用		1,842			2,095	
未払法人税等		916			6,486	
未払消費税等		-			33,130	
賞与引当金		70,852			85,243	
リース債務		2,834			-	
流動負債計		735,907	11.8		545,027	8.2
固定負債						
退職給付引当金		92,798			65,230	

固定負債計		92,798	1.5		65,230	1.0
負債合計		828,706	13.3		610,257	9.2
(純資産の部)			%			%
株主資本		5,402,844	86.7		6,028,879	90.8
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	4,983,724			5,609,759		
純資産合計		5,402,844	86.7		6,028,879	90.8
負債・純資産合計		6,231,550	100.0		6,639,137	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日		当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,212,712		2,350,838	
投資顧問収入	1,458,677		1,772,901	
その他営業収益	50,406		20,464	
営業収益計	3,721,797	100.0	4,144,205	100.0
営業費用				
支払手数料	489,863		523,308	
広告宣伝費	35,172		43,448	
公告費	1,190		1,140	
調査費	417,879		417,484	
調査費	293,362		257,351	
委託調査費	122,452		158,734	
図書費	2,063		1,398	
委託計算費	142,995		151,080	
営業雑経費	38,828		31,907	
通信費	4,373		4,058	
印刷費	8,695		9,892	
協会費	10,238		9,442	
諸会費	3,751		2,072	
その他	11,770		6,441	
営業費用計	1,125,930	30.3	1,168,368	28.2
一般管理費				
給料	1,355,113		1,277,564	
役員報酬	320,210		249,245	
給料・手当	742,957		804,242	
賞与	240,448		162,677	
賞与引当金繰入額	51,497		61,399	
交際費	2,819		3,788	
旅費交通費	25,539		26,904	
租税公課	3,445		11,290	
不動産賃借料	98,463		95,293	

退職給付費用		89,895			41,704	
固定資産減価償却費		19,230			22,523	
福利厚生費		103,558			113,473	
事務手数料		684,643			254,170	
諸経費		40,555			145,755	
一般管理費計		2,423,266	65.1		1,992,467	48.1
営業利益		172,600	4.6		983,368	23.7
営業外収益						
有価証券運用益		6,845			3,607	
雑収入		1,326			9,153	
営業外収益計		8,172	0.2		12,761	0.3
営業外費用						
支払利息		118			169	
為替差損		1,479			601	
雑損失		161			241	
営業外費用計		1,759	0.0		1,012	0.0
経常利益		179,013	4.8		995,117	24.0
特別利益						
事業再構築費用戻入		101,509			-	
特別利益計		101,509	2.7		-	0.0
特別損失						
事業再構築費用		-			28,134	
事務処理損失		32,965			0	
特別損失計		32,965	0.9		28,134	0.7
税引前当期純利益		247,557	6.7		966,983	23.3
法人税,住民税及び事業税		188,427	5.1		530	0.0
法人税等調整額		303,615	8.2		340,417	8.2
当期純利益		132,369	3.6		626,035	15.1

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			利益剰余金 合計		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	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	5,847,217	5,956,337	6,266,337	6,266,337
当期変動額									
剰余金の配当	-	-	-	-	-	995,862	995,862	995,862	995,862
当期純利益	-	-	-	-	-	132,369	132,369	132,369	132,369
当期変動額合計	-	-	-	-	-	863,492	863,492	863,492	863,492
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	4,983,724	5,092,844	5,402,844	5,402,844

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			利益剰余金 合計		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	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	4,983,724	5,092,844	5,402,844	5,402,844
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	626,035	626,035	626,035	626,035
当期変動額合計	-	-	-	-	-	626,035	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	6,028,879

## [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 リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。
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。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30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 29,387千円 器具備品 21,193千円 リース資産 5,208千円	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
2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 11,524千円	
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 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30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48,303千円は、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684,643千円は、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。
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 平成28年4月 1日 至 平成29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

(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
平成28年12月22日 取締役会	普通株式	995,862千円	160,622.90円	平成28年9月30日	平成28年12月26日

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 平成29年4月 1日 至 平成30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。

（リース取引関係）

前事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日
所有権移転外ファイナンス・リース取引	同左
リース資産の内容 社用車両であります。	
リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。	

（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。

平成29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	1,072,151	1,072,151	
(2) 未収委託者報酬	585,796	585,796	
(3) 未収入金	189,169	189,169	
(4) 未収還付法人税等	602,213	602,213	
(5) 長期差入保証金	71,695	45,753	25,942
(6) 未払手数料	124,844	124,844	

（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) 未収委託者報酬、(3) 未収入金及び(5) 未払手数料

