

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年2月7日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCインデックスバランス（株式80）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCインデックスバランス（株式80）（以下「ファンド」といいます。）

当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

2023年2月8日から2023年8月7日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外

目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり
一般	年6回 (隔月)	欧州		()
公債				
社債	年12回 (毎月)	アジア		
その他債券		オセアニア		
クレジット属性 ()	日々			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

各資産の運用は資産全体の値動きを表す代表的な指数に連動することをめざすインデックス運用で行ないます。

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

※**TOPIX(東証株価指数)**:TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、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ノウハウおよびTOPIXに係る標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPX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。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

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

※**NOMURA-BPI総合**:同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※**FTSE世界国債インデックス(除く日本)**:同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%とします。

組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	20%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

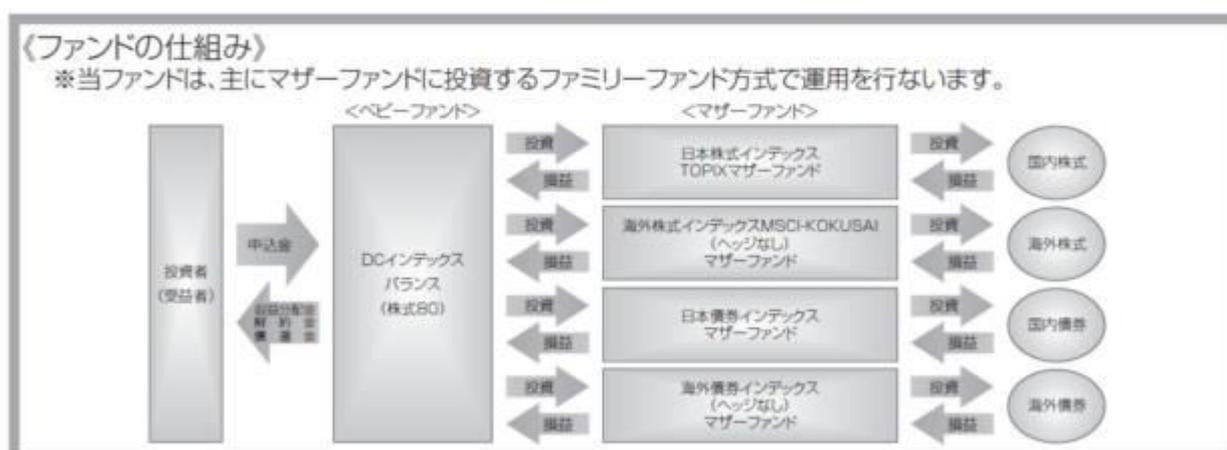
※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

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

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。

購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。



主な投資制限

- ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

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

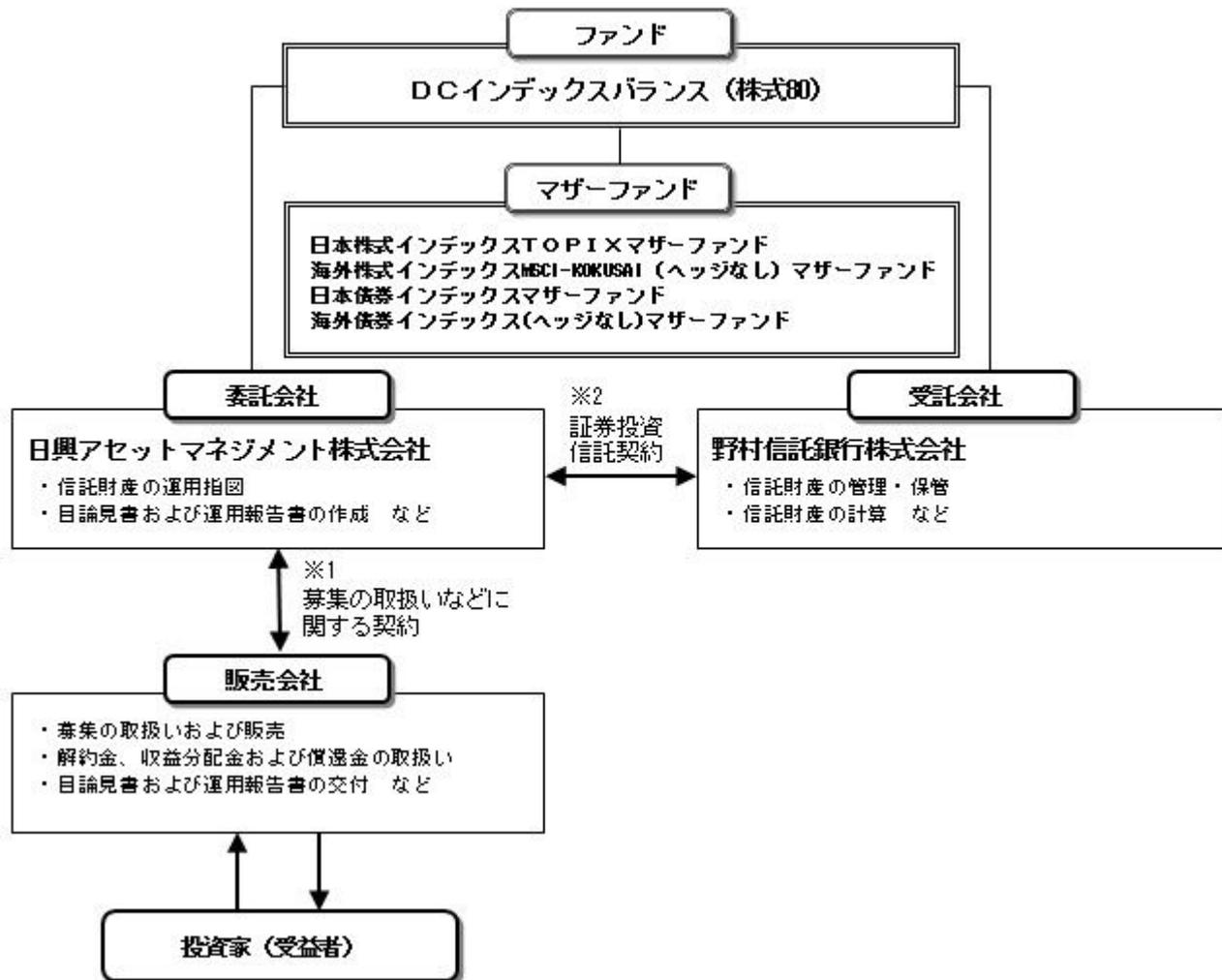
(2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2022年11月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめ

致します。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。

株式の標準実質組入比率.....80%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....20%

- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

< DCインデックスバランス（株式80） >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りま。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証書
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 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。）
- 10) 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。）
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 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
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)～12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをい

い、マザーファンドの受益証券を除きます。）

- 15) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で16)に定めるもの以外のもの
- 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 17) 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。）
- 18) 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。）
- 19) 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。）
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 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) 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
- 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権

付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー

- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>
わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。には投資しません。
 - 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券

- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 有価証券の貸付
 - 5) 公社債の空売
 - 6) 公社債の借入
- < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >
内外の公社債を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
 - 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* T O P I X（東証株価指数）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

T O P I Xの指数値およびT O P I Xに係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、T O P I X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。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI 総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下「NFRC」）が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。同指数の知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

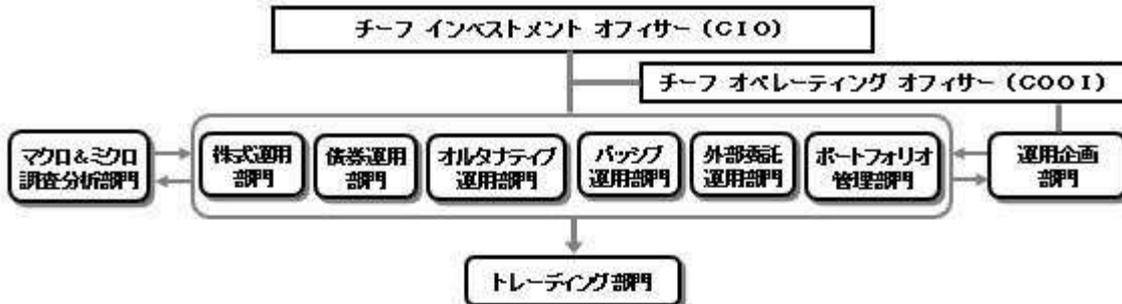
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 下線部は、2023年4月11日付で「投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため」に変更予定です。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

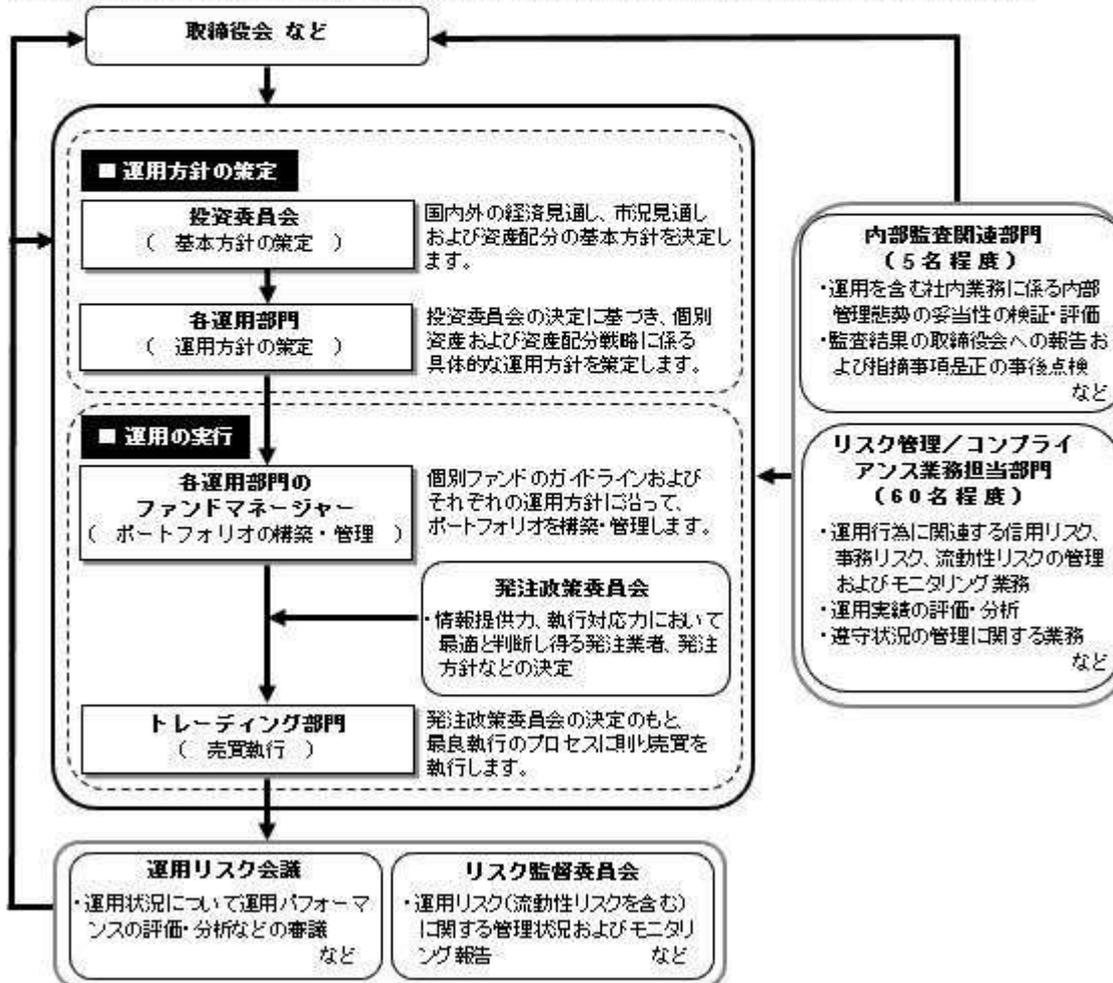
* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



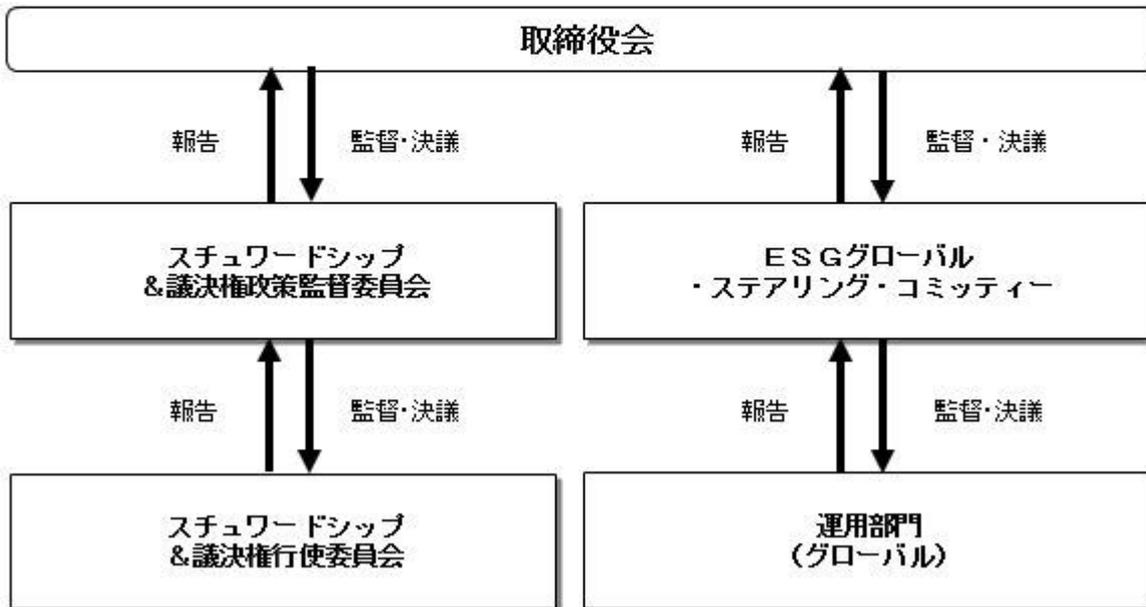
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2022年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< DCインデックスバランス（株式80） >

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

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ)再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

- 1)株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2)投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3)外貨建資産への投資は行ないません。
- 4)信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5)投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6)投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7)投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8)投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9)信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ)株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ)公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10)信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11)信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12)デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとし、
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとし、
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託

財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

下記の変更を予定しております。

2023年4月10日まで

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

2023年4月11日以降

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の

金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

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

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

(参考情報)**当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較****(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))**

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	7.3%	6.9%	15.1%	7.9%	-0.0%	3.1%	1.9%
最大値	35.8%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-12.2%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.5%	-4.5%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2017年12月から2022年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージングマーケットインデックス(配当込、円ベース)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について**東証株価指数(TOPIX、配当込)**

当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2017年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の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】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%（税抜0.14%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.14%	0.04%	0.08%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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の場合、所得税および地方税はかかりません。

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せん。

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

* 解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みません。）を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りません。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限りません。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：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。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ただし、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

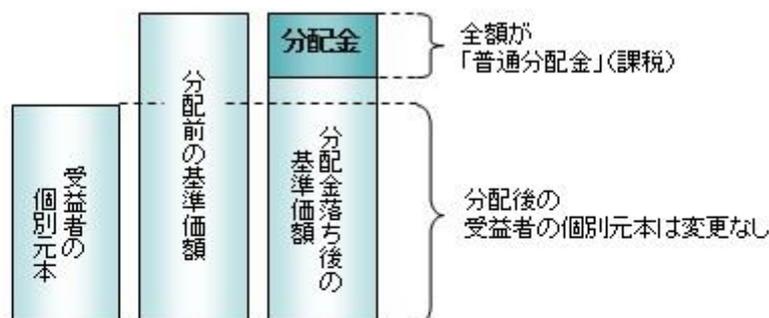
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

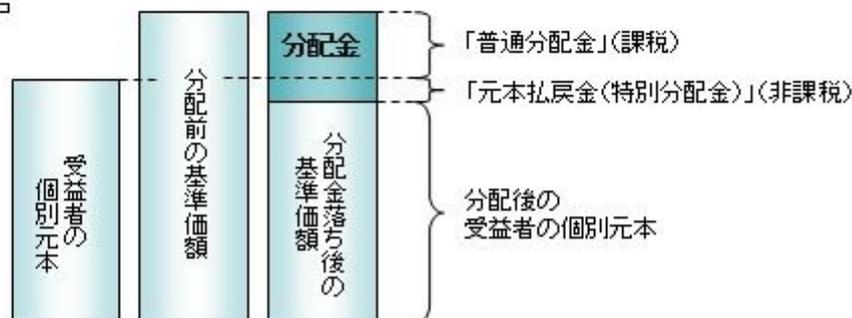
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2023年2月7日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【DCインデックスバランス(株式80)】

以下の運用状況は2022年11月30日現在です。

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

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	14,604,364,285	94.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		773,123,923	5.03
合計（純資産総額）		15,377,488,208	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,668,127,179	1.9288	9,003,883,703	1.9805	9,245,225,878	60.12
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	703,248,577	4.3299	3,044,999,634	4.3324	3,046,754,134	19.81
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	594,740,226	2.6165	1,556,152,810	2.5902	1,540,496,133	10.02
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	568,191,491	1.3571	771,125,953	1.3585	771,888,140	5.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	94.97
合計	94.97

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き

第11計算期間末	(2013年11月 6日)	2,382	2,383	1.6841	1.6851
第12計算期間末	(2014年11月 6日)	2,987	2,989	1.9687	1.9697
第13計算期間末	(2015年11月 6日)	3,522	3,524	2.2109	2.2119
第14計算期間末	(2016年11月 7日)	3,295	3,297	1.9763	1.9773
第15計算期間末	(2017年11月 6日)	4,675	4,677	2.5453	2.5463
第16計算期間末	(2018年11月 6日)	5,965	5,967	2.4596	2.4606
第17計算期間末	(2019年11月 6日)	7,720	7,723	2.5870	2.5880
第18計算期間末	(2020年11月 6日)	9,106	9,109	2.6461	2.6471
第19計算期間末	(2021年11月 8日)	13,284	13,288	3.2978	3.2988
第20計算期間末	(2022年11月 7日)	15,012	15,016	3.2638	3.2648
	2021年11月末日	12,937		3.1766	
	12月末日	13,460		3.2698	
	2022年 1月末日	12,977		3.1219	
	2月末日	12,973		3.1028	
	3月末日	13,868		3.2594	
	4月末日	13,633		3.1843	
	5月末日	13,747		3.1953	
	6月末日	13,784		3.1470	
	7月末日	14,336		3.2449	
	8月末日	14,566		3.2686	
	9月末日	14,198		3.1241	
	10月末日	15,090		3.2878	
	11月末日	15,377		3.3133	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	0.0010
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
---	----	--------

第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	50.15
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	16.96
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	12.35
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	10.57
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	28.84
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	3.33
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	5.22
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	2.32
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	24.67
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	1.00

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	337,947,290	360,574,596
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	382,949,221	279,756,877
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	498,795,450	423,102,531
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	409,317,117	335,093,532
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	719,523,758	550,004,012
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	902,995,339	314,754,593
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	975,568,818	416,413,525
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1,136,417,948	679,513,255
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	1,298,885,556	712,032,628
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	1,239,175,853	667,756,467

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2022年11月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	44,584,985,120	99.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		438,476,876	0.97
合計（純資産総額）		45,023,461,996	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	398,000,000	0.88