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。

(4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

(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年を超えるものではありません。

(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。

平成30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年を超えるものではありません。

(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 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 24,597千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 3,169千円	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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日
該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

(単位：千円)

前事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日

平成23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、平成12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 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
退職給付債務の期首残高	457,872
勤務費用	47,433
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	20,312
退職給付の支払額	<u>15,877</u>
退職給付債務の期末残高	469,114

(単位:千円)

	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30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	<u>51,823</u>
退職給付債務の期末残高	473,087

## 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 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
年金資産の期首残高	328,027
期待運用収益	2,421
数理計算上の差異の発生額	5,670
事業主からの拠出額	47,170
退職給付の支払額	<u>15,877</u>
年金資産の期末残高	367,412

(単位:千円)

	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30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

## 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	平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
積立型制度の退職給付債務		469,114
年金資産		367,412
		101,701
非積立型制度の退職給付債務		-
未積立退職給付債務		101,701
未認識数理計算上の差異		25,983
未認識過去勤務費用		34,886
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		92,798

(単位：千円)

	当事業年度	
	自	平成29年4月 1日 至 平成30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

## 5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度	
	自	平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
退職給付費用		66,829
(1) 勤務費用		47,433
(2) 利息費用		-
(3) 期待運用収益（減算）		2,421
(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		13,096

(単位：千円)

	当事業年度	
	自	平成29年4月 1日 至 平成30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

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（平成29年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.9%

その他 2.1%

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（平成30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。

## 7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成29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

(注) 当事業年度の期首時点において適用した割引率は1.0%でありましたが、期末時点において割引率の再検討を行った結果、割引率の変更により退職給付債務の額に重要な影響を及ぼすと判断し、割引率を0.0%に変更しております。

	当事業年度 (平成30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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は17,895千円であります。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)
繰延税金資産（流動）	繰延税金資産（流動）
連結納税適用に伴う影響額 617,391	連結納税適用に伴う影響額 612,589
賞与引当金繰入超過額 19,076	賞与引当金繰入超過額 21,749
その他 28,260	その他 35,467
繰延税金資産（流動）合計 664,727	繰延税金資産（流動）合計 669,807
繰延税金負債（流動）との相殺 119,926	繰延税金負債（流動）との相殺 -
繰延税金資産（流動）の純額 544,801	繰延税金資産（流動）の純額 669,807
繰延税金資産（固定）	繰延税金資産（固定）
連結納税適用に伴う影響額 1,837,769	連結納税適用に伴う影響額 1,225,179
退職給付引当金 29,482	退職給付引当金 21,040
繰越欠損金 848,912	繰越欠損金 1,001,357
その他 11,173	その他 14,335
繰延税金資産（固定）合計 2,727,336	繰延税金資産（固定）合計 2,261,912
繰延税金負債（固定）との相殺 -	繰延税金負債（固定）との相殺 -
繰延税金資産（固定）の純額 2,727,336	繰延税金資産（固定）の純額 2,261,912
繰延税金資産合計 3,272,137	繰延税金資産合計 2,931,719
繰延税金負債（流動）	繰延税金資産の純額 2,931,719
未払事業税 119,926	=====
繰延税金負債（流動）合計 119,926	
繰延税金資産（流動）との相殺 119,926	
繰延税金負債（流動）の純額 -	
繰延税金資産の純額 3,272,137	
=====	

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	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
法定実効税率 30.8%	法定実効税率 30.8%
交際費等永久に損金に算入されない項目 25.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目 4.5%
その他 9.7%	その他 0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 46.5%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 35.2%
=====	=====

## （資産除去債務関係）

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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 平成29年4月1日 至 平成30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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

前事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29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	184,870 93,591 316,476 48,303 684,643	未払金 前払金	298,783 74,932
	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	32,352 142,287	前払金	45,770
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	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	10,201	-	-
	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	269	-	-

(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 平成29年4月1日 至 平成30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				
当事業年度 自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日											

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・ユナイテッド・キングダム	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受入れ	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	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。

#### 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	当事業年度
自 平成28年4月 1日	自 平成29年4月 1日
至 平成29年3月31日	至 平成30年3月31日

1株当たり純資産 871,426円53銭 1株当たり当期純利益 21,349円86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。	1株当たり純資産 972,399円98銭 1株当たり当期純利益 100,973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。
---	--

(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 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日
当期純利益 (千円)	132,369	626,035
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)	132,369	626,035
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 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

期 別 科 目	第22期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)	
	金 額	構成比
(資産の部)		%
流動資産		
預金	2,289,633	
有価証券	34,353	
前払金	42,312	
前払費用	14,269	
未収入金	761,305	
未収委託者報酬	633,651	
未収収益	310,467	
流動資産計	4,085,993	58.4
固定資産		
有形固定資産	95,754	
建物附属設備	1 73,184	
器具備品	1 22,152	
その他の有形固定資産	417	
無形固定資産	0	
ソフトウェア	0	
投資その他の資産	2,810,743	

長期差入保証金	65,166		
繰延税金資産	2,737,551		
その他投資	8,025		
固定資産計		2,906,497	41.6
資産合計		6,992,490	100.0
(負債の部)			%
流動負債			
預り金		30,350	
未払金		282,150	
未払手数料	132,807		
その他未払金	149,343		
未払費用		2,029	
未払法人税等		2,431	
未払消費税等	2	30,813	
賞与引当金		180,021	
流動負債計		527,796	7.5
固定負債			
退職給付引当金		67,726	
固定負債計		67,726	1.0
負債合計		595,522	8.5
(純資産の部)			%
株主資本		6,396,967	91.5
資本金	310,000		
利益剰余金	6,086,967		
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	5,977,847		
純資産合計		6,396,967	91.5
負債・純資産合計		6,992,490	100.0

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第22期中間会計期間	
		自 平成30年4月 1日 至 平成30年9月30日	
		金額	構成比
			%
営業収益			
委託者報酬		1,180,520	
投資顧問収入		1,091,341	
その他営業収益	1	4,120	
営業収益計		2,275,983	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		638,062	
支払手数料		256,106	
その他営業費用		381,955	
一般管理費	2	1,073,376	
営業費用・一般管理費計		1,711,438	75.2
営業利益		564,544	24.8
営業外収益		1,769	0.1
営業外費用		277	0.0

経常利益		566,036	24.9
特別利益		300	0.0
特別損失		3,814	0.2
税引前中間純利益		562,521	24.7
法人税,住民税及び事業税		265	0.0
法人税等調整額		194,168	8.5
中間純利益		368,088	16.2

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

(単位：千円)

	株 主 資 本								純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			株主資本 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金		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	6,028,879
当中間期変動額									
中間純利益	-	-	-	-	-	368,088	368,088	368,088	368,088
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	368,088	368,088	368,088	368,088
当中間期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,977,847	6,086,967	6,396,967	6,396,967

## [重要な会計方針]

	第22期中間会計期間 自 平成30年4月 1日 至 平成30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  (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
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 発生の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>

## [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）を当中間連結会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第22期中間会計期間末 (平成30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>48,479 千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>33,581 千円</td> </tr> </table>	建物附属設備	48,479 千円	器具備品	33,581 千円
建物附属設備	48,479 千円				
器具備品	33,581 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22期中間会計期間 自 平成30年4月 1日 至 平成30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3,879千円は、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	
有形固定資産	10,857千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第22期中間会計期間				
自 平成30年4月 1日				
至 平成30年9月30日				
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

## (金融商品関係)

第22期中間会計期間			
自 平成30年4月 1日			
至 平成30年9月30日			
1. 金融商品の時価等に関する事項			
平成30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	2,289,633	2,289,633	
(2)未収入金	761,305	761,305	
(3)未収委託者報酬	633,651	633,651	
(4)未払手数料	132,807	132,807	
(5)その他未払金	149,343	149,343	
(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)未払手数料及び(5)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22期中間会計期間末	
(平成30年9月30日 現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	34,353千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	1,679千円

## (資産除去債務関係)

第22期中間会計期間末  
(平成30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22期中間会計期間末  
(平成30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22期中間会計期間末  
(平成30年9月30日現在)

(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。

(セグメント関連情報)

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。

2. 地域ごとの情報

(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。

(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。

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。

(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。

(1株当たり情報)

第22期中間会計期間  
自 平成30年4月 1日  
至 平成30年9月30日

1株当たり純資産額 1,031,769円01銭

1株当たり中間純利益 59,369円03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22期中間会計期間	
自 平成30年4月 1日	
至 平成30年9月30日	
中間純利益(千円)	368,088
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)	368,088
期中平均株式数(株)	6,200

(重要な後発事象)

第22期中間会計期間

自 平成30年4月 1日

至 平成30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（2018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

資本金の額：51,000百万円（2018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 (2018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 (2018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 (2018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	8,557百万円 (2018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【参考情報】

当計算期間において提出された、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	2018年 5月18日
有価証券届出書	2018年 5月18日
有価証券届出書の訂正届出書	2018年11月20日
半期報告書	2018年11月20日

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月22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

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 深田 豊大 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 伊藤 雅人 印

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平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第21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平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(注) 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

2019年4月10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2018年2月21日から2019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2019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

平成30年12月7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平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第22期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30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平成30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（平成30年4月1日から平成30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。