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	853,400	2,020.62	1,724,397,108	2,010.50	1,715,760,700	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	109,900	9,884.00	1,086,251,600	11,255.00	1,236,924,500	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,600	51,220.00	799,032,000	57,140.00	891,384,000	1.98
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	199,700	4,105.39	819,846,383	3,820.00	762,854,000	1.69
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,003,500	709.40	711,882,900	755.10	757,742,850	1.68
日本	株式	第一三共	医薬品	135,800	4,547.24	617,515,192	4,518.00	613,544,400	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	98,100	6,072.00	595,663,200	5,894.00	578,201,400	1.28
日本	株式	日立製作所	電気機器	78,800	6,544.00	515,667,200	7,299.00	575,161,200	1.28
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	137,900	3,825.00	527,467,500	4,050.00	558,495,000	1.24
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	90,100	6,031.00	543,393,100	5,952.00	536,275,200	1.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,900	4,212.00	471,322,800	4,673.00	522,908,700	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	118,300	4,621.00	546,664,300	4,329.00	512,120,700	1.14
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,000	39,180.00	430,980,000	45,090.00	495,990,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	120,500	4,406.00	530,923,000	4,111.00	495,375,500	1.10
日本	株式	三井物産	卸売業	120,300	3,300.00	396,990,000	3,983.00	479,154,900	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	102,800	4,095.00	420,966,000	4,605.00	473,394,000	1.05
日本	株式	HOYA	精密機器	33,600	14,697.35	493,830,960	14,060.00	472,416,000	1.05
日本	株式	信越化学工業	化学	26,600	15,455.00	411,103,000	17,570.00	467,362,000	1.04
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	154,100	2,658.62	409,693,342	2,827.00	435,640,700	0.97
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	99,100	3,908.00	387,282,800	4,287.00	424,841,700	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	126,300	3,361.00	424,494,300	3,356.00	423,862,800	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,700	21,885.00	409,249,500	22,405.00	418,973,500	0.93
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	221,400	1,625.01	359,777,214	1,717.00	380,143,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	250,400	1,471.50	368,463,600	1,497.50	374,974,000	0.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,100	7,171.00	337,754,100	7,464.00	351,554,400	0.78
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,900	19,175.00	324,057,500	19,720.00	333,268,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	38,100	8,231.00	313,601,100	8,534.00	325,145,400	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	149,400	2,042.50	305,149,500	2,128.00	317,923,200	0.71

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	56,700	5,592.00	317,066,400	5,579.00	316,329,300	0.70
日本	株式	S M C	機械	5,100	58,380.00	297,738,000	61,760.00	314,976,000	0.70

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.32
		建設業	1.92
		食料品	3.46
		繊維製品	0.44
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.08
		医薬品	5.70
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.56
		機械	5.12
		電気機器	17.28
		輸送用機器	7.67
		精密機器	2.72
		その他製品	2.34
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	3.15
		海運業	0.59
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.74
		卸売業	5.88
		小売業	4.45
銀行業	5.51		
証券、商品先物取引業	0.73		
保険業	2.33		
その他金融業	1.10		
不動産業	2.10		
サービス業	5.34		
合 計			99.03

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2022年 12月	買建	20	日本円	383,553,300	398,000,000	0.88

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

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

以下の運用状況は2022年11月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	175,039,435,620	67.50
	カナダ	9,689,725,386	3.74
	ドイツ	6,208,187,952	2.39
	イタリア	1,299,030,840	0.50
	フランス	8,163,869,933	3.15
	オランダ	4,518,602,032	1.74
	スペイン	1,880,218,932	0.73
	ベルギー	624,368,039	0.24
	オーストリア	144,191,329	0.06
	ルクセンブルク	179,308,485	0.07
	フィンランド	957,230,245	0.37
	アイルランド	4,770,907,130	1.84
	ポルトガル	130,805,309	0.05
	イギリス	11,044,189,685	4.26
	スイス	8,650,980,197	3.34
	スウェーデン	2,353,662,520	0.91
	ノルウェー	599,098,128	0.23
	デンマーク	2,116,511,521	0.82
	ケイマン	467,211,449	0.18
	オーストラリア	5,644,493,883	2.18
バミューダ	154,440,518	0.06	
ニュージーランド	171,121,707	0.07	
香港	1,674,486,296	0.65	
シンガポール	867,754,622	0.33	
イスラエル	665,152,720	0.26	
ジャージー	830,861,126	0.32	

	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	57,751,377	0.02
	小計	248,903,596,981	95.98
投資証券	アメリカ	5,104,347,517	1.97
	カナダ	12,385,878	0.00
	フランス	106,222,351	0.04
	ベルギー	28,545,944	0.01
	イギリス	108,567,730	0.04
	オーストラリア	331,614,292	0.13
	香港	81,177,790	0.03
	シンガポール	124,637,116	0.05
	小計	5,897,498,618	2.27
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,523,613,546	1.74
合計（純資産総額）		259,324,709,145	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,713,869,845	1.43
	買建	ドイツ	730,168,911	0.28

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,180,699,660	0.46

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	619,254	21,144.85	13,094,038,479	19,604.27	12,140,027,507	4.68
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	271,844	34,763.17	9,450,161,354	33,374.62	9,072,692,129	3.50
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	350,590	16,677.86	5,847,091,931	12,834.36	4,499,600,166	1.74
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	230,540	14,477.59	3,337,663,753	13,219.03	3,047,516,398	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	215,780	14,539.76	3,137,391,200	13,253.75	2,859,894,779	1.10

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	35,980	74,998.70	2,698,453,573	73,323.36	2,638,174,493	1.02
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自 動車部品	101,165	30,822.54	3,118,162,402	25,111.86	2,540,441,529	0.98
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	161,591	14,722.34	2,378,998,788	15,350.68	2,480,533,315	0.96
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	100,931	23,719.54	2,394,037,523	24,453.61	2,468,128,149	0.95
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	49,315	40,215.87	1,983,245,889	43,762.10	2,158,128,114	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	112,530	17,064.77	1,920,299,564	18,964.08	2,134,028,733	0.82
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	95,840	18,467.97	1,769,970,743	21,717.87	2,081,441,552	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	91,949	18,203.05	1,673,752,273	20,202.80	1,857,627,956	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	63,102	27,042.93	1,706,463,425	29,032.16	1,831,987,499	0.71
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	71,621	24,315.57	1,741,506,088	25,139.63	1,800,525,877	0.69
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバコ	107,930	15,762.48	1,701,244,616	16,207.24	1,749,247,867	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	39,410	40,358.20	1,590,516,876	43,877.36	1,729,206,963	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェ ア・サービ ス	33,300	43,326.32	1,442,766,669	47,650.46	1,586,760,421	0.61
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	30,959	48,822.77	1,511,504,378	50,541.73	1,564,721,620	0.60
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	67,786	20,814.43	1,410,927,511	21,969.23	1,489,206,496	0.57
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	214,970	6,338.86	1,362,664,931	6,872.67	1,477,419,224	0.57
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	97,003	13,586.05	1,317,888,526	15,114.61	1,466,162,591	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	277,929	4,918.67	1,367,043,465	5,138.18	1,428,052,008	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	157,972	8,192.28	1,294,152,074	8,676.59	1,370,659,476	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバコ	53,041	24,766.52	1,313,640,995	25,356.27	1,344,922,092	0.52
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	87,770	19,003.96	1,667,978,428	15,200.71	1,334,166,334	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	15,587	71,339.75	1,111,972,742	80,376.08	1,252,822,021	0.48
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活 必需品小売 り	16,994	69,351.16	1,178,553,621	73,456.67	1,248,322,738	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活 必需品小売 り	58,062	19,474.58	1,130,733,172	21,242.94	1,233,407,809	0.48

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	26,923	48,249.84	1,299,030,619	45,048.44	1,212,839,352	0.47
-----	----	----------------------------------	------------------------	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	5.92
		素材	4.36
		資本財	6.52
		商業・専門サービス	1.21
		運輸	1.91
		自動車・自動車部品	1.85
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.90
		メディア・娯楽	4.81
		小売	4.42
		食品・生活必需品小売り	1.61
		食品・飲料・タバコ	4.33
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	4.95
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.25
		銀行	6.05
		各種金融	4.80
		保険	3.31
		不動産	0.32
		ソフトウェア・サービス	10.18
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.14		
電気通信サービス	1.43		
公益事業	3.13		
半導体・半導体製造装置	4.26		
投資証券			2.27
合計			98.26

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2212	買建	135	米ドル	26,251,975	3,645,611,768	26,743,500	3,713,869,845	1.43

株価指数先物取引	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2212	買建	135	ユーロ	4,780,090	686,325,322	5,085,450	730,168,911	0.28
----------	-----	-------------------	-------------	----	-----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	4,300,000.00	612,994,960	593,852,700	0.23
	ユーロ	買建	3,950,000.00	576,866,320	565,785,605	0.22
	豪ドル	買建	227,000.00	21,074,680	21,061,355	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2022年11月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	40,677,574,280	84.06
地方債証券	日本	3,453,347,190	7.14
特殊債券	日本	3,526,495,000	7.29
社債券	日本	603,315,000	1.25
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		128,324,338	0.27
合計(純資産総額)		48,389,055,808	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	700,000,000	100.99	706,944,000	100.93	706,517,000	0.300	2025/12/20	1.46
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	700,000,000	100.30	702,136,000	100.26	701,855,000	0.100	2026/9/20	1.45
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	690,000,000	100.17	691,207,500	100.12	690,883,200	0.100	2027/3/20	1.43
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	680,000,000	100.14	681,005,400	100.04	680,306,000	0.100	2027/6/20	1.41
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	100.23	661,547,700	100.20	661,333,200	0.100	2026/12/20	1.37
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	640,000,000	99.94	639,667,200	99.87	639,193,600	0.100	2027/12/20	1.32

日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	640,000,000	99.83	638,969,600	99.84	638,988,800	0.100	2028/3/20	1.32
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	620,000,000	101.21	627,551,600	101.14	627,123,800	0.400	2025/9/20	1.30
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	600,000,000	98.91	593,460,000	99.06	594,396,000	0.100	2030/3/20	1.23
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	590,000,000	99.64	587,929,100	99.74	588,471,900	0.100	2028/9/20	1.22
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	570,000,000	101.11	576,338,400	101.05	576,030,600	0.400	2025/6/20	1.19
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	98.53	571,485,600	98.73	572,680,400	0.100	2030/9/20	1.18
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	99.12	555,072,000	99.20	555,525,600	0.100	2029/12/20	1.15
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	545,000,000	100.34	546,885,700	100.30	546,640,450	0.100	2026/6/20	1.13
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	99.74	533,646,450	99.77	533,817,650	0.100	2028/6/20	1.10
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	530,000,000	100.37	531,976,900	100.31	531,658,900	0.100	2026/3/20	1.10
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	100.04	500,240,000	99.95	499,760,000	0.100	2027/9/20	1.03
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	101.00	494,929,400	100.96	494,728,500	0.500	2024/9/20	1.02
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	98.68	414,493,800	98.88	415,329,600	0.100	2030/6/20	0.86
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	370,000,000	110.86	410,204,200	111.21	411,477,000	1.500	2033/3/20	0.85
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	358,000,000	112.91	404,235,700	113.06	404,761,960	1.700	2032/9/20	0.84
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	400,000,000	100.00	400,000,000	100.13	400,548,000	0.200	2032/3/20	0.83
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	99.54	398,172,000	99.67	398,680,000	0.100	2028/12/20	0.82
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	400,000,000	98.36	393,448,000	98.50	394,000,000	0.100	2031/3/20	0.81
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	101.01	393,970,200	100.95	393,720,600	0.400	2025/3/20	0.81
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	113.55	389,493,650	113.54	389,459,350	2.100	2030/3/20	0.80
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	315,000,000	112.87	355,543,650	113.21	356,633,550	1.700	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	350,000,000	99.57	348,512,500	99.67	348,855,500	0.200	2032/6/20	0.72
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	350,000,000	99.37	347,816,000	99.48	348,187,000	0.100	2029/6/20	0.72
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	350,000,000	99.25	347,378,500	99.36	347,767,000	0.100	2029/9/20	0.72

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.06
地方債証券	7.14
特殊債券	7.29
社債券	1.25
合計	99.73

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2022年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	74,989,736,944	50.09
	カナダ	3,077,225,271	2.06
	メキシコ	1,259,117,896	0.84
	ドイツ	9,959,468,837	6.65
	イタリア	11,429,481,843	7.63
	フランス	12,843,455,443	8.58
	オランダ	2,410,247,221	1.61
	スペイン	7,721,675,970	5.16
	ベルギー	2,836,513,889	1.89
	オーストリア	1,780,565,326	1.19
	フィンランド	763,970,148	0.51
	アイルランド	965,050,017	0.64
	イギリス	7,096,340,521	4.74
	スウェーデン	386,660,133	0.26
	ノルウェー	309,599,615	0.21
	デンマーク	551,932,168	0.37
	ポーランド	633,870,481	0.42
	オーストラリア	2,307,723,379	1.54
	ニュージーランド	313,512,409	0.21
	シンガポール	689,421,360	0.46
マレーシア	783,356,111	0.52	
中国	4,926,881,688	3.29	
イスラエル	552,127,309	0.37	
	小計	148,587,933,979	99.24
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,134,409,742	0.76
合計（純資産総額）		149,722,343,721	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		475,095,166	0.32

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	13,276.33	929,343,120	13,303.39	931,237,432	0.250	2023/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,480,000	11,434.53	855,303,153	11,785.50	881,555,878	1.625	2031/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	10,985.91	834,929,837	11,348.28	862,469,494	1.250	2031/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,582.62	810,783,815	11,778.18	824,472,816	0.375	2027/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	11,034.19	753,635,715	11,403.61	778,866,829	1.375	2031/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	12,855.23	771,314,353	12,897.00	773,820,529	0.375	2024/9/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	11,500.17	747,511,172	11,872.84	771,734,767	1.875	2032/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,845.71	710,743,167	12,101.76	726,105,661	1.500	2028/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	10,883.93	665,008,505	11,215.37	685,259,713	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,282.15	664,107,801	13,454.92	672,746,494	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,368.13	668,406,806	13,439.46	671,973,488	3.000	2025/7/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,342.36	667,118,461	13,411.26	670,563,090	2.875	2025/6/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	13,115.04	653,129,040	13,366.23	665,638,628	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,109.11	655,455,555	13,137.31	656,865,946	0.125	2024/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,083.07	654,153,648	13,112.90	655,645,410	0.250	2024/3/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,889.41	644,470,715	12,928.74	646,437,135	0.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	12,988.14	614,339,128	13,079.81	618,675,397	2.000	2025/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	13,284.32	617,721,152	13,303.85	618,629,231	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	13,361.89	617,319,679	13,373.28	617,845,973	2.375	2024/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	12,626.86	611,140,179	12,763.02	617,730,213	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,640,000	13,230.07	613,875,701	13,245.26	614,580,466	1.750	2024/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,488.41	599,443,974	12,765.19	612,729,154	2.750	2032/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,423.97	597,593,042	12,686.53	610,222,283	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,945.28	608,428,528	12,977.29	609,932,773	0.250	2024/6/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	13,044.55	588,309,574	13,285.95	599,196,493	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	13,136.77	595,095,974	13,184.51	597,258,441	2.000	2025/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,600,000	12,537.35	576,718,430	12,921.41	594,385,298	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	12,641.77	580,257,522	12,900.80	592,146,999	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	12,432.93	575,644,820	12,696.29	587,838,607	2.375	2029/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	13,336.40	560,128,888	13,428.07	563,979,274	3.000	2025/9/30	0.38

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	99.24
合 計	99.24

投資不動産物件

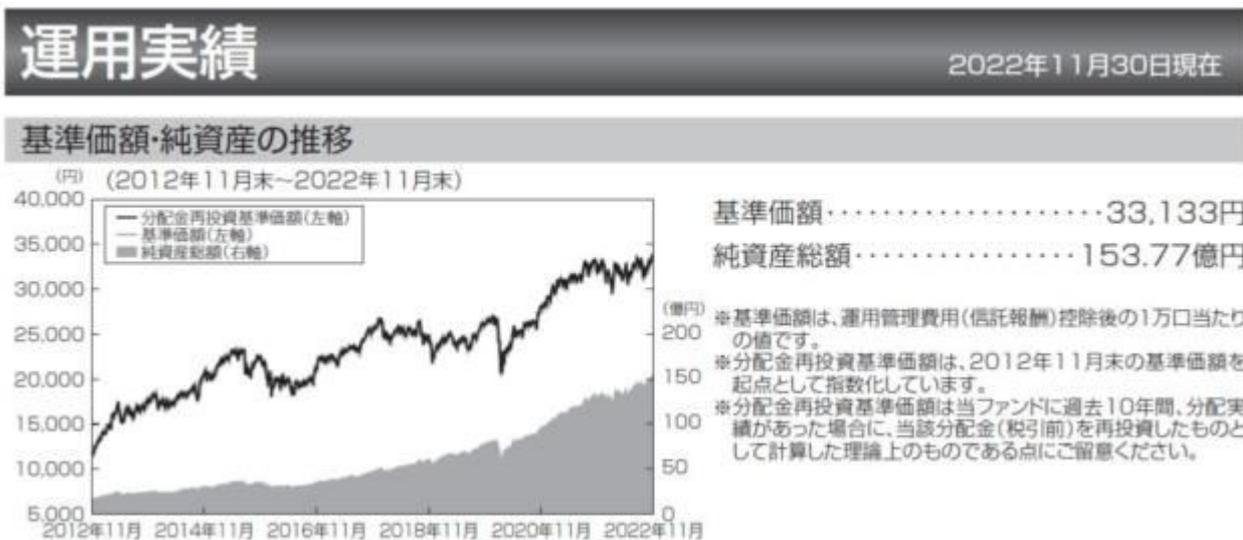
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	2,430,000.00	337,478,400	337,408,659	0.23
	ユーロ	買建	959,000.00	137,815,972	137,686,507	0.09

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報



分配の推移(税引前、1万口当たり)

2018年11月	2019年11月	2020年11月	2021年11月	2022年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	170円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60.12%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	19.81%
日本債券インデックスマザーファンド	5.02%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.02%
現金その他	5.03%

※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.81%	
	2 ソニーグループ	電気機器	2.75%	
	3 キーエンス	電気機器	1.98%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.68%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.50%	
	3 AMAZON.COM INC	小売	1.74%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	2025/12/20	1.46%
	2 第344回利付国債(10年)	国債証券	2026/9/20	1.45%
	3 第346回利付国債(10年)	国債証券	2027/3/20	1.43%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン0.250%)	国債証券	2023/11/15	0.62%
	2 US TREASURY N/B (クーポン1.625%)	国債証券	2031/5/15	0.59%
	3 US TREASURY N/B (クーポン1.250%)	国債証券	2031/8/15	0.58%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2022年は、2022年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

1円以上1円単位

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、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が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむ

を得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

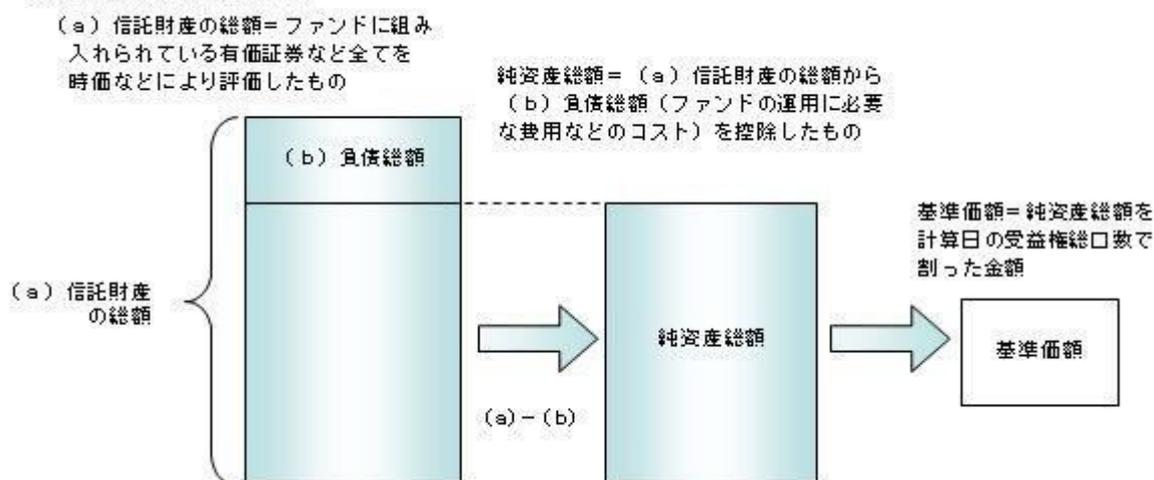
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 - ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
 - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2002年12月10日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年11月7日から翌年11月6日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合

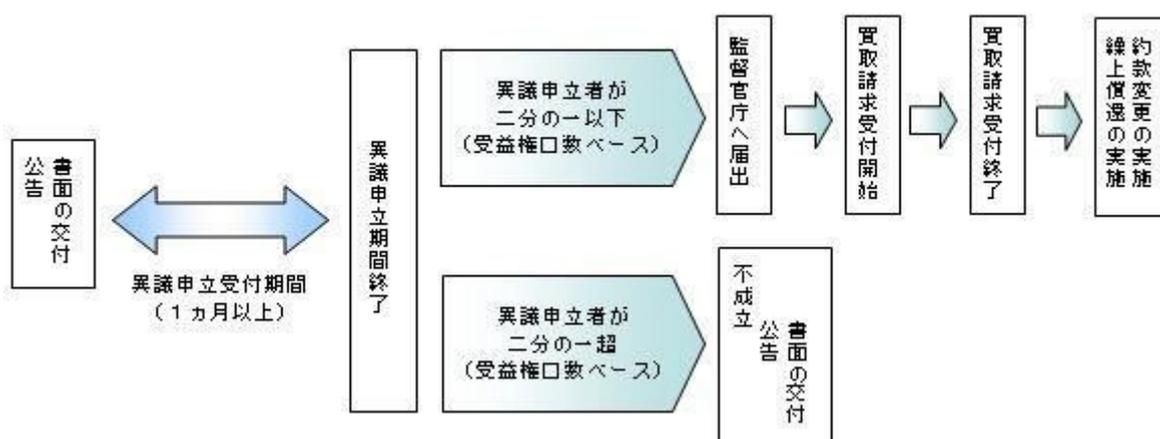
は、原則として公告を行いません。

- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間（2021年11月9日から2022年11月7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る監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCインデックスバランス（株式80）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 2021年11月 8日現在	第20期 2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	685,868,451	771,860,175
親投資信託受益証券	12,633,027,174	14,274,662,202
未収入金	13,720,766	-
流動資産合計	13,332,616,391	15,046,522,377
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,028,223	4,599,643
未払解約金	34,375,382	18,207,161
未払受託者報酬	1,366,267	1,579,909
未払委託者報酬	8,197,975	9,479,785
未払利息	368	1,153
その他未払費用	273,207	315,934
流動負債合計	48,241,422	34,183,585
純資産の部		
元本等		
元本	4,028,223,634	4,599,643,020
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,256,151,335	10,412,695,772
（分配準備積立金）	3,119,452,691	2,943,269,667
元本等合計	13,284,374,969	15,012,338,792
純資産合計	13,284,374,969	15,012,338,792
負債純資産合計	13,332,616,391	15,046,522,377

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	自	2021年11月 9日 至 2022年11月 7日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,394,101,773		76,465,356
営業収益合計		2,394,101,773		76,465,356
営業費用				
支払利息		74,311		131,499
受託者報酬		2,497,478		3,012,180
委託者報酬		14,985,594		18,073,763
その他費用		499,399		602,340
営業費用合計		18,056,782		21,819,782
営業利益又は営業損失（ ）		2,376,044,991		98,285,138
経常利益又は経常損失（ ）		2,376,044,991		98,285,138
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,376,044,991		98,285,138
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		232,769,153		61,096,796
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,664,800,381		9,256,151,335
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,656,449,192		2,723,968,202
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,656,449,192		2,723,968,202
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,204,345,853		1,525,635,780
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,204,345,853		1,525,635,780
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		4,028,223		4,599,643
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,256,151,335		10,412,695,772

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月7日から翌年11月6日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年11月 9日から2022年11月 7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第19期 2021年11月 8日現在	第20期 2022年11月 7日現在
1.	期首元本額	3,441,370,706円	4,028,223,634円
	期中追加設定元本額	1,298,885,556円	1,239,175,853円
	期中一部解約元本額	712,032,628円	667,756,467円
2.	受益権の総数	4,028,223,634口	4,599,643,020口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日		第20期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	210,288,089円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 279,940,180円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,932,987,749円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	6,254,427,781円	C 信託約款に定める収益調整金 8,040,696,279円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	980,205,076円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 2,667,929,130円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	9,377,908,695円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 10,988,565,589円
F	分配対象収益(1万口当たり)	23,280円	F 分配対象収益(1万口当たり) 23,890円
G	分配金額	4,028,223円	G 分配金額 4,599,643円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第19期 自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	第20期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日

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

金融商品の時価等に関する事項

	第19期 2021年11月 8日現在	第20期 2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

第19期(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,322,273,288
合計	2,322,273,288

第20期（2022年11月 7日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	67,119,823
合計	67,119,823

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第19期 2021年11月 8日現在		第20期 2022年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	3.2978円	1口当たり純資産額	3.2638円
(1万口当たり純資産額)	(32,978円)	(1万口当たり純資産額)	(32,638円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	698,807,858	3,025,558,501	
	日本債券インデックスマザーファンド	546,153,242	741,129,949	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	563,858,699	1,476,238,459	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,682,567,033	9,031,735,293	
合計		6,491,386,832	14,274,662,202	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	281,234,777	224,873,450
株式	41,695,319,770	43,556,733,190
派生商品評価勘定	5,851,800	25,292,350
未収配当金	347,282,854	456,381,289
流動資産合計	42,329,689,201	44,263,280,279
資産合計	42,329,689,201	44,263,280,279
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,552,750	-
前受金	4,605,000	17,060,500
未払金	301,100	-

未払解約金	34,533,416	26,250,912
未払利息	151	336
流動負債合計	40,992,417	43,311,748
負債合計	40,992,417	43,311,748
純資産の部		
元本等		
元本	21,399,374,592	22,926,701,557
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,889,322,192	21,293,266,974
元本等合計	42,288,696,784	44,219,968,531
純資産合計	42,288,696,784	44,219,968,531
負債純資産合計	42,329,689,201	44,263,280,279

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
1.	期首	2020年11月 7日	2021年11月 9日
	期首元本額	22,074,085,898円	21,399,374,592円
	期首からの追加設定元本額	2,449,231,144円	3,152,916,925円
	期首からの一部解約元本額	3,123,942,450円	1,625,589,960円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	696,888,688円	803,583,534円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,850,824,764円	2,154,040,819円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,636,933,914円	4,289,020,851円
	DCインデックスバランス（株式80）	4,009,153,065円	4,682,567,033円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,406,483,021円	1,711,023,635円

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,079,703,536円	3,235,077,737円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	636,617,068円	600,774,622円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	44,030,108円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	38,883,261円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,611,073円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	40,515,547円	-円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,907,194,622円	2,439,998,702円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	244,544,060円	244,734,194円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	691,834,956円	684,883,401円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,051,047,841円	1,049,790,558円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,018,109,068円	1,031,206,471円
計	21,399,374,592円	22,926,701,557円
2. 受益権の総数	21,399,374,592口	22,926,701,557口
3. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	650,280,000円	562,995,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	363,224,030
合計	363,224,030

(2022年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	368,882,500
合計	368,882,500

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	585,400,000	-	589,715,000	4,315,000
合計		585,400,000	-	589,715,000	4,315,000

(2022年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	613,734,500	-	639,045,000	25,310,500
合計		613,734,500	-	639,045,000	25,310,500

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2021年11月 8日現在		2022年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.9762円	1口当たり純資産額	1.9288円
(1万口当たり純資産額)	(19,762円)	(1万口当たり純資産額)	(19,288円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位 : 円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,640.00	2,912,000	
日本水産	21,800	502.00	10,943,600	
マルハニチロ	3,400	2,344.00	7,969,600	
雪国まいたけ	1,900	1,059.00	2,012,100	
カネコ種苗	700	1,418.00	992,600	
サカタのタネ	2,800	4,785.00	13,398,000	
ホクト	1,900	1,905.00	3,619,500	
ホクリヨウ	300	625.00	187,500	
住石ホールディングス	3,400	203.00	690,200	
日鉄鉱業	900	3,015.00	2,713,500	
三井松島ホールディングス	1,000	2,625.00	2,625,000	
I N P E X	80,800	1,611.00	130,168,800	
石油資源開発	2,500	3,920.00	9,800,000	
K & O エナジーグループ	1,000	2,222.00	2,222,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	6,370.00	19,110,000	
ミライト・ワン	7,600	1,432.00	10,883,200	
サンヨーホームズ	400	696.00	278,400	
日本アクア	1,000	715.00	715,000	
ファーストコーポレーション	700	715.00	500,500	
ベステラ	600	967.00	580,200	
キャンディル	500	494.00	247,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	774.00	387,000	
第一カッター興業	600	1,211.00	726,600	
安藤・間	12,700	869.00	11,036,300	
東急建設	6,300	622.00	3,918,600	
コムシスホールディングス	7,400	2,414.00	17,863,600	

ビーアールホールディングス	3,600	343.00	1,234,800	
高松コンストラクショングループ	1,500	1,925.00	2,887,500	
東建コーポレーション	700	7,660.00	5,362,000	
ソネック	300	918.00	275,400	
ヤマウラ	1,200	983.00	1,179,600	
オリエンタル白石	8,200	271.00	2,222,200	
大成建設	15,200	4,060.00	61,712,000	
大林組	54,700	957.00	52,347,900	
清水建設	46,000	747.00	34,362,000	
飛島建設	1,800	1,033.00	1,859,400	
長谷工コーポレーション	15,800	1,539.00	24,316,200	
松井建設	1,600	554.00	886,400	
銭高組	200	2,809.00	561,800	
鹿島建設	33,900	1,403.00	47,561,700	
不動テトラ	1,100	1,485.00	1,633,500	
大末建設	600	1,180.00	708,000	
鉄建建設	1,200	1,740.00	2,088,000	
西松建設	2,600	3,720.00	9,672,000	
三井住友建設	12,500	442.00	5,525,000	
大豊建設	600	4,170.00	2,502,000	
ナカノフドー建設	1,400	307.00	429,800	
奥村組	2,500	2,842.00	7,105,000	
東鉄工業	2,100	2,481.00	5,210,100	
イチケン	400	1,780.00	712,000	
富士ピー・エス	900	432.00	388,800	
浅沼組	1,300	2,787.00	3,623,100	
戸田建設	18,900	713.00	13,475,700	
熊谷組	2,700	2,508.00	6,771,600	
北野建設	300	2,489.00	746,700	
植木組	500	1,222.00	611,000	
矢作建設工業	2,200	725.00	1,595,000	
ピーエス三菱	2,000	611.00	1,222,000	
日本ハウスホールディングス	3,200	421.00	1,347,200	
新日本建設	2,300	716.00	1,646,800	
東亜道路工業	300	5,960.00	1,788,000	
日本道路	300	6,100.00	1,830,000	
東亜建設工業	1,300	2,408.00	3,130,400	
日本国土開発	4,700	576.00	2,707,200	
若築建設	700	2,536.00	1,775,200	
東洋建設	5,100	892.00	4,549,200	
五洋建設	21,700	730.00	15,841,000	
福田組	600	4,645.00	2,787,000	

住友林業	11,800	2,205.00	26,019,000
日本基礎技術	1,200	411.00	493,200
巴コーポレーション	1,900	349.00	663,100
大和ハウス工業	42,700	3,036.00	129,637,200
ライト工業	2,900	1,989.00	5,768,100
積水ハウス	47,900	2,433.50	116,564,650
日特建設	1,500	907.00	1,360,500
北陸電気工事	1,200	664.00	796,800
ユアテック	3,400	715.00	2,431,000
日本リーテック	1,100	725.00	797,500
四電工	700	1,665.00	1,165,500
中電工	2,400	2,054.00	4,929,600
関電工	8,500	860.00	7,310,000
きんでん	10,800	1,460.00	15,768,000
東京エネシス	1,600	936.00	1,497,600
トーエネック	500	3,425.00	1,712,500
住友電設	1,500	2,555.00	3,832,500
日本電設工業	2,600	1,612.00	4,191,200
エクシオグループ	7,500	2,128.00	15,960,000
新日本空調	900	1,864.00	1,677,600
九電工	3,700	3,250.00	12,025,000
三機工業	3,400	1,592.00	5,412,800
日揮ホールディングス	15,200	1,899.00	28,864,800
中外炉工業	600	1,571.00	942,600
ヤマト	1,400	666.00	932,400
太平電業	1,000	3,275.00	3,275,000
高砂熱学工業	3,700	1,821.00	6,737,700
三晃金属工業	200	2,843.00	568,600
朝日工業社	700	1,999.00	1,399,300
明星工業	2,800	715.00	2,002,000
大気社	1,900	3,515.00	6,678,500
ダイダン	1,000	2,113.00	2,113,000
日比谷総合設備	1,300	1,906.00	2,477,800
フィル・カンパニー	300	1,039.00	311,700
テスホールディングス	1,700	1,009.00	1,715,300
インフロニア・ホールディングス	16,100	1,019.00	16,405,900
東洋エンジニアリング	2,100	590.00	1,239,000
レイズネクスト	2,300	1,272.00	2,925,600
ニッポン	4,100	1,554.00	6,371,400
日清製粉グループ本社	14,200	1,566.00	22,237,200
日東富士製粉	300	4,360.00	1,308,000
昭和産業	1,300	2,529.00	3,287,700

鳥越製粉	1,200	619.00	742,800
中部飼料	2,100	1,014.00	2,129,400
フィード・ワン	2,300	674.00	1,550,200
東洋精糖	300	858.00	257,400
日本甜菜製糖	900	1,625.00	1,462,500
D M三井製糖ホールディングス	1,500	1,920.00	2,880,000
塩水港精糖	1,900	196.00	372,400
日新製糖	800	1,696.00	1,356,800
森永製菓	3,200	3,685.00	11,792,000
中村屋	400	3,040.00	1,216,000
江崎グリコ	4,400	3,435.00	15,114,000
名糖産業	600	1,580.00	948,000
井村屋グループ	800	2,205.00	1,764,000
不二家	1,000	2,581.00	2,581,000
山崎製パン	10,300	1,487.00	15,316,100
第一屋製パン	300	402.00	120,600
モロゾフ	500	3,635.00	1,817,500
亀田製菓	1,000	4,225.00	4,225,000
寿スピリッツ	1,600	7,700.00	12,320,000
カルビー	7,000	2,892.00	20,244,000
森永乳業	2,800	4,150.00	11,620,000
六甲バター	1,100	1,355.00	1,490,500
ヤクルト本社	11,000	8,180.00	89,980,000
明治ホールディングス	9,500	6,180.00	58,710,000
雪印メグミルク	3,700	1,624.00	6,008,800
プリマハム	2,100	1,932.00	4,057,200
日本ハム	6,000	3,545.00	21,270,000
林兼産業	500	446.00	223,000
丸大食品	1,600	1,398.00	2,236,800
S Foods	1,700	2,727.00	4,635,900
柿安本店	600	2,173.00	1,303,800
伊藤ハム米久ホールディングス	11,900	667.00	7,937,300
サッポロホールディングス	5,000	3,310.00	16,550,000
アサヒグループホールディングス	35,500	4,249.00	150,839,500
キリンホールディングス	69,200	2,200.50	152,274,600
宝ホールディングス	10,400	1,020.00	10,608,000
オエノンホールディングス	4,600	270.00	1,242,000
養命酒製造	500	1,781.00	890,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,000	1,348.00	16,176,000
サントリー食品インターナショナル	10,800	5,050.00	54,540,000
ダイトーグループホールディングス	900	4,520.00	4,068,000
伊藤園	5,700	5,150.00	29,355,000

キーコーヒー	1,700	2,066.00	3,512,200
ユニカフェ	500	938.00	469,000
ジャパンフーズ	200	1,050.00	210,000
日清オイリオグループ	2,200	3,160.00	6,952,000
不二製油グループ本社	3,600	2,250.00	8,100,000
J・オイルミルズ	1,500	1,575.00	2,362,500
キッコーマン	10,200	7,710.00	78,642,000
味の素	37,600	4,120.00	154,912,000
ブルドックソース	600	1,648.00	988,800
キューピー	8,200	2,369.00	19,425,800
ハウス食品グループ本社	4,700	2,782.00	13,075,400
カゴメ	7,100	2,930.00	20,803,000
焼津水産化学工業	700	797.00	557,900
アリアケジャパン	1,300	5,360.00	6,968,000
ピエトロ	200	1,777.00	355,400
エバラ食品工業	400	3,130.00	1,252,000
やまみ	100	1,319.00	131,900
ニチレイ	7,000	2,593.00	18,151,000
東洋水産	7,700	5,790.00	44,583,000
イトアンドホールディングス	600	2,176.00	1,305,600
大冷	200	1,862.00	372,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	479.00	479,000
日清食品ホールディングス	5,500	9,890.00	54,395,000
永谷園ホールディングス	800	1,988.00	1,590,400
一正蒲鉾	700	735.00	514,500
フジッコ	1,600	1,903.00	3,044,800
ロック・フィールド	1,900	1,424.00	2,705,600
日本たばこ産業	101,000	2,796.00	282,396,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,625.00	1,787,500
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,773.00	1,950,300
なとり	1,000	2,038.00	2,038,000
イフジ産業	300	883.00	264,900
ファーマフーズ	2,400	1,234.00	2,961,600
ユーグレナ	9,800	888.00	8,702,400
紀文食品	1,200	893.00	1,071,600
ピックルスホールディングス	900	1,044.00	939,600
ミヨシ油脂	600	996.00	597,600
理研ビタミン	1,300	1,864.00	2,423,200
片倉工業	1,400	1,981.00	2,773,400
ゲンゼ	1,200	3,770.00	4,524,000
東洋紡	6,700	1,028.00	6,887,600
ユニチカ	4,700	274.00	1,287,800

富士紡ホールディングス	600	3,280.00	1,968,000
倉敷紡績	1,200	2,069.00	2,482,800
シキボウ	900	848.00	763,200
日本毛織	4,500	988.00	4,446,000
ダイトウボウ	2,500	84.00	210,000
トーア紡コーポレーション	600	346.00	207,600
ダイドーリミテッド	2,400	186.00	446,400
帝国繊維	1,800	1,565.00	2,817,000
帝人	15,000	1,229.00	18,435,000
東レ	104,500	723.90	75,647,550
住江織物	300	1,815.00	544,500
日本フェルト	900	395.00	355,500
イチカワ	200	1,294.00	258,800
日東製網	200	1,320.00	264,000
アツギ	900	370.00	333,000
ダイニック	400	606.00	242,400
セーレン	3,000	2,367.00	7,101,000
ソトー	500	795.00	397,500
東海染工	100	1,136.00	113,600
小松マテーレ	2,300	796.00	1,830,800
ワコールホールディングス	3,000	2,409.00	7,227,000
ホギメディカル	2,100	3,255.00	6,835,500
クラウディアホールディングス	300	289.00	86,700
T S Iホールディングス	5,500	458.00	2,519,000
マツオカコーポレーション	400	905.00	362,000
ワールド	2,000	1,441.00	2,882,000
三陽商会	600	1,211.00	726,600
ナイガイ	500	258.00	129,000
オンワードホールディングス	10,100	308.00	3,110,800
ルックホールディングス	400	2,071.00	828,400
ゴールドウイン	2,800	7,790.00	21,812,000
デサント	2,700	3,515.00	9,490,500
キング	700	435.00	304,500
ヤマトインターナショナル	1,200	234.00	280,800
特種東海製紙	800	2,928.00	2,342,400
王子ホールディングス	65,000	514.00	33,410,000
日本製紙	8,100	887.00	7,184,700
三菱製紙	1,900	276.00	524,400
北越コーポレーション	9,800	779.00	7,634,200
中越パルプ工業	600	935.00	561,000
巴川製紙所	500	795.00	397,500
大王製紙	6,900	1,090.00	7,521,000

阿波製紙	300	299.00	89,700
レンゴー	14,200	863.00	12,254,600
トーモク	900	1,564.00	1,407,600
ザ・パック	1,200	2,354.00	2,824,800
北の達人コーポレーション	6,700	279.00	1,869,300
クラレ	24,800	1,020.00	25,296,000
旭化成	97,500	962.60	93,853,500
共和レザー	1,000	491.00	491,000
昭和電工	15,100	2,175.00	32,842,500
住友化学	115,700	472.00	54,610,400
住友精化	700	3,015.00	2,110,500
日産化学	7,400	6,520.00	48,248,000
ラサ工業	600	2,272.00	1,363,200
クレハ	1,300	9,570.00	12,441,000
多木化学	600	5,030.00	3,018,000
テイカ	1,100	1,311.00	1,442,100
石原産業	2,800	1,040.00	2,912,000
片倉コープアグリ	300	1,223.00	366,900
日本曹達	1,700	4,240.00	7,208,000
東ソー	20,800	1,532.00	31,865,600
トクヤマ	5,000	1,750.00	8,750,000
セントラル硝子	2,500	3,455.00	8,637,500
東亜合成	8,000	1,149.00	9,192,000
大阪ソーダ	900	3,680.00	3,312,000
関東電化工業	3,000	973.00	2,919,000
デンカ	5,700	3,450.00	19,665,000
信越化学工業	26,700	15,780.00	421,326,000
日本カーバイド工業	600	1,323.00	793,800
堺化学工業	1,200	1,978.00	2,373,600
第一稀元素化学工業	1,500	1,258.00	1,887,000
エア・ウォーター	14,700	1,647.00	24,210,900
日本酸素ホールディングス	15,100	2,204.00	33,280,400
日本化学工業	500	1,862.00	931,000
東邦アセチレン	400	1,075.00	430,000
日本パーカライズン	7,700	955.00	7,353,500
高压ガス工業	2,300	633.00	1,455,900
四国化成工業	1,900	1,320.00	2,508,000
戸田工業	400	3,080.00	1,232,000
ステラ ケミファ	900	2,648.00	2,383,200
保土谷化学工業	400	2,836.00	1,134,400
日本触媒	2,400	5,280.00	12,672,000
大日精化工業	1,100	1,767.00	1,943,700

カネカ	3,600	3,705.00	13,338,000
三菱瓦斯化学	11,700	1,917.00	22,428,900
三井化学	13,100	2,779.00	36,404,900
J S R	14,600	2,723.00	39,755,800
東京応化工業	2,700	6,380.00	17,226,000
大阪有機化学工業	1,200	2,000.00	2,400,000
三菱ケミカルグループ	105,300	669.50	70,498,350
K Hネオケム	2,600	2,517.00	6,544,200
ダイセル	23,000	933.00	21,459,000
住友ベークライト	2,300	4,010.00	9,223,000
積水化学工業	32,400	1,878.00	60,847,200
日本ゼオン	9,400	1,302.00	12,238,800
アイカ工業	3,900	3,200.00	12,480,000
U B E	8,000	1,908.00	15,264,000
積水樹脂	2,300	1,662.00	3,822,600
タキロンシーアイ	3,500	507.00	1,774,500
旭有機材	1,000	2,575.00	2,575,000
ニチバン	1,000	1,705.00	1,705,000
リケンテクノス	3,400	490.00	1,666,000
大倉工業	700	1,874.00	1,311,800
積水化成成品工業	2,200	385.00	847,000
群栄化学工業	400	2,387.00	954,800
タイガースポリマー	800	393.00	314,400
ミライアル	500	1,583.00	791,500
ダイキアクシス	600	703.00	421,800
ダイキョーニシカワ	3,500	614.00	2,149,000
竹本容器	600	731.00	438,600
森六ホールディングス	800	1,703.00	1,362,400
恵和	500	3,575.00	1,787,500
日本化薬	11,900	1,161.00	13,815,900
カーリットホールディングス	1,400	665.00	931,000
日本精化	900	2,132.00	1,918,800
扶桑化学工業	1,500	3,260.00	4,890,000
トリケミカル研究所	2,100	2,164.00	4,544,400
A D E K A	5,400	2,216.00	11,966,400
日油	4,800	5,440.00	26,112,000
新日本理化	2,200	284.00	624,800
ハリマ化成グループ	1,100	821.00	903,100
花王	38,000	5,242.00	199,196,000
第一工業製薬	600	1,864.00	1,118,400
石原ケミカル	700	1,224.00	856,800
日華化学	700	865.00	605,500

ニイタカ	300	2,065.00	619,500
三洋化成工業	1,000	4,235.00	4,235,000
有機合成薬品工業	1,200	299.00	358,800
大日本塗料	1,900	733.00	1,392,700
日本ペイントホールディングス	69,000	997.00	68,793,000
関西ペイント	14,300	1,807.00	25,840,100
神東塗料	1,400	131.00	183,400
中国塗料	2,900	1,021.00	2,960,900
日本特殊塗料	1,000	860.00	860,000
藤倉化成	2,100	391.00	821,100
太陽ホールディングス	2,400	2,591.00	6,218,400
D I C	6,100	2,510.00	15,311,000
サカタインクス	3,500	1,039.00	3,636,500
東洋インキS Cホールディングス	3,100	1,903.00	5,899,300
T & K T O K A	1,400	956.00	1,338,400
富士フィルムホールディングス	30,000	6,895.00	206,850,000
資生堂	32,600	5,102.00	166,325,200
ライオン	18,800	1,410.00	26,508,000
高砂香料工業	1,100	2,778.00	3,055,800
マンダム	3,400	1,378.00	4,685,200
ミルボン	2,300	6,090.00	14,007,000
ファンケル	6,800	2,577.00	17,523,600
コーセー	3,200	14,930.00	47,776,000
コタ	1,300	1,573.00	2,044,900
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	1,650.00	13,200,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,450.00	7,630,000
アジュバンホールディングス	400	910.00	364,000
新日本製薬	900	1,534.00	1,380,600
エステー	1,200	1,482.00	1,778,400
アグロ カネショウ	600	1,333.00	799,800
コニシ	2,600	1,762.00	4,581,200
長谷川香料	3,200	3,150.00	10,080,000
星光P M C	800	527.00	421,600
小林製薬	4,800	7,990.00	38,352,000
荒川化学工業	1,300	924.00	1,201,200
メック	1,300	2,378.00	3,091,400
日本高純度化学	400	2,310.00	924,000
タカラバイオ	4,200	1,738.00	7,299,600
J C U	1,800	2,810.00	5,058,000
新田ゼラチン	1,000	994.00	994,000
O A T アグリオ	600	1,689.00	1,013,400
デクセリアルズ	4,500	3,155.00	14,197,500

アース製薬	1,400	5,330.00	7,462,000	
北興化学工業	1,600	903.00	1,444,800	
大成ラミック	500	2,978.00	1,489,000	
クミアイ化学工業	6,200	965.00	5,983,000	
日本農薬	2,900	864.00	2,505,600	
アキレス	1,000	1,377.00	1,377,000	
有沢製作所	2,600	1,218.00	3,166,800	
日東電工	11,300	7,990.00	90,287,000	
レック	2,300	831.00	1,911,300	
三光合成	2,200	464.00	1,020,800	
きもと	2,400	240.00	576,000	
藤森工業	1,200	3,080.00	3,696,000	
前澤化成工業	1,000	1,383.00	1,383,000	
未来工業	600	1,473.00	883,800	
ウェーブロックホールディングス	500	587.00	293,500	
J S P	1,100	1,411.00	1,552,100	
エフピコ	3,000	3,675.00	11,025,000	
天馬	1,300	2,071.00	2,692,300	
信越ポリマー	2,900	1,224.00	3,549,600	
東リ	3,600	198.00	712,800	
ニフコ	5,600	3,425.00	19,180,000	
バルカー	1,300	2,674.00	3,476,200	
ユニ・チャーム	32,600	4,456.00	145,265,600	
ショーエイコーポレーション	500	563.00	281,500	
協和キリン	18,900	3,220.00	60,858,000	
武田薬品工業	138,300	3,866.00	534,667,800	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	149,800	2,060.50	308,662,900	
住友ファーマ	11,600	1,015.00	11,774,000	
塩野義製薬	20,000	6,600.00	132,000,000	
わかもと製薬	1,600	218.00	348,800	
日本新薬	3,700	7,930.00	29,341,000	
中外製薬	48,900	3,370.00	164,793,000	
科研製薬	2,700	3,695.00	9,976,500	
エーザイ	19,000	8,692.00	165,148,000	
ロート製薬	7,600	4,525.00	34,390,000	
小野薬品工業	30,200	3,478.00	105,035,600	
久光製薬	3,500	3,630.00	12,705,000	
持田製薬	1,900	3,100.00	5,890,000	
参天製薬	30,400	992.00	30,156,800	
扶桑薬品工業	500	2,024.00	1,012,000	
日本ケミファ	200	1,645.00	329,000	
ツムラ	4,900	2,924.00	14,327,600	

キッセイ薬品工業	2,400	2,539.00	6,093,600
生化学工業	3,000	903.00	2,709,000
栄研化学	2,600	1,858.00	4,830,800
鳥居薬品	800	2,905.00	2,324,000
JCRファーマ	5,300	1,894.00	10,038,200
東和薬品	2,400	2,161.00	5,186,400
富士製薬工業	1,000	1,072.00	1,072,000
ゼリア新薬工業	2,200	2,192.00	4,822,400
第一三共	136,200	4,636.00	631,423,200
キョーリン製薬ホールディングス	3,400	1,770.00	6,018,000
大幸薬品	2,900	525.00	1,522,500
ダイト	1,200	2,494.00	2,992,800
大塚ホールディングス	35,800	4,548.00	162,818,400
大正製薬ホールディングス	3,500	5,260.00	18,410,000
ペプチドリーム	7,600	1,541.00	11,711,600
あすか製薬ホールディングス	1,700	1,147.00	1,949,900
サワイグループホールディングス	3,600	4,130.00	14,868,000
日本コークス工業	14,100	87.00	1,226,700
ニチレキ	1,800	1,287.00	2,316,600
ユシロ化学工業	800	794.00	635,200
ビーピー・カストロール	600	935.00	561,000
富士石油	3,200	305.00	976,000
MORESCO	500	1,038.00	519,000
出光興産	17,400	3,375.00	58,725,000
ENEOSホールディングス	282,400	504.20	142,386,080
コスモエネルギーホールディングス	5,900	3,845.00	22,685,500
横浜ゴム	8,900	2,305.00	20,514,500
TOYO TIRE	8,900	1,714.00	15,254,600
ブリヂストン	49,900	5,326.00	265,767,400
住友ゴム工業	15,300	1,258.00	19,247,400
藤倉コンポジット	1,000	806.00	806,000
オカモト	900	3,685.00	3,316,500
フコク	800	1,003.00	802,400
ニッタ	1,600	2,857.00	4,571,200
住友理工	3,000	613.00	1,839,000
三ツ星ベルト	2,300	3,245.00	7,463,500
バンドー化学	2,400	1,050.00	2,520,000
日東紡績	1,900	2,221.00	4,219,900
AGC	15,900	4,325.00	68,767,500
日本板硝子	7,900	554.00	4,376,600
石塚硝子	200	1,446.00	289,200
日本山村硝子	600	575.00	345,000

日本電気硝子	6,400	2,454.00	15,705,600
オハラ	700	1,245.00	871,500
住友大阪セメント	2,200	3,105.00	6,831,000
太平洋セメント	9,900	2,026.00	20,057,400
日本ヒューム	1,300	616.00	800,800
日本コンクリート工業	3,000	236.00	708,000
三谷セキサン	700	3,680.00	2,576,000
アジアパイルホールディングス	2,400	493.00	1,183,200
東海カーボン	13,100	1,004.00	13,152,400
日本カーボン	900	4,230.00	3,807,000
東洋炭素	1,000	3,750.00	3,750,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,060.00	3,248,000
TOTO	10,300	4,240.00	43,672,000
日本碍子	18,500	1,743.00	32,245,500
日本特殊陶業	11,900	2,708.00	32,225,200
ダントーホールディングス	1,100	246.00	270,600
MARUWA	600	17,660.00	10,596,000
品川リフラクトリーズ	400	3,960.00	1,584,000
黒崎播磨	300	4,735.00	1,420,500
ヨータイ	1,000	1,394.00	1,394,000
東京窯業	1,500	259.00	388,500
ニッカトー	700	457.00	319,900
フジインコーポレーテッド	1,200	6,150.00	7,380,000
クニミネ工業	500	809.00	404,500
エーアンドエーマテリアル	300	848.00	254,400
ニチアス	3,900	2,212.00	8,626,800
ニチハ	2,000	2,754.00	5,508,000
日本製鉄	72,000	2,179.00	156,888,000
神戸製鋼所	32,500	642.00	20,865,000
合同製鐵	800	1,843.00	1,474,400
JFEホールディングス	43,000	1,480.00	63,640,000
東京製鐵	4,600	1,340.00	6,164,000
共英製鋼	1,900	1,316.00	2,500,400
大和工業	2,700	4,735.00	12,784,500
東京鐵鋼	800	1,403.00	1,122,400
大阪製鐵	800	1,093.00	874,400
淀川製鋼所	1,900	2,499.00	4,748,100
丸一鋼管	4,900	2,833.00	13,881,700
モリ工業	400	2,800.00	1,120,000
大同特殊鋼	2,000	4,305.00	8,610,000
日本高周波鋼業	800	315.00	252,000
日本冶金工業	1,200	3,695.00	4,434,000

山陽特殊製鋼	1,600	2,159.00	3,454,400
愛知製鋼	1,000	2,347.00	2,347,000
日立金属	15,000	2,172.00	32,580,000
日本金属	500	960.00	480,000
大太平洋金属	1,200	1,881.00	2,257,200
新日本電工	10,500	356.00	3,738,000
栗本鐵工所	800	1,747.00	1,397,600
虹技	300	897.00	269,100
日本鑄鉄管	300	938.00	281,400
三菱製鋼	1,100	952.00	1,047,200
日亜鋼業	2,100	232.00	487,200
日本精線	200	4,130.00	826,000
エンビプロ・ホールディングス	1,200	776.00	931,200
シンニッタン	2,200	221.00	486,200
新家工業	400	2,066.00	826,400
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,276.00	2,934,800
日本軽金属ホールディングス	4,300	1,498.00	6,441,400
三井金属鉱業	4,700	3,115.00	14,640,500
東邦亜鉛	1,000	2,171.00	2,171,000
三菱マテリアル	10,700	2,019.00	21,603,300
住友金属鉱山	18,600	4,482.00	83,365,200
D O W Aホールディングス	3,600	4,805.00	17,298,000
古河機械金属	2,400	1,328.00	3,187,200
エス・サイエンス	10,700	27.00	288,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	4,460.00	10,704,000
東邦チタニウム	2,900	2,809.00	8,146,100
U A C J	2,300	2,212.00	5,087,600
C Kサンエツ	400	4,125.00	1,650,000
古河電気工業	5,400	2,351.00	12,695,400
住友電気工業	55,600	1,585.50	88,153,800
フジクラ	17,300	901.00	15,587,300
昭和電線ホールディングス	1,800	1,646.00	2,962,800
タツタ電線	3,300	432.00	1,425,600
カナレ電気	300	1,440.00	432,000
平河ヒューテック	900	1,105.00	994,500
リョービ	1,700	1,306.00	2,220,200
アーレスティ	1,900	372.00	706,800
アサヒホールディングス	6,500	1,912.00	12,428,000
稲葉製作所	1,000	1,355.00	1,355,000
宮地エンジニアリンググループ	400	3,245.00	1,298,000
トーカロ	4,500	1,190.00	5,355,000
アルファC o	600	945.00	567,000

SUMCO	30,600	1,921.00	58,782,600
川田テクノロジーズ	400	3,545.00	1,418,000
RS Technologies	500	7,230.00	3,615,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,454.00	290,800
信和	900	799.00	719,100
東洋製罐グループホールディングス	10,600	1,533.00	16,249,800
ホッカンホールディングス	900	1,308.00	1,177,200
コロナ	900	845.00	760,500
横河ブリッジホールディングス	2,100	1,858.00	3,901,800
駒井ハルテック	300	1,556.00	466,800
高田機工	100	2,346.00	234,600
三和ホールディングス	14,800	1,226.00	18,144,800
文化シャッター	4,700	1,069.00	5,024,300
三協立山	2,200	546.00	1,201,200
アルインコ	1,200	968.00	1,161,600
東洋シャッター	400	492.00	196,800
LIXIL	23,400	1,943.00	45,466,200
日本フィルコン	1,100	454.00	499,400
ノーリツ	2,400	1,489.00	3,573,600
長府製作所	1,600	1,918.00	3,068,800
リンナイ	2,900	9,890.00	28,681,000
ダイニチ工業	900	663.00	596,700
日東精工	2,300	515.00	1,184,500
三洋工業	200	1,611.00	322,200
岡部	2,600	697.00	1,812,200
ジーテクト	1,800	1,489.00	2,680,200
東プレ	2,900	1,206.00	3,497,400
高周波熱錬	2,700	685.00	1,849,500
東京製綱	1,000	891.00	891,000
サンコール	1,400	670.00	938,000
モリテック スチール	1,300	323.00	419,900
パイオラックス	2,200	1,884.00	4,144,800
エイチワン	1,700	605.00	1,028,500
日本発條	14,200	825.00	11,715,000
中央発條	900	695.00	625,500
アドバネクス	200	1,060.00	212,000
立川ブラインド工業	700	1,079.00	755,300
三益半導体工業	1,500	2,282.00	3,423,000
日本ドライケミカル	400	1,497.00	598,800
日本製鋼所	4,300	3,165.00	13,609,500
三浦工業	6,600	3,065.00	20,229,000
タクマ	4,800	1,224.00	5,875,200

ツガミ	3,500	1,122.00	3,927,000
オークマ	1,600	5,020.00	8,032,000
芝浦機械	1,800	2,877.00	5,178,600
アマダ	25,100	1,052.00	26,405,200
アイダエンジニアリング	3,300	854.00	2,818,200
TAKISAWA	400	1,091.00	436,400
FUJII	6,800	1,991.00	13,538,800
牧野フライス製作所	1,700	4,545.00	7,726,500
オーエスジー	7,500	1,927.00	14,452,500
ダイジェット工業	200	807.00	161,400
旭ダイヤモンド工業	4,600	766.00	3,523,600
DMG森精機	9,500	1,761.00	16,729,500
ソディック	4,400	769.00	3,383,600
ディスコ	2,500	35,750.00	89,375,000
日東工器	800	1,556.00	1,244,800
日進工具	1,300	1,124.00	1,461,200
パンチ工業	1,400	402.00	562,800
富士ダイス	800	575.00	460,000
豊和工業	900	886.00	797,400
ニデックオーケーケー	600	916.00	549,600
東洋機械金属	1,100	521.00	573,100
島精機製作所	2,500	1,978.00	4,945,000
オプトラン	2,300	2,086.00	4,797,800
NCホールディングス	300	1,968.00	590,400
イワキポンプ	1,100	1,394.00	1,533,400
フリー	1,700	1,144.00	1,944,800
ヤマシンフィルタ	3,800	488.00	1,854,400
日阪製作所	1,500	830.00	1,245,000
やまびこ	2,600	1,154.00	3,000,400
野村マイクロ・サイエンス	500	3,760.00	1,880,000
平田機工	800	4,315.00	3,452,000
ペガサスミシン製造	1,800	897.00	1,614,600
マルマエ	800	1,781.00	1,424,800
タツモ	900	1,532.00	1,378,800
ナブテスコ	9,900	3,110.00	30,789,000
三井海洋開発	2,000	1,794.00	3,588,000
レオン自動機	1,700	1,167.00	1,983,900
S M C	5,100	60,990.00	311,049,000
ホソカワミクロン	1,200	2,705.00	3,246,000
ユニオンツール	700	3,550.00	2,485,000
オイレス工業	2,200	1,454.00	3,198,800
日精エー・エス・ビー機械	700	3,635.00	2,544,500

サトーホールディングス	2,200	1,852.00	4,074,400
技研製作所	1,700	3,090.00	5,253,000
日本エアータック	800	1,108.00	886,400
カワタ	500	846.00	423,000
日精樹脂工業	1,200	958.00	1,149,600
オカダアイヨン	500	1,455.00	727,500
ワイエイシイホールディングス	700	1,332.00	932,400
小松製作所	73,800	3,016.00	222,580,800
住友重機械工業	9,300	2,886.00	26,839,800
日立建機	6,300	2,974.00	18,736,200
日工	2,300	608.00	1,398,400
巴工業	700	2,383.00	1,668,100
井関農機	1,500	1,242.00	1,863,000
TOWA	1,600	1,751.00	2,801,600
丸山製作所	300	1,495.00	448,500
北川鉄工所	600	1,263.00	757,800
ローツェ	800	7,320.00	5,856,000
タカキタ	500	451.00	225,500
クボタ	83,300	2,096.50	174,638,450
荏原実業	800	2,281.00	1,824,800
三菱化工機	500	2,118.00	1,059,000
月島機械	2,200	991.00	2,180,200
帝国電機製作所	1,200	2,034.00	2,440,800
新東工業	3,200	682.00	2,182,400
澁谷工業	1,500	2,528.00	3,792,000
アイチ コーポレーション	2,300	789.00	1,814,700
小森コーポレーション	3,600	853.00	3,070,800
鶴見製作所	1,200	2,152.00	2,582,400
住友精密工業	200	2,518.00	503,600
酒井重工業	300	3,055.00	916,500
荏原製作所	6,400	4,980.00	31,872,000
石井鐵工所	200	2,456.00	491,200
西島製作所	1,400	1,293.00	1,810,200
北越工業	1,600	1,112.00	1,779,200
ダイキン工業	18,800	22,840.00	429,392,000
オルガノ	2,200	2,576.00	5,667,200
トーヨーカネツ	600	2,453.00	1,471,800
栗田工業	8,800	6,000.00	52,800,000
椿本チエイン	2,200	3,150.00	6,930,000
大同工業	700	747.00	522,900
木村化工機	1,200	718.00	861,600
アネスト岩田	2,700	883.00	2,384,100

ダイフク	8,100	6,900.00	55,890,000
サムコ	500	3,270.00	1,635,000
加藤製作所	800	738.00	590,400
油研工業	200	1,777.00	355,400
タダノ	8,300	925.00	7,677,500
フジテック	5,800	3,040.00	17,632,000
C K D	4,400	1,850.00	8,140,000
キトー	1,400	2,720.00	3,808,000
平和	5,200	2,420.00	12,584,000
理想科学工業	1,400	2,331.00	3,263,400
S A N K Y O	3,100	4,915.00	15,236,500
日本金銭機械	1,700	716.00	1,217,200
マースグループホールディングス	900	1,865.00	1,678,500
フクシマガリレイ	1,200	3,900.00	4,680,000
オーイズミ	600	398.00	238,800
ダイコク電機	900	1,460.00	1,314,000
竹内製作所	2,900	3,045.00	8,830,500
アマノ	4,500	2,541.00	11,434,500
J U K I	2,500	661.00	1,652,500
サンデン	2,500	212.00	530,000
ジャノメ	1,600	634.00	1,014,400
マックス	1,900	2,039.00	3,874,100
グローリー	4,100	2,279.00	9,343,900
新晃工業	1,600	1,540.00	2,464,000
大和冷機工業	2,400	1,252.00	3,004,800
セガサミーホールディングス	12,700	2,007.00	25,488,900
日本ピストンリング	500	1,191.00	595,500
リケン	600	2,230.00	1,338,000
T P R	1,800	1,254.00	2,257,200
ツバキ・ナカシマ	3,900	1,216.00	4,742,400
ホシザキ	10,100	4,185.00	42,268,500
大豊工業	1,400	717.00	1,003,800
日本精工	28,900	776.00	22,426,400
N T N	31,100	289.00	8,987,900
ジェイテクト	14,000	1,023.00	14,322,000
不二越	1,200	3,990.00	4,788,000
日本トムソン	3,900	539.00	2,102,100
T H K	9,100	2,618.00	23,823,800
ユーシン精機	1,200	675.00	810,000
前澤給装工業	1,100	913.00	1,004,300
イーグル工業	1,800	1,122.00	2,019,600
前澤工業	1,000	614.00	614,000

日本ピラー工業	1,500	2,472.00	3,708,000
キット	5,800	904.00	5,243,200
マキタ	19,600	2,693.00	52,782,800
三井E & Sホールディングス	7,100	448.00	3,180,800
日立造船	12,900	871.00	11,235,900
三菱重工業	27,500	5,341.00	146,877,500
I H I	9,900	3,385.00	33,511,500
サノヤスホールディングス	2,200	122.00	268,400
スター精密	3,000	1,686.00	5,058,000
日清紡ホールディングス	12,800	1,021.00	13,068,800
イビデン	9,000	4,920.00	44,280,000
コニカミノルタ	35,100	532.00	18,673,200
ブラザー工業	21,000	2,505.00	52,605,000
ミネベアミツミ	27,400	2,184.00	59,841,600
日立製作所	79,000	7,049.00	556,871,000
東芝	30,300	5,118.00	155,075,400
三菱電機	162,700	1,315.50	214,031,850
富士電機	9,600	5,890.00	56,544,000
東洋電機製造	600	834.00	500,400
安川電機	18,600	4,200.00	78,120,000
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,370.00	2,329,000
明電舎	2,400	1,995.00	4,788,000
オリジン	400	1,360.00	544,000
山洋電気	700	5,850.00	4,095,000
デンヨー	1,200	1,445.00	1,734,000
P H C ホールディングス	2,200	1,588.00	3,493,600
東芝テック	2,300	4,010.00	9,223,000
芝浦メカトロニクス	300	9,860.00	2,958,000
マブチモーター	3,900	4,095.00	15,970,500
日本電産	38,200	8,148.00	311,253,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	481.00	577,200
トレックス・セミコンダクター	800	2,959.00	2,367,200
東光高岳	1,000	1,792.00	1,792,000
ダブル・スコープ	5,100	1,823.00	9,297,300
ダイヘン	1,400	3,885.00	5,439,000
ヤーマン	3,100	1,101.00	3,413,100
J V C ケンウッド	14,400	330.00	4,752,000
ミマキエンジニアリング	1,500	724.00	1,086,000
I - P E X	900	1,318.00	1,186,200
日新電機	3,800	1,361.00	5,171,800
大崎電気工業	3,800	528.00	2,006,400
オムロン	14,400	6,791.00	97,790,400

日東工業	2,100	2,431.00	5,105,100	
I D E C	2,300	3,005.00	6,911,500	
正興電機製作所	600	983.00	589,800	
不二電機工業	300	1,080.00	324,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,200	2,342.00	12,178,400	
サクサホールディングス	300	1,268.00	380,400	
メルコホールディングス	400	2,996.00	1,198,400	
テクノメディカ	400	1,574.00	629,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,165.00	582,500	
日本電気	22,300	4,695.00	104,698,500	
富士通	15,700	17,530.00	275,221,000	
沖電気工業	7,200	729.00	5,248,800	
岩崎通信機	700	795.00	556,500	
電気興業	800	2,408.00	1,926,400	
サンケン電気	1,500	5,360.00	8,040,000	
ナカヨ	300	1,085.00	325,500	
アイホン	1,000	1,835.00	1,835,000	
ルネサスエレクトロニクス	102,700	1,262.00	129,607,400	
セイコーエプソン	20,900	2,053.00	42,907,700	
ワコム	12,500	611.00	7,637,500	
アルバック	3,700	5,830.00	21,571,000	
アクセル	600	1,316.00	789,600	
E I Z O	1,200	3,700.00	4,440,000	
日本信号	3,600	995.00	3,582,000	
京三製作所	3,300	401.00	1,323,300	
能美防災	2,100	1,565.00	3,286,500	
ホーチキ	1,200	1,352.00	1,622,400	
星和電機	700	424.00	296,800	
エレコム	3,800	1,386.00	5,266,800	
パナソニック ホールディングス	185,900	1,231.50	228,935,850	
シャープ	18,900	859.00	16,235,100	
アンリツ	11,100	1,459.00	16,194,900	
富士通ゼネラル	4,500	3,240.00	14,580,000	
ソニーグループ	110,200	10,845.00	1,195,119,000	代用有価証券 35,000株
T D K	24,900	4,845.00	120,640,500	
帝国通信工業	700	1,489.00	1,042,300	
タムラ製作所	6,800	749.00	5,093,200	
アルプスアルパイン	14,100	1,249.00	17,610,900	
池上通信機	500	535.00	267,500	
日本電波工業	1,900	1,668.00	3,169,200	
鈴木	900	873.00	785,700	

メイコー	1,700	2,634.00	4,477,800
日本トリム	400	2,304.00	921,600
ローランド ディー・ジー・	900	3,220.00	2,898,000
フォスター電機	1,500	797.00	1,195,500
S M K	400	2,620.00	1,048,000
ヨコオ	1,200	2,055.00	2,466,000
ホシデン	3,800	1,572.00	5,973,600
ヒロセ電機	2,600	18,060.00	46,956,000
日本航空電子工業	3,200	2,302.00	7,366,400
T O A	1,800	754.00	1,357,200
マクセル	3,400	1,353.00	4,600,200
古野電気	2,100	1,035.00	2,173,500
スミダコーポレーション	1,500	1,335.00	2,002,500
アイコム	600	2,525.00	1,515,000
リオン	700	1,874.00	1,311,800
本多通信工業	400	702.00	280,800
横河電機	17,200	2,510.00	43,172,000
新電元工業	600	3,415.00	2,049,000
アズビル	10,900	4,045.00	44,090,500
東亜ディーケーケー	800	868.00	694,400
日本光電工業	7,200	3,315.00	23,868,000
チノー	600	1,763.00	1,057,800
共和電業	1,600	330.00	528,000
日本電子材料	1,000	1,436.00	1,436,000
堀場製作所	3,500	6,110.00	21,385,000
アドバンテスト	12,300	7,770.00	95,571,000
小野測器	600	373.00	223,800
エスペック	1,200	1,873.00	2,247,600
キーエンス	15,600	56,970.00	888,732,000
日置電機	800	6,820.00	5,456,000
シスメックス	13,400	7,868.00	105,431,200
日本マイクロニクス	2,600	1,397.00	3,632,200
メガチップス	1,300	2,584.00	3,359,200
O B A R A G R O U P	700	3,395.00	2,376,500
澤藤電機	200	1,182.00	236,400
原田工業	700	777.00	543,900
コーセル	2,100	829.00	1,740,900
イリソ電子工業	1,400	4,740.00	6,636,000
オブテックスグループ	2,900	2,045.00	5,930,500
千代田インテグレ	600	2,294.00	1,376,400
レーザーテック	7,700	21,540.00	165,858,000
スタンレー電気	11,100	2,668.00	29,614,800

岩崎電気	500	2,555.00	1,277,500	
ウシオ電機	8,100	1,639.00	13,275,900	
岡谷電機産業	1,300	272.00	353,600	
ハリオス テクノ ホールディング	1,500	499.00	748,500	
エノモト	400	1,681.00	672,400	
日本セラミック	1,600	2,565.00	4,104,000	
遠藤照明	700	741.00	518,700	
古河電池	1,100	1,035.00	1,138,500	
双信電機	700	408.00	285,600	
山一電機	1,400	1,836.00	2,570,400	
図研	1,400	3,200.00	4,480,000	
日本電子	3,900	5,410.00	21,099,000	
カシオ計算機	11,600	1,320.00	15,312,000	
ファナック	15,300	19,925.00	304,852,500	
日本シイエムケイ	3,400	534.00	1,815,600	
エンプラス	500	4,405.00	2,202,500	
大真空	1,900	938.00	1,782,200	
ローム	7,200	10,460.00	75,312,000	
浜松ホトニクス	12,500	6,640.00	83,000,000	
三井ハイテック	1,600	7,500.00	12,000,000	
新光電気工業	5,500	3,685.00	20,267,500	
京セラ	24,200	6,732.00	162,914,400	
太陽誘電	7,600	3,995.00	30,362,000	
村田製作所	47,300	7,129.00	337,201,700	
双葉電子工業	3,000	597.00	1,791,000	
北陸電気工業	600	1,060.00	636,000	
ニチコン	3,200	1,457.00	4,662,400	
日本ケミコン	1,500	2,053.00	3,079,500	
K O A	2,400	2,177.00	5,224,800	
市光工業	2,300	412.00	947,600	
小糸製作所	18,700	2,032.00	37,998,400	
ミツバ	2,900	419.00	1,215,100	
S C R E E Nホールディングス	2,700	8,040.00	21,708,000	
キャノン電子	1,700	1,564.00	2,658,800	
キャノン	85,500	3,182.00	272,061,000	代用有価証券 10,000株
リコー	40,800	1,035.00	42,228,000	
象印マホービン	4,700	1,506.00	7,078,200	
M U T O Hホールディングス	200	1,808.00	361,600	
東京エレクトロン	11,000	39,390.00	433,290,000	
イノテック	1,000	1,239.00	1,239,000	
トヨタ紡織	6,600	1,955.00	12,903,000	
芦森工業	300	1,040.00	312,000	

ユニプレス	2,800	895.00	2,506,000
豊田自動織機	11,400	7,650.00	87,210,000
モリタホールディングス	2,700	1,224.00	3,304,800
三櫻工業	2,400	681.00	1,634,400
デンソー	32,100	7,415.00	238,021,500
東海理化電機製作所	4,400	1,584.00	6,969,600
川崎重工業	11,800	2,611.00	30,809,800
名村造船所	4,000	557.00	2,228,000
日本車輛製造	600	1,931.00	1,158,600
三菱ロジスネクスト	2,600	857.00	2,228,200
近畿車輛	200	966.00	193,200
日産自動車	221,500	488.50	108,202,750
いすゞ自動車	45,300	1,775.00	80,407,500
トヨタ自動車	855,600	1,993.00	1,705,210,800
日野自動車	20,100	628.00	12,622,800
三菱自動車工業	60,800	640.00	38,912,000
エフテック	1,200	520.00	624,000
レシップホールディングス	700	474.00	331,800
G M B	300	744.00	223,200
ファルテック	300	615.00	184,500
武蔵精密工業	3,800	1,689.00	6,418,200
日産車体	2,800	865.00	2,422,000
新明和工業	4,900	1,028.00	5,037,200
極東開発工業	2,800	1,373.00	3,844,400
トピー工業	1,300	1,686.00	2,191,800
ティラド	400	2,757.00	1,102,800
タチエス	2,500	1,109.00	2,772,500
N O K	6,100	1,236.00	7,539,600
フタバ産業	4,300	377.00	1,621,100
K Y B	1,500	3,460.00	5,190,000
大同メタル工業	3,100	512.00	1,587,200
プレス工業	7,000	421.00	2,947,000
ミクニ	1,900	321.00	609,900
太平洋工業	3,600	1,051.00	3,783,600
河西工業	2,300	191.00	439,300
アイシン	12,000	3,830.00	45,960,000
マツダ	51,500	1,043.00	53,714,500
今仙電機製作所	1,100	552.00	607,200
本田技研工業	126,700	3,402.00	431,033,400
スズキ	28,600	5,041.00	144,172,600
S U B A R U	49,300	2,510.00	123,743,000
安永	700	706.00	494,200

ヤマハ発動機	24,500	3,160.00	77,420,000
T B K	1,700	280.00	476,000
エクセディ	2,600	1,715.00	4,459,000
豊田合成	4,500	2,364.00	10,638,000
愛三工業	2,600	724.00	1,882,400
盟和産業	300	935.00	280,500
日本プラスト	1,300	428.00	556,400
ヨロズ	1,500	895.00	1,342,500
エフ・シー・シー	2,800	1,440.00	4,032,000
シマノ	6,400	22,990.00	147,136,000
テイ・エス テック	7,100	1,574.00	11,175,400
ジャムコ	900	1,762.00	1,585,800
テルモ	48,700	4,330.00	210,871,000
クリエートメディック	500	870.00	435,000
日機装	3,800	1,015.00	3,857,000
日本エム・ディ・エム	900	1,009.00	908,100
島津製作所	19,000	3,865.00	73,435,000
J M S	1,400	501.00	701,400
長野計器	1,100	1,061.00	1,167,100
ブイ・テクノロジー	800	2,737.00	2,189,600
東京計器	1,200	1,288.00	1,545,600
愛知時計電機	600	1,344.00	806,400
インターアクション	900	1,353.00	1,217,700
オーバル	1,300	445.00	578,500
東京精密	3,400	4,240.00	14,416,000
マニー	6,800	2,055.00	13,974,000
ニコン	24,200	1,471.00	35,598,200
トプコン	8,200	1,604.00	13,152,800
オリンパス	97,400	3,063.00	298,336,200
理研計器	1,000	4,075.00	4,075,000
タムロン	1,200	3,040.00	3,648,000
H O Y A	33,700	13,475.00	454,107,500
シード	700	502.00	351,400
ノーリツ鋼機	1,500	2,677.00	4,015,500
A & D ホロンホールディングス	2,300	886.00	2,037,800
朝日インテック	20,500	2,422.00	49,651,000
シチズン時計	17,000	630.00	10,710,000
リズム	500	1,650.00	825,000
大研医器	1,100	457.00	502,700
メニコン	5,300	2,322.00	12,306,600
シンシア	100	503.00	50,300
松風	700	2,308.00	1,615,600

セイコーグループ	2,400	3,260.00	7,824,000
ニプロ	12,900	1,087.00	14,022,300
KYORITSU	2,300	121.00	278,300
中本パックス	500	1,492.00	746,000
スノーピーク	2,700	1,870.00	5,049,000
パラマウントベッドホールディングス	3,600	2,494.00	8,978,400
トランザクション	1,200	1,090.00	1,308,000
粧美堂	400	384.00	153,600
ニホンフラッシュ	1,500	948.00	1,422,000
前田工織	1,700	2,900.00	4,930,000
永大産業	1,700	214.00	363,800
アートネイチャー	1,600	765.00	1,224,000
バンダイナムコホールディングス	14,200	9,708.00	137,853,600
アイフィスジャパン	400	598.00	239,200
SHOEI	1,600	5,450.00	8,720,000
フランスベッドホールディングス	2,000	913.00	1,826,000
パイロットコーポレーション	2,400	5,770.00	13,848,000
萩原工業	1,000	1,010.00	1,010,000
フジシールインターナショナル	3,200	1,812.00	5,798,400
タカラトミー	7,200	1,253.00	9,021,600
広済堂ホールディングス	1,100	1,433.00	1,576,300
エステールホールディングス	400	614.00	245,600
タカノ	600	624.00	374,400
プロネクサス	1,300	939.00	1,220,700
ホクシン	1,200	144.00	172,800
ウッドワン	500	910.00	455,000
大建工業	1,000	1,995.00	1,995,000
凸版印刷	20,400	2,134.00	43,533,600
大日本印刷	18,500	2,894.00	53,539,000
共同印刷	400	2,502.00	1,000,800
NISSHA	3,000	1,751.00	5,253,000
光村印刷	100	1,145.00	114,500
TAKARA & COMPANY	1,100	2,116.00	2,327,600
アシックス	14,400	2,389.00	34,401,600
ツツミ	400	1,955.00	782,000
ローランド	1,200	4,095.00	4,914,000
小松ウオール工業	600	1,808.00	1,084,800
ヤマハ	9,800	5,390.00	52,822,000
河合楽器製作所	400	2,648.00	1,059,200
クリナップ	1,700	602.00	1,023,400
ピジョン	9,900	1,899.00	18,800,100
兼松サステック	100	1,549.00	154,900

キングジム	1,400	885.00	1,239,000
リンテック	3,100	2,206.00	6,838,600
イトーキ	3,200	431.00	1,379,200
任天堂	98,400	6,121.00	602,306,400
三菱鉛筆	2,200	1,415.00	3,113,000
タカスタンダード	3,000	1,241.00	3,723,000
コクヨ	7,500	1,864.00	13,980,000
ナカバヤシ	1,700	517.00	878,900
グローブライド	1,300	2,356.00	3,062,800
オカムラ	4,700	1,456.00	6,843,200
美津濃	1,500	2,626.00	3,939,000
東京電力ホールディングス	140,400	453.00	63,601,200
中部電力	57,400	1,217.00	69,855,800
関西電力	60,200	1,110.00	66,822,000
中国電力	24,800	695.00	17,236,000
北陸電力	14,700	480.00	7,056,000
東北電力	38,100	601.00	22,898,100
四国電力	13,300	716.00	9,522,800
九州電力	35,900	717.00	25,740,300
北海道電力	15,100	440.00	6,644,000
沖縄電力	3,700	1,003.00	3,711,100
電源開発	11,700	2,108.00	24,663,600
エフオン	1,200	630.00	756,000
イーレックス	2,800	2,436.00	6,820,800
レノバ	4,100	3,200.00	13,120,000
東京瓦斯	32,900	2,549.00	83,862,100
大阪瓦斯	31,600	2,061.00	65,127,600
東邦瓦斯	6,100	2,625.00	16,012,500
北海道瓦斯	900	1,642.00	1,477,800
広島ガス	3,300	335.00	1,105,500
西部ガスホールディングス	1,500	1,634.00	2,451,000
静岡ガス	3,600	1,067.00	3,841,200
メタウォーター	2,000	1,889.00	3,778,000
SBSホールディングス	1,400	2,901.00	4,061,400
東武鉄道	17,100	3,285.00	56,173,500
相鉄ホールディングス	5,100	2,110.00	10,761,000
東急	43,700	1,681.00	73,459,700
京浜急行電鉄	17,700	1,496.00	26,479,200
小田急電鉄	23,600	1,689.00	39,860,400
京王電鉄	8,200	4,970.00	40,754,000
京成電鉄	10,000	3,870.00	38,700,000
富士急行	1,900	4,865.00	9,243,500

東日本旅客鉄道	26,400	7,947.00	209,800,800
西日本旅客鉄道	19,900	5,854.00	116,494,600
東海旅客鉄道	12,000	17,005.00	204,060,000
西武ホールディングス	18,900	1,321.00	24,966,900
鴻池運輸	2,700	1,531.00	4,133,700
西日本鉄道	4,200	2,787.00	11,705,400
ハマキョウレックス	1,200	3,265.00	3,918,000
サカイ引越センター	700	4,565.00	3,195,500
近鉄グループホールディングス	15,600	4,880.00	76,128,000
阪急阪神ホールディングス	20,800	4,215.00	87,672,000
南海電気鉄道	7,400	2,946.00	21,800,400
京阪ホールディングス	6,400	3,740.00	23,936,000
神戸電鉄	400	3,195.00	1,278,000
名古屋鉄道	17,200	2,236.00	38,459,200
山陽電気鉄道	1,200	2,207.00	2,648,400
アルプス物流	1,300	1,110.00	1,443,000
ヤマトホールディングス	19,900	2,225.00	44,277,500
山九	4,000	4,780.00	19,120,000
丸運	900	214.00	192,600
丸全昭和運輸	1,000	2,991.00	2,991,000
センコーグループホールディングス	8,300	989.00	8,208,700
トナミホールディングス	300	3,565.00	1,069,500
ニッコンホールディングス	5,000	2,343.00	11,715,000
日本石油輸送	200	2,188.00	437,600
福山通運	1,300	3,070.00	3,991,000
セイノーホールディングス	9,700	1,130.00	10,961,000
エスライン	500	760.00	380,000
神奈川中央交通	500	3,280.00	1,640,000
日立物流	3,400	8,900.00	30,260,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	3,800	1,469.00	5,582,200
C & F ロジホールディングス	1,500	1,172.00	1,758,000
九州旅客鉄道	11,000	2,952.00	32,472,000
S Gホールディングス	29,800	1,942.00	57,871,600
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,800	7,470.00	43,326,000
日本郵船	41,700	2,604.00	108,586,800
商船三井	27,500	2,948.00	81,070,000
川崎汽船	13,300	2,332.00	31,015,600
N S ユナイテッド海運	900	3,670.00	3,303,000
飯野海運	6,000	827.00	4,962,000
乾汽船	2,100	1,869.00	3,924,900
日本航空	38,200	2,830.00	108,106,000
A N Aホールディングス	42,400	2,978.00	126,267,200

パスコ	300	1,289.00	386,700
トランコム	400	7,430.00	2,972,000
日新	1,200	1,982.00	2,378,400
三菱倉庫	3,300	3,340.00	11,022,000
三井倉庫ホールディングス	1,500	3,555.00	5,332,500
住友倉庫	4,300	2,070.00	8,901,000
澁澤倉庫	600	2,061.00	1,236,600
東陽倉庫	2,100	252.00	529,200
日本トランスシティ	3,200	484.00	1,548,800
ケイヒン	300	1,471.00	441,300
中央倉庫	800	922.00	737,600
川西倉庫	300	1,000.00	300,000
安田倉庫	1,000	918.00	918,000
ファイズホールディングス	300	942.00	282,600
東洋埠頭	500	1,217.00	608,500
上組	7,700	2,818.00	21,698,600
サンリツ	300	702.00	210,600
キムラユニティー	800	790.00	632,000
キューソー流通システム	900	1,054.00	948,600
東海運	900	273.00	245,700
エーアイティー	1,000	1,461.00	1,461,000
内外トランスライン	600	2,038.00	1,222,800
日本コンセプト	500	1,784.00	892,000
NEC ネットエスアイ	5,200	1,566.00	8,143,200
クロスキャット	900	1,338.00	1,204,200
システナ	26,200	403.00	10,558,600
デジタルアーツ	1,000	5,890.00	5,890,000
日鉄ソリューションズ	2,700	3,450.00	9,315,000
キューブシステム	900	985.00	886,500
コア	700	1,452.00	1,016,400
手間いらず	300	5,390.00	1,617,000
ラクーンホールディングス	1,600	1,218.00	1,948,800
ソリトンシステムズ	800	1,021.00	816,800
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,310.00	2,317,000
T I S	17,600	3,960.00	69,696,000
J N S ホールディングス	700	343.00	240,100
グリー	8,400	776.00	6,518,400
G M O ペパボ	200	1,890.00	378,000
コーエーテクモホールディングス	9,800	2,278.00	22,324,400
三菱総合研究所	800	4,730.00	3,784,000
ボルテージ	500	336.00	168,000
電算	200	1,604.00	320,800

A G S	700	605.00	423,500
ファインデックス	1,300	599.00	778,700
ブレインパッド	1,600	847.00	1,355,200
K L a b	3,100	467.00	1,447,700
ポールトゥウィンホールディングス	2,700	914.00	2,467,800
ネクソン	40,400	2,416.00	97,606,400
アイスタイル	5,000	559.00	2,795,000
エムアップホールディングス	1,900	1,424.00	2,705,600
エイチーム	1,100	746.00	820,600
エニグモ	2,000	537.00	1,074,000
テクノスジャパン	1,300	468.00	608,400
e n i s h	1,200	476.00	571,200
コロプラ	6,100	697.00	4,251,700
ブロードリーフ	9,200	541.00	4,977,200
クロス・マーケティンググループ	700	860.00	602,000
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,956.00	1,956,000
システム情報	1,400	963.00	1,348,200
メディアドゥ	600	2,002.00	1,201,200
じげん	4,600	351.00	1,614,600
ブイキューブ	1,900	781.00	1,483,900
エンカレッジ・テクノロジー	400	514.00	205,600
サイバーリンクス	500	1,298.00	649,000
フィックスターズ	1,800	1,116.00	2,008,800
C A R T A H O L D I N G S	800	1,683.00	1,346,400
オブティム	1,300	893.00	1,160,900
セレス	700	990.00	693,000
S H I F T	1,100	22,300.00	24,530,000
ティーガイア	1,600	1,639.00	2,622,400
セック	200	2,173.00	434,600
テクマトリックス	2,900	1,641.00	4,758,900
プロシップ	700	1,533.00	1,073,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,800	2,198.00	10,550,400
G M O ペイメントゲートウェイ	3,600	10,500.00	37,800,000
ザッパラス	600	368.00	220,800
システムリサーチ	500	1,972.00	986,000
インターネットイニシアティブ	8,700	2,294.00	19,957,800
さくらインターネット	1,700	520.00	884,000
ヴィンクス	500	1,485.00	742,500
G M O グローバルサイン・ホールディングス	500	4,485.00	2,242,500
S R A ホールディングス	800	3,270.00	2,616,000
システムインテグレータ	500	447.00	223,500
朝日ネット	1,700	579.00	984,300

e B A S E	2,200	566.00	1,245,200
アバントグループ	2,000	1,354.00	2,708,000
アドソル日進	700	1,424.00	996,800
ODKソリューションズ	400	590.00	236,000
フリービット	1,000	1,071.00	1,071,000
コムチュア	2,100	2,524.00	5,300,400
サイバーコム	300	1,476.00	442,800
アステリア	1,200	781.00	937,200
アイル	900	1,820.00	1,638,000
マークラインズ	900	2,526.00	2,273,400
メディカル・データ・ビジョン	2,300	1,009.00	2,320,700
g u m i	2,500	920.00	2,300,000
ショーケース	400	354.00	141,600
モバイルファクトリー	300	985.00	295,500
テラスカイ	700	2,411.00	1,687,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,676.00	1,340,800
P C Iホールディングス	700	1,018.00	712,600
アイビーシー	300	475.00	142,500
ネオジャパン	500	1,016.00	508,000
P R T I M E S	400	2,311.00	924,400
ラクス	7,400	1,636.00	12,106,400
ランドコンピュータ	400	828.00	331,200
ダブルスタンダード	600	2,540.00	1,524,000
オープンドア	1,100	1,918.00	2,109,800
マイネット	500	458.00	229,000
アカツキ	800	2,173.00	1,738,400
ベネフィットジャパン	100	1,523.00	152,300
U b i c o mホールディングス	500	2,129.00	1,064,500
カナミックネットワーク	2,200	599.00	1,317,800
ノムラシステムコーポレーション	1,500	122.00	183,000
チェンジ	3,800	1,851.00	7,033,800
シンクロ・フード	1,000	483.00	483,000
オークネット	800	2,151.00	1,720,800
キャピタル・アセット・プランニング	300	560.00	168,000
エイトレッド	200	1,441.00	288,200
マクロミル	3,500	1,118.00	3,913,000
ビーグリー	300	1,383.00	414,900
オロ	500	1,568.00	784,000
ユーザーローカル	600	1,527.00	916,200
テモナ	300	257.00	77,100
マネーフォワード	3,800	4,320.00	16,416,000
サインポスト	600	704.00	422,400

電算システムホールディングス	800	2,332.00	1,865,600
ソルクシーズ	1,300	359.00	466,700
フェイス	500	547.00	273,500
プロトコーポレーション	1,900	1,164.00	2,211,600
ハイマックス	500	1,453.00	726,500
野村総合研究所	32,100	3,120.00	100,152,000
サイバネットシステム	1,300	974.00	1,266,200
C Eホールディングス	800	496.00	396,800
日本システム技術	600	1,473.00	883,800
インテージホールディングス	2,100	1,620.00	3,402,000
東邦システムサイエンス	400	1,010.00	404,000
ソースネクスト	7,900	299.00	2,362,100
インフォコム	2,000	1,994.00	3,988,000
シンプレクス・ホールディングス	2,600	2,138.00	5,558,800
HEROZ	600	1,082.00	649,200
ラクスル	2,200	2,866.00	6,305,200
メルカリ	7,000	2,746.00	19,222,000
I P S	500	2,939.00	1,469,500
F I G	1,800	400.00	720,000
システムサポート	700	1,424.00	996,800
イーソル	1,000	632.00	632,000
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,198.00	1,797,000
東海ソフト	300	900.00	270,000
ウイングアーク1st	1,600	2,229.00	3,566,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,654.00	661,600
サーバーワークス	300	2,518.00	755,400
東名	100	1,480.00	148,000
ヴィッツ	200	927.00	185,400
トピラシステムズ	400	984.00	393,600
S a n s a n	5,800	1,389.00	8,056,200
L i n k - U	300	837.00	251,100
ギフティ	1,700	2,243.00	3,813,100
ベース	500	4,025.00	2,012,500
J M D C	2,600	5,090.00	13,234,000
フォーカスシステムズ	1,100	1,004.00	1,104,400
クレスコ	1,200	1,650.00	1,980,000
フジ・メディア・ホールディングス	15,000	1,014.00	15,210,000
オービック	5,200	21,100.00	109,720,000
ジャストシステム	2,200	3,025.00	6,655,000
T D C ソフト	1,300	1,248.00	1,622,400
Zホールディングス	222,500	345.40	76,851,500
トレンドマイクロ	9,000	7,160.00	64,440,000

I Dホールディングス	1,000	904.00	904,000
日本オラクル	3,000	7,740.00	23,220,000
アルファシステムズ	500	4,090.00	2,045,000
フューチャー	3,900	1,568.00	6,115,200
C A C Holdings	1,000	1,485.00	1,485,000
S Bテクノロジー	700	2,031.00	1,421,700
トーセ	400	772.00	308,800
オービックビジネスコンサルタント	3,100	3,910.00	12,121,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,400	3,185.00	26,754,000
アイティフォー	2,100	769.00	1,614,900
東計電算	200	5,750.00	1,150,000
エクスネット	200	1,004.00	200,800
大塚商会	8,900	4,505.00	40,094,500
サイボウズ	2,200	1,923.00	4,230,600
電通国際情報サービス	1,900	4,510.00	8,569,000
A C C E S S	1,900	788.00	1,497,200
デジタルガレージ	2,800	3,620.00	10,136,000
E Mシステムズ	2,600	936.00	2,433,600
ウェザーニューズ	600	7,520.00	4,512,000
C I J	1,400	798.00	1,117,200
ビジネスエンジニアリング	300	1,990.00	597,000
日本エンタープライズ	1,700	141.00	239,700
WOWOW	900	1,204.00	1,083,600
スカラ	1,500	732.00	1,098,000
インテリジェント ウェイブ	800	758.00	606,400
WOW WORLD GROUP	300	977.00	293,100
I M A G I C A GROUP	1,300	846.00	1,099,800
ネットワンシステムズ	5,800	3,300.00	19,140,000
システムソフト	5,700	98.00	558,600
アルゴグラフィックス	1,400	3,630.00	5,082,000
マーベラス	2,600	695.00	1,807,000
エイベックス	2,700	1,635.00	4,414,500
B I P R O G Y	5,700	3,140.00	17,898,000
兼松エレクトロニクス	1,000	4,360.00	4,360,000
都築電気	800	1,335.00	1,068,000
T B Sホールディングス	8,000	1,522.00	12,176,000
日本テレビホールディングス	13,800	1,047.00	14,448,600
朝日放送グループホールディングス	1,500	618.00	927,000
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,334.00	5,069,200
スカパーJ S A Tホールディングス	13,900	512.00	7,116,800
テレビ東京ホールディングス	1,100	1,820.00	2,002,000
日本BS放送	600	896.00	537,600

ビジョン	2,000	1,246.00	2,492,000
スマートバリュー	400	465.00	186,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,400	2,185.00	3,059,000
コネクシオ	1,000	1,089.00	1,089,000
日本通信	14,400	221.00	3,182,400
クロップス	300	1,032.00	309,600
日本電信電話	200,300	4,004.00	802,001,200
KDDI	120,800	4,255.00	514,004,000
ソフトバンク	251,100	1,495.00	375,394,500
光通信	1,800	18,190.00	32,742,000
エムティーアイ	1,400	511.00	715,400
GMOインターネットグループ	5,800	2,556.00	14,824,800
ファイバーゲート	700	888.00	621,600
アйдママーケティングコミュニケーション	400	278.00	111,200
KADOKAWA	8,300	2,459.00	20,409,700
学研ホールディングス	2,600	961.00	2,498,600
ゼンリン	2,700	858.00	2,316,600
昭文社ホールディングス	700	296.00	207,200
インプレスホールディングス	1,400	209.00	292,600
アイネット	900	1,325.00	1,192,500
松竹	900	11,660.00	10,494,000
東宝	9,800	5,150.00	50,470,000
東映	400	17,790.00	7,116,000
エヌ・ティ・ティ・データ	49,100	2,087.00	102,471,700
ピー・シー・エー	900	1,127.00	1,014,300
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,777.00	1,243,900
DTS	3,400	3,485.00	11,849,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	6,720.00	52,416,000
シーイーシー	2,200	1,497.00	3,293,400
カブコン	15,500	4,225.00	65,487,500
アイ・エス・ビー	800	1,327.00	1,061,600
ジャステック	1,000	1,279.00	1,279,000
SCSK	12,800	2,157.00	27,609,600
NSW	600	2,139.00	1,283,400
アイネス	1,100	1,475.00	1,622,500
TKC	2,800	3,660.00	10,248,000
富士ソフト	1,800	8,030.00	14,454,000
NSD	5,600	2,553.00	14,296,800
コナミグループ	6,700	6,770.00	45,359,000
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,255.00	3,580,500
JBCホールディングス	1,100	1,834.00	2,017,400
ミロク情報サービス	1,400	1,373.00	1,922,200

ソフトバンクグループ	90,400	6,601.00	596,730,400
高千穂交易	600	2,098.00	1,258,800
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,438.00	431,400
伊藤忠食品	400	5,080.00	2,032,000
エレマテック	1,500	1,515.00	2,272,500
あらた	1,300	3,990.00	5,187,000
トーメンデバイス	200	5,310.00	1,062,000
東京エレクトロン デバイス	600	6,750.00	4,050,000
円谷フィールズホールディングス	1,400	2,154.00	3,015,600
双日	17,500	2,414.00	42,245,000
アルフレッサ ホールディングス	16,600	1,603.00	26,609,800
横浜冷凍	4,500	905.00	4,072,500
神栄	300	787.00	236,100
ラサ商事	800	999.00	799,200
アルコニックス	2,200	1,414.00	3,110,800
神戸物産	12,800	3,130.00	40,064,000
ハイパー	400	461.00	184,400
あい ホールディングス	2,700	2,225.00	6,007,500
ディーブイエックス	500	971.00	485,500
ダイワボウホールディングス	6,800	1,920.00	13,056,000
マクニカホールディングス	4,000	3,415.00	13,660,000
ラクト・ジャパン	700	2,053.00	1,437,100
グリムス	700	1,750.00	1,225,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	759.00	1,897,500
八洲電機	1,400	997.00	1,395,800
メディアスホールディングス	1,100	697.00	766,700
レスターホールディングス	1,600	2,103.00	3,364,800
ジューテックホールディングス	400	1,048.00	419,200
大光	800	682.00	545,600
OCHIホールディングス	400	1,189.00	475,600
TOKAIホールディングス	8,200	891.00	7,306,200
黒谷	500	562.00	281,000
Cominix	400	729.00	291,600
三洋貿易	1,800	1,042.00	1,875,600
ビューティガレージ	300	2,624.00	787,200
ウイン・パートナーズ	1,200	959.00	1,150,800
ミタチ産業	500	960.00	480,000
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,753.00	16,242,700
明治電機工業	700	1,021.00	714,700
デリカフーズホールディングス	800	506.00	404,800
スターティアホールディングス	400	1,232.00	492,800
コメダホールディングス	4,000	2,450.00	9,800,000

ピーバンドットコム	300	513.00	153,900
アセンテック	700	508.00	355,600
富士興産	400	1,150.00	460,000
協栄産業	200	1,697.00	339,400
フルサト・マルカホールディングス	1,700	3,635.00	6,179,500
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,480.00	1,480,000
小野建	1,500	1,471.00	2,206,500
南陽	400	1,808.00	723,200
佐島電機	1,100	1,301.00	1,431,100
エコートレーディング	400	535.00	214,000
伯東	1,000	3,470.00	3,470,000
コンドーテック	1,300	980.00	1,274,000
中山福	1,000	319.00	319,000
ナガイレーベン	2,100	1,980.00	4,158,000
三菱食品	1,500	3,130.00	4,695,000
松田産業	1,300	2,321.00	3,017,300
第一興商	3,200	4,200.00	13,440,000
メディバルホールディングス	17,100	1,769.00	30,249,900
S P K	800	1,411.00	1,128,800
萩原電気ホールディングス	700	2,281.00	1,596,700
アズワン	2,400	5,970.00	14,328,000
スズデン	600	2,391.00	1,434,600
シモジマ	1,200	1,017.00	1,220,400
ドウシシャ	1,800	1,506.00	2,710,800
小津産業	400	1,438.00	575,200
高速	900	1,626.00	1,463,400
たけびし	700	1,547.00	1,082,900
リックス	400	2,139.00	855,600
丸文	1,500	860.00	1,290,000
ハビネット	1,400	1,985.00	2,779,000
橋本総業ホールディングス	700	974.00	681,800
日本ライフライン	4,900	953.00	4,669,700
タカショー	1,500	666.00	999,000
I D O M	5,000	731.00	3,655,000
進和	1,100	1,891.00	2,080,100
エスケイジャパン	500	486.00	243,000
ダイトロン	700	2,305.00	1,613,500
シークス	2,400	1,147.00	2,752,800
田中商事	600	528.00	316,800
オーハシテクニカ	900	1,425.00	1,282,500
白銅	600	2,475.00	1,485,000
ダイコー通産	200	1,048.00	209,600

伊藤忠商事	99,300	4,101.00	407,229,300
丸紅	130,200	1,425.50	185,600,100
高島	300	2,643.00	792,900
長瀬産業	7,800	1,967.00	15,342,600
蝶理	900	1,982.00	1,783,800
豊田通商	14,400	5,110.00	73,584,000
三共生興	2,400	471.00	1,130,400
兼松	6,400	1,490.00	9,536,000
ツカモトコーポレーション	300	1,197.00	359,100
三井物産	120,700	3,628.00	437,899,600
日本紙パルプ商事	900	4,740.00	4,266,000
カメイ	1,800	1,106.00	1,990,800
東都水産	100	4,760.00	476,000
OUGホールディングス	300	2,373.00	711,900
スターゼン	1,300	2,044.00	2,657,200
山善	4,500	962.00	4,329,000
椿本興業	300	3,790.00	1,137,000
住友商事	102,100	2,177.00	222,271,700
内田洋行	700	4,600.00	3,220,000
三菱商事	103,100	4,403.00	453,949,300
第一実業	600	4,160.00	2,496,000
キャノンマーケティングジャパン	3,800	3,110.00	11,818,000
西華産業	700	1,634.00	1,143,800
佐藤商事	1,200	1,161.00	1,393,200
菱洋エレクトロ	1,400	2,260.00	3,164,000
東京産業	1,600	770.00	1,232,000
ユアサ商事	1,500	3,865.00	5,797,500
神鋼商事	400	4,275.00	1,710,000
トルク	1,100	214.00	235,400
阪和興業	3,000	3,795.00	11,385,000
正栄食品工業	1,100	4,150.00	4,565,000
カナデン	1,400	1,077.00	1,507,800
菱電商事	1,400	1,693.00	2,370,200
岩谷産業	3,800	5,490.00	20,862,000
ナイス	500	1,390.00	695,000
ニチモウ	200	2,476.00	495,200
極東貿易	1,000	1,296.00	1,296,000
アステナホールディングス	2,900	411.00	1,191,900
三愛オブリ	4,600	1,230.00	5,658,000
稲畑産業	3,400	2,401.00	8,163,400
G S I クレオス	1,000	1,407.00	1,407,000
明和産業	2,300	706.00	1,623,800

クワザワホールディングス	700	401.00	280,700
ワキタ	3,100	1,178.00	3,651,800
東邦ホールディングス	4,100	1,973.00	8,089,300
サンゲツ	4,200	1,909.00	8,017,800
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,019.00	2,241,800
シナネンホールディングス	600	3,965.00	2,379,000
伊藤忠エネクス	4,100	1,012.00	4,149,200
サンリオ	4,700	4,460.00	20,962,000
サンワテクノス	900	1,488.00	1,339,200
リョーサン	1,800	2,788.00	5,018,400
新光商事	2,300	1,042.00	2,396,600
トーホー	700	1,663.00	1,164,100
三信電気	700	1,979.00	1,385,300
東陽テクニカ	1,900	1,291.00	2,452,900
モスフードサービス	2,400	3,095.00	7,428,000
加賀電子	1,400	4,465.00	6,251,000
ソーダニッカ	1,300	625.00	812,500
立花エレテック	1,200	1,659.00	1,990,800
フォーバル	700	938.00	656,600
PALTAC	2,600	4,100.00	10,660,000
三谷産業	3,000	298.00	894,000
太平洋興発	700	709.00	496,300
西本Wismettacホールディングス	400	4,050.00	1,620,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,535.00	307,000
コア商事ホールディングス	1,200	600.00	720,000
KPPグループホールディングス	3,900	816.00	3,182,400
ヤマタネ	700	1,638.00	1,146,600
丸紅建材リース	200	1,718.00	343,600
日鉄物産	1,100	5,350.00	5,885,000
泉州電業	800	2,767.00	2,213,600
トラスコ中山	3,500	1,933.00	6,765,500
オートバックスセブン	5,800	1,406.00	8,154,800
モリト	1,200	750.00	900,000
加藤産業	2,000	3,490.00	6,980,000
北恵	400	750.00	300,000
イエローハット	3,000	1,732.00	5,196,000
JKホールディングス	1,300	1,060.00	1,378,000
日伝	1,000	1,668.00	1,668,000
北沢産業	1,200	188.00	225,600
杉本商事	800	1,961.00	1,568,800
因幡電機産業	4,300	2,732.00	11,747,600
東テク	600	3,375.00	2,025,000

ミスミグループ本社	24,900	3,150.00	78,435,000
アルテック	1,100	300.00	330,000
タキヒヨー	500	771.00	385,500
蔵王産業	300	1,710.00	513,000
スズケン	6,000	3,215.00	19,290,000
ジェコス	1,100	816.00	897,600
グローセル	1,900	430.00	817,000
ローソン	4,100	4,765.00	19,536,500
サンエー	1,300	4,210.00	5,473,000
カワチ薬品	1,300	2,066.00	2,685,800
エービーシー・マート	2,400	7,050.00	16,920,000
ハードオフコーポレーション	700	1,378.00	964,600
アスクル	4,000	1,568.00	6,272,000
ゲオホールディングス	1,700	2,052.00	3,488,400
アダストリア	2,000	2,052.00	4,104,000
ジーフット	900	291.00	261,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	400.00	120,000
くら寿司	1,900	3,395.00	6,450,500
キャンドウ	600	2,129.00	1,277,400
アイケイ	600	412.00	247,200
パルグループホールディングス	1,600	2,307.00	3,691,200
エディオン	6,500	1,224.00	7,956,000
サーラコーポレーション	3,500	776.00	2,716,000
ワッツ	900	652.00	586,800
ハローズ	700	2,918.00	2,042,600
フジオフードグループ本社	1,400	1,378.00	1,929,200
あみやき亭	400	2,885.00	1,154,000
ひらまつ	3,600	195.00	702,000
大黒天物産	600	4,680.00	2,808,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,195.00	1,792,500
ファーマライズホールディングス	400	635.00	254,000
アルペン	1,400	2,053.00	2,874,200
ハブ	600	670.00	402,000
クオールホールディングス	2,300	1,148.00	2,640,400
ジinzホールディングス	1,000	4,140.00	4,140,000
ビックカメラ	11,000	1,150.00	12,650,000
D C Mホールディングス	10,100	1,169.00	11,806,900
ペッパーフードサービス	3,500	212.00	742,000
MonotaRO	23,400	2,149.00	50,286,600
東京一番フーズ	400	580.00	232,000
アーランドサービスホールディングス	1,400	2,163.00	3,028,200
J．フロント リテイリング	20,500	1,182.00	24,231,000

ドトール・日レスホールディングス	2,900	1,650.00	4,785,000
マツキヨココカラ&カンパニー	10,000	5,380.00	53,800,000
ブロンコピリー	900	2,438.00	2,194,200
Z O Z O	10,900	3,160.00	34,444,000
トレジャー・ファクトリー	500	2,195.00	1,097,500
物語コーポレーション	900	6,690.00	6,021,000
三越伊勢丹ホールディングス	27,700	1,313.00	36,370,100
H a m e e	700	821.00	574,700
マーケットエンタープライズ	200	1,103.00	220,600
ウエルシアホールディングス	8,600	3,015.00	25,929,000
クリエイティブSDホールディングス	2,700	3,135.00	8,464,500
丸善C H Iホールディングス	2,000	319.00	638,000
ミサワ	300	582.00	174,600
ティーライフ	200	1,259.00	251,800
シュッピン	1,300	1,489.00	1,935,700
オイシックス・ラ・大地	2,200	1,578.00	3,471,600
ネクステージ	3,800	2,928.00	11,126,400
ジョイフル本田	5,300	1,792.00	9,497,600
鳥貴族ホールディングス	600	2,155.00	1,293,000
ホットランド	1,300	1,395.00	1,813,500
すかいらーくホールディングス	22,500	1,578.00	35,505,000
S F Pホールディングス	900	1,626.00	1,463,400
綿半ホールディングス	1,300	1,347.00	1,751,100
ヨシックスホールディングス	300	2,111.00	633,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,400	1,043.00	5,632,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	1,405.00	983,500
B E E N O S	900	2,704.00	2,433,600
あさひ	1,400	1,282.00	1,794,800
日本調剤	1,100	1,196.00	1,315,600
コスモス薬品	1,900	14,000.00	26,600,000
トーエル	800	695.00	556,000
セブン&アイ・ホールディングス	56,800	5,566.00	316,148,800
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	12,400	926.00	11,482,400
ツルハホールディングス	4,000	8,530.00	34,120,000
サンマルクホールディングス	1,300	1,613.00	2,096,900
フェリシモ	400	973.00	389,200
トリドールホールディングス	4,100	2,865.00	11,746,500
T O K Y O B A S E	1,800	342.00	615,600
ウイルプラスホールディングス	300	1,017.00	305,100
J Mホールディングス	1,400	1,631.00	2,283,400
サツドラホールディングス	800	671.00	536,800

アレンザホールディングス	1,200	937.00	1,124,400
串カツ田中ホールディングス	400	1,825.00	730,000
パロックジャパンリミテッド	1,100	784.00	862,400
クスリのアオキホールディングス	1,700	7,210.00	12,257,000
力の源ホールディングス	900	775.00	697,500
FOOD & LIFE COMPANIE	9,500	2,470.00	23,465,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	406.00	609,000
一家ホールディングス	400	637.00	254,800
ジャパンクラフトホールディングス	500	629.00	314,500
はるやまホールディングス	700	433.00	303,100
ノジマ	5,400	1,317.00	7,111,800
カッパ・クリエイト	2,600	1,363.00	3,543,800
ライトオン	1,300	626.00	813,800
良品計画	21,300	1,434.00	30,544,200
パリミキホールディングス	2,200	261.00	574,200
アドヴァングループ	1,600	866.00	1,385,600
アルビス	500	2,273.00	1,136,500
コナカ	1,900	334.00	634,600
ハウス オブ ローゼ	200	1,601.00	320,200
G - 7ホールディングス	2,100	1,400.00	2,940,000
イオン北海道	2,400	1,143.00	2,743,200
コジマ	3,200	607.00	1,942,400
ヒマラヤ	600	914.00	548,400
コーナン商事	2,200	3,135.00	6,897,000
エコス	600	1,801.00	1,080,600
ワタミ	2,000	901.00	1,802,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	37,000	2,471.00	91,427,000
西松屋チェーン	3,700	1,365.00	5,050,500
ゼンショーホールディングス	9,000	3,465.00	31,185,000
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,056.00	1,161,600
ハークスレイ	600	549.00	329,400
サイゼリヤ	2,700	2,872.00	7,754,400
V Tホールディングス	6,300	486.00	3,061,800
魚力	500	2,051.00	1,025,500
フジ・コーポレーション	900	1,232.00	1,108,800
ユナイテッドアローズ	1,800	2,071.00	3,727,800
ハイデイ日高	2,500	1,843.00	4,607,500
YU - WA Creation Holdi ngs	1,100	216.00	237,600
コロワイド	7,600	1,759.00	13,368,400
ピーシーデポコーポレーション	2,000	263.00	526,000
壱番屋	1,300	4,540.00	5,902,000

P L A N T	400	634.00	253,600
スギホールディングス	3,300	5,810.00	19,173,000
薬王堂ホールディングス	900	2,629.00	2,366,100
スクロール	2,500	707.00	1,767,500
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,720.00	2,408,000
木曽路	2,500	2,135.00	5,337,500
S R S ホールディングス	2,700	836.00	2,257,200
千趣会	3,000	397.00	1,191,000
リテールパートナーズ	2,500	1,184.00	2,960,000
ケーヨー	2,700	898.00	2,424,600
上新電機	1,500	1,923.00	2,884,500
日本瓦斯	8,800	2,062.00	18,145,600
ロイヤルホールディングス	3,200	2,382.00	7,622,400
東天紅	100	803.00	80,300
いなげや	1,600	1,115.00	1,784,000
チヨダ	1,600	723.00	1,156,800
ライフコーポレーション	1,400	2,180.00	3,052,000
リンガーハット	2,100	2,181.00	4,580,100
Mr M a x H D	2,300	667.00	1,534,100
A O K I ホールディングス	3,100	706.00	2,188,600
オークワ	2,600	894.00	2,324,400
コメリ	2,500	2,593.00	6,482,500
青山商事	3,500	1,049.00	3,671,500
しまむら	1,900	12,020.00	22,838,000
はせがわ	800	365.00	292,000
高島屋	12,400	1,833.00	22,729,200
松屋	2,800	1,016.00	2,844,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,000	1,271.00	10,168,000
近鉄百貨店	500	2,414.00	1,207,000
丸井グループ	12,200	2,390.00	29,158,000
アクシアル リテイリング	1,100	3,280.00	3,608,000
イオン	55,900	2,735.00	152,886,500
イズミ	2,500	3,000.00	7,500,000
平和堂	2,800	1,893.00	5,300,400
フジ	2,500	1,843.00	4,607,500
ヤオコー	1,900	6,470.00	12,293,000
ゼビオホールディングス	2,200	1,014.00	2,230,800
ケーズホールディングス	13,100	1,115.00	14,606,500
O l y m p i c グループ	700	504.00	352,800
日産東京販売ホールディングス	2,200	275.00	605,000
シルバーライフ	400	1,506.00	602,400
Genky DrugStores	800	3,685.00	2,948,000

ナルミヤ・インターナショナル	300	839.00	251,700
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,349.00	1,349,000
ギフトホールディングス	300	3,750.00	1,125,000
アインホールディングス	2,300	6,140.00	14,122,000
元気寿司	500	3,070.00	1,535,000
ヤマダホールディングス	67,600	462.00	31,231,200
アークランズ	2,400	1,451.00	3,482,400
ニトリホールディングス	6,700	13,885.00	93,029,500
愛眼	1,300	174.00	226,200
ケーユーホールディングス	1,000	1,185.00	1,185,000
吉野家ホールディングス	6,400	2,268.00	14,515,200
松屋フーズホールディングス	800	3,940.00	3,152,000
サガミホールディングス	2,700	1,210.00	3,267,000
関西フードマーケット	1,500	1,317.00	1,975,500
王将フードサービス	1,100	6,040.00	6,644,000
プレナス	1,800	2,635.00	4,743,000
ミニストップ	1,200	1,407.00	1,688,400
アークス	3,000	1,977.00	5,931,000
パローホールディングス	3,200	1,731.00	5,539,200
ベルク	800	5,430.00	4,344,000
大庄	900	1,028.00	925,200
ファーストリテイリング	2,500	83,840.00	209,600,000
サンドラッグ	6,300	3,390.00	21,357,000
サックスパーホールディングス	1,600	741.00	1,185,600
ヤマザワ	300	1,144.00	343,200
やまや	300	2,452.00	735,600
ベルーナ	4,000	694.00	2,776,000
いよぎんホールディングス	18,200	679.00	12,357,800
しずおかフィナンシャルグループ	34,700	934.00	32,409,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,900	873.00	11,261,700
島根銀行	500	416.00	208,000
じもとホールディングス	1,000	409.00	409,000
めぶきフィナンシャルグループ	76,100	290.00	22,069,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	2,150.00	4,300,000
九州フィナンシャルグループ	26,900	376.00	10,114,400
ゆうちょ銀行	43,700	992.00	43,350,400
富山第一銀行	3,900	403.00	1,571,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	84,500	450.00	38,025,000
西日本フィナンシャルホールディングス	9,700	742.00	7,197,400
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,438.00	2,013,200
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,570.00	6,168,000
ひろぎんホールディングス	20,000	611.00	12,220,000

おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,028.00	3,042,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,448.00	4,896,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,300	4,190.00	5,447,000	
プロクレアホールディングス	1,900	2,047.00	3,889,300	
あいちフィナンシャルグループ	2,100	1,934.00	4,061,400	
新生銀行	4,500	2,227.00	10,021,500	
あおぞら銀行	9,600	2,555.00	24,528,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,006,200	703.80	708,163,560	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	195,900	569.40	111,545,460	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,400	4,266.00	121,154,400	
三井住友フィナンシャルグループ	112,200	4,256.00	477,523,200	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	42,700	806.00	34,416,200	
群馬銀行	29,700	399.00	11,850,300	
武蔵野銀行	2,000	1,686.00	3,372,000	
千葉興業銀行	3,500	291.00	1,018,500	
筑波銀行	6,700	191.00	1,279,700	
七十七銀行	4,900	1,759.00	8,619,100	
秋田銀行	1,000	1,562.00	1,562,000	
山形銀行	1,700	1,021.00	1,735,700	
岩手銀行	1,100	1,793.00	1,972,300	
東邦銀行	12,100	202.00	2,444,200	
東北銀行	800	945.00	756,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,300	2,533.00	31,155,900	
スルガ銀行	13,600	387.00	5,263,200	
八十二銀行	31,400	469.00	14,726,600	
山梨中央銀行	1,600	1,001.00	1,601,600	
大垣共立銀行	2,900	1,721.00	4,990,900	
福井銀行	1,400	1,372.00	1,920,800	
清水銀行	600	1,406.00	843,600	
富山銀行	200	1,671.00	334,200	
滋賀銀行	2,600	2,444.00	6,354,400	
南都銀行	2,300	2,096.00	4,820,800	
百五銀行	14,500	325.00	4,712,500	
京都銀行	4,900	5,230.00	25,627,000	
紀陽銀行	5,500	1,408.00	7,744,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	870.00	8,439,000	
山陰合同銀行	9,600	693.00	6,652,800	
鳥取銀行	500	1,053.00	526,500	
百十四銀行	1,400	1,667.00	2,333,800	
四国銀行	2,500	850.00	2,125,000	
阿波銀行	2,300	1,840.00	4,232,000	

大分銀行	900	1,777.00	1,599,300
宮崎銀行	1,000	2,206.00	2,206,000
佐賀銀行	900	1,533.00	1,379,700
琉球銀行	3,500	768.00	2,688,000
セブン銀行	54,900	254.00	13,944,600
みずほフィナンシャルグループ	222,000	1,615.00	358,530,000
高知銀行	500	623.00	311,500
山口フィナンシャルグループ	16,900	777.00	13,131,300
長野銀行	500	1,156.00	578,000
名古屋銀行	1,000	3,060.00	3,060,000
北洋銀行	23,400	233.00	5,452,200
大光銀行	500	1,118.00	559,000
愛媛銀行	2,100	835.00	1,753,500
トマト銀行	500	964.00	482,000
京葉銀行	7,100	503.00	3,571,300
栃木銀行	7,000	297.00	2,079,000
北日本銀行	500	1,830.00	915,000
東和銀行	2,800	521.00	1,458,800
福島銀行	1,700	205.00	348,500
大東銀行	600	602.00	361,200
トモニホールディングス	12,400	319.00	3,955,600
フィデアホールディングス	1,600	1,287.00	2,059,200
池田泉州ホールディングス	19,600	213.00	4,174,800
F P G	6,200	1,066.00	6,609,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,244.00	1,617,200
マーキュリアホールディングス	1,000	601.00	601,000
S B Iホールディングス	22,200	2,679.00	59,473,800
ジャフコ グループ	5,100	2,248.00	11,464,800
大和証券グループ本社	109,700	582.00	63,845,400
野村ホールディングス	282,700	480.70	135,893,890
岡三証券グループ	13,600	355.00	4,828,000
丸三証券	5,200	404.00	2,100,800
東洋証券	5,100	236.00	1,203,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,800	343.00	5,762,400
光世証券	400	356.00	142,400
水戸証券	4,200	217.00	911,400
いちよし証券	2,900	595.00	1,725,500
松井証券	9,100	773.00	7,034,300
マネックスグループ	17,200	480.00	8,256,000
極東証券	1,900	610.00	1,159,000
岩井コスモホールディングス	1,800	1,238.00	2,228,400
アイザワ証券グループ	2,300	643.00	1,478,900

マナーパートナーズグループ	1,800	273.00	491,400
スパークス・グループ	1,700	1,578.00	2,682,600
かんぽ生命保険	18,600	2,139.00	39,785,400
S O M P Oホールディングス	26,300	6,235.00	163,980,500
アニコム ホールディングス	5,300	589.00	3,121,700
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,600	3,972.00	137,431,200
第一生命ホールディングス	78,200	2,331.00	182,284,200
東京海上ホールディングス	154,600	2,742.50	423,990,500
T & Dホールディングス	41,200	1,470.00	60,564,000
アドバンスクリエイト	900	995.00	895,500
全国保証	4,000	4,965.00	19,860,000
あんしん保証	700	253.00	177,100
ジェイリース	500	2,554.00	1,277,000
イントラスト	600	703.00	421,800
日本モーゲージサービス	800	823.00	658,400
C a s a	600	847.00	508,200
アルヒ	3,100	1,398.00	4,333,800
プレミアグループ	2,600	1,758.00	4,570,800
ネットプロテクションズホールディングス	5,100	425.00	2,167,500
クレディセゾン	9,700	1,565.00	15,180,500
芙蓉総合リース	1,400	8,190.00	11,466,000
みずほリース	2,300	3,245.00	7,463,500
東京センチュリー	2,900	4,950.00	14,355,000
日本証券金融	6,200	901.00	5,586,200
アイフル	25,300	400.00	10,120,000
リコーリース	1,500	3,580.00	5,370,000
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,432.00	12,601,600
アコム	27,300	321.00	8,763,300
ジャックス	1,600	3,655.00	5,848,000
オリエントコーポレーション	4,000	1,191.00	4,764,000
オリックス	102,700	2,163.00	222,140,100
三菱H C キャピタル	59,700	639.00	38,148,300
九州リースサービス	700	632.00	442,400
日本取引所グループ	43,100	1,916.50	82,601,150
イー・ギャランティ	2,500	2,382.00	5,955,000
アサックス	700	596.00	417,200
N E C キャピタルソリューション	800	2,067.00	1,653,600
大東建託	5,600	14,860.00	83,216,000
いちご	18,100	331.00	5,991,100
日本駐車場開発	18,800	258.00	4,850,400
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,391.00	1,112,800
S R E ホールディングス	800	4,275.00	3,420,000

A Dワークスグループ	4,600	162.00	745,200
ヒューリック	35,900	1,080.00	38,772,000
三栄建築設計	800	1,448.00	1,158,400
野村不動産ホールディングス	9,600	3,350.00	32,160,000
三重交通グループホールディングス	3,500	501.00	1,753,500
サムティ	2,500	2,333.00	5,832,500
ディア・ライフ	2,500	607.00	1,517,500
コーセーアールイー	700	665.00	465,500
地主	1,200	2,048.00	2,457,600
プレサンスコーポレーション	2,100	1,477.00	3,101,700
T H E グローバル社	1,400	259.00	362,600
ハウスコム	400	971.00	388,400
J P M C	900	1,008.00	907,200
サンセイランディック	600	840.00	504,000
エストラスト	400	550.00	220,000
フージャースホールディングス	2,500	758.00	1,895,000
オープンハウスグループ	5,600	5,360.00	30,016,000
東急不動産ホールディングス	46,200	735.00	33,957,000
飯田グループホールディングス	13,500	2,064.00	27,864,000
イーランド	300	1,551.00	465,300
ムゲンエステート	1,300	464.00	603,200
ビーロッド	1,300	557.00	724,100
ファーストブラザーズ	400	875.00	350,000
A n d D o ホールディングス	1,100	859.00	944,900
シーアールイー	800	1,420.00	1,136,000
プロパティエージェント	300	1,353.00	405,900
ケイアイスター不動産	800	4,440.00	3,552,000
アグレ都市デザイン	400	1,477.00	590,800
グッドコムアセット	1,600	682.00	1,091,200
ジェイ・エス・ビー	400	3,985.00	1,594,000
ロードスターキャピタル	700	1,571.00	1,099,700
テンポイノベーション	600	918.00	550,800
グローバル・リンク・マネジメント	400	1,042.00	416,800
フェイスネットワーク	300	1,301.00	390,300
パーク24	12,000	1,991.00	23,892,000
バラカ	600	1,893.00	1,135,800
三井不動産	66,700	2,795.00	186,426,500
三菱地所	97,400	1,850.00	180,190,000
平和不動産	2,500	3,860.00	9,650,000
東京建物	14,700	1,970.00	28,959,000
京阪神ビルディング	2,100	1,322.00	2,776,200
住友不動産	27,800	3,388.00	94,186,400

テーオーシー	3,000	743.00	2,229,000
東京楽天地	300	4,180.00	1,254,000
スターツコーポレーション	2,300	2,696.00	6,200,800
フジ住宅	2,300	621.00	1,428,300
空港施設	2,100	530.00	1,113,000
明和地所	1,000	608.00	608,000
ゴールドクレスト	1,500	1,702.00	2,553,000
エスリード	800	1,841.00	1,472,800
日神グループホールディングス	2,700	425.00	1,147,500
日本エスコン	3,600	803.00	2,890,800
MIRARTHホールディングス	8,000	383.00	3,064,000
AVANTIA	900	765.00	688,500
イオンモール	8,000	1,603.00	12,824,000
毎日コムネット	800	658.00	526,400
ファースト住建	700	1,003.00	702,100
カチタス	4,200	3,040.00	12,768,000
トーセイ	2,600	1,404.00	3,650,400
サンフロンティア不動産	2,700	1,142.00	3,083,400
FJネクストホールディングス	1,700	984.00	1,672,800
インテリックス	600	552.00	331,200
ランドビジネス	1,100	225.00	247,500
グランディハウス	1,500	548.00	822,000
日本空港ビルデング	5,400	6,190.00	33,426,000
明豊ファシリティワークス	800	699.00	559,200
日本工営	1,100	3,305.00	3,635,500
LIFULL	5,400	166.00	896,400
MIXI	3,600	2,387.00	8,593,200
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	2,504.00	3,505,600
日本M&Aセンターホールディングス	27,400	1,659.00	45,456,600
メンバーズ	500	2,114.00	1,057,000
中広	200	366.00	73,200
UTグループ	2,400	2,409.00	5,781,600
アイティメディア	600	1,670.00	1,002,000
E・Jホールディングス	1,000	1,280.00	1,280,000
夢真ビーネックスグループ	5,800	1,950.00	11,310,000
コシダカホールディングス	4,800	1,121.00	5,380,800
アルトナー	400	1,000.00	400,000
パソナグループ	1,900	1,941.00	3,687,900
CDS	400	1,810.00	724,000
リンクアンドモチベーション	4,600	882.00	4,057,200
エス・エム・エス	6,100	3,540.00	21,594,000
サニーサイドアップグループ	600	559.00	335,400

パーソルホールディングス	17,900	3,015.00	53,968,500
リニカル	900	738.00	664,200
クックパッド	4,300	201.00	864,300
エスクリ	700	363.00	254,100
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	623.00	498,400
学情	700	1,492.00	1,044,400
スタジオアリス	800	2,056.00	1,644,800
シミックホールディングス	900	1,717.00	1,545,300
エプロ	300	653.00	195,900
N J S	400	2,073.00	829,200
総合警備保障	5,900	3,625.00	21,387,500
カカクコム	12,000	2,335.00	28,020,000
アイロムグループ	600	2,338.00	1,402,800
セントケア・ホールディング	1,000	823.00	823,000
サイネックス	300	532.00	159,600
ルネサンス	1,100	933.00	1,026,300
ディップ	2,800	4,230.00	11,844,000
デジタルホールディングス	1,200	1,140.00	1,368,000
新日本科学	1,700	2,651.00	4,506,700
キャリアデザインセンター	300	1,465.00	439,500
ベネフィット・ワン	7,400	2,079.00	15,384,600
エムスリー	31,700	4,146.00	131,428,200
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	393.00	393,000
プラス	200	876.00	175,200
アウトソーシング	9,500	1,177.00	11,181,500
ウェルネット	1,400	604.00	845,600
ワールドホールディングス	700	2,611.00	1,827,700
ディー・エヌ・エー	6,800	1,922.00	13,069,600
博報堂D Yホールディングス	20,400	1,229.00	25,071,600
ぐるなび	2,900	409.00	1,186,100
タカミヤ	2,100	390.00	819,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	853.00	853,000
ファンコミュニケーションズ	3,100	435.00	1,348,500
ライク	600	2,021.00	1,212,600
ビジネス・ブレークスルー	600	396.00	237,600
エスプール	4,600	926.00	4,259,600
W D Bホールディングス	800	2,547.00	2,037,600
ティア	1,000	424.00	424,000
C D G	200	1,187.00	237,400
アドウェイズ	2,200	627.00	1,379,400
バリューコマース	1,200	2,068.00	2,481,600
インフォマート	16,600	429.00	7,121,400

J Pホールディングス	4,600	297.00	1,366,200
エコナックホールディングス	2,800	91.00	254,800
C Lホールディングス	400	841.00	336,400
プレステージ・インターナショナル	6,700	710.00	4,757,000
アミューズ	900	1,751.00	1,575,900
ドリームインキュベータ	500	2,334.00	1,167,000
クイック	1,200	2,071.00	2,485,200
T A C	800	207.00	165,600
電通グループ	16,800	4,490.00	75,432,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,536.00	768,000
ぴあ	500	3,365.00	1,682,500
イオンファンタジー	700	2,848.00	1,993,600
シーティーエス	1,800	818.00	1,472,400
ネクシィーズグループ	500	671.00	335,500
H . U . グループホールディングス	4,700	2,743.00	12,892,100
アルプス技研	1,400	1,968.00	2,755,200
ダイオーズ	300	1,498.00	449,400
日本空調サービス	1,700	702.00	1,193,400
オリエンタルランド	17,000	19,775.00	336,175,000
ダスキン	3,600	2,831.00	10,191,600
明光ネットワークジャパン	2,100	607.00	1,274,700
ファルコホールディングス	700	1,729.00	1,210,300
秀英予備校	400	433.00	173,200
ラウンドワン	13,400	629.00	8,428,600
リゾートトラスト	6,300	2,344.00	14,767,200
ビー・エム・エル	2,000	3,345.00	6,690,000
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,026.00	2,667,600
リソー教育	7,400	315.00	2,331,000
早稲田アカデミー	900	1,108.00	997,200
ユー・エス・エス	16,500	2,190.00	36,135,000
東京個別指導学院	1,900	518.00	984,200
サイバーエージェント	38,300	1,120.00	42,896,000
楽天グループ	74,000	660.00	48,840,000
クリーク・アンド・リバー社	900	2,039.00	1,835,100
モーニングスター	2,600	450.00	1,170,000
テー・オー・ダブリュ	3,400	305.00	1,037,000
山田コンサルティンググループ	800	1,139.00	911,200
セントラルスポーツ	600	2,322.00	1,393,200
フルキャストホールディングス	1,500	2,888.00	4,332,000
エン・ジャパン	2,900	2,546.00	7,383,400
リソルホールディングス	100	4,485.00	448,500
テクノプロ・ホールディングス	10,700	3,815.00	40,820,500

アトラグループ	400	188.00	75,200
インターワークス	400	372.00	148,800
アイ・アールジャパンホールディングス	800	2,164.00	1,731,200
K e e P e r 技研	1,200	3,770.00	4,524,000
ファーストロジック	300	784.00	235,200
三機サービス	300	888.00	266,400
G u n o s y	1,000	654.00	654,000
デザインワン・ジャパン	500	209.00	104,500
イー・ガーディアン	600	2,975.00	1,785,000
リブセンス	800	278.00	222,400
ジャパンマテリアル	4,900	1,983.00	9,716,700
ベクトル	2,500	1,047.00	2,617,500
ウチヤマホールディングス	700	291.00	203,700
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,039.00	1,350,700
キャリアリンク	600	2,373.00	1,423,800
I B J	1,000	958.00	958,000
アサンテ	800	1,594.00	1,275,200
バリューHR	1,400	1,488.00	2,083,200
M & A キャピタルパートナーズ	1,500	4,200.00	6,300,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,015.00	609,000
E R I ホールディングス	500	1,037.00	518,500
アビスト	300	2,890.00	867,000
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,245.00	2,988,000
ウィルグループ	1,300	1,446.00	1,879,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,700	147.00	249,900
メドピア	1,300	1,412.00	1,835,600
レアジョブ	300	1,031.00	309,300
リクルートホールディングス	118,600	4,550.00	539,630,000
エラン	2,100	1,088.00	2,284,800
土木管理総合試験所	700	304.00	212,800
ネットマーケティング	200	896.00	179,200
日本郵政	210,000	990.80	208,068,000
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,307.00	2,744,700
鎌倉新書	1,800	751.00	1,351,800
S M N	400	462.00	184,800
一蔵	200	482.00	96,400
グローバルキッズCOMPANY	300	573.00	171,900
エアトリ	1,000	2,494.00	2,494,000
アトラエ	1,300	1,487.00	1,933,100
ストライク	800	4,250.00	3,400,000
ソラスト	4,400	849.00	3,735,600
セラク	600	1,136.00	681,600

インソース	2,000	3,430.00	6,860,000
ペイカレント・コンサルティング	13,000	3,970.00	51,610,000
Orchestra Holdings	300	2,490.00	747,000
アイモバイル	800	1,192.00	953,600
キャリアインデックス	600	394.00	236,400
MS - Japan	500	827.00	413,500
船場	300	768.00	230,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,700	1,680.00	9,576,000
フルテック	200	1,058.00	211,600
グリーンズ	600	1,001.00	600,600
ツナググループ・ホールディングス	500	471.00	235,500
GameWith	500	364.00	182,000
MS&Consulting	200	602.00	120,400
ウェルビー	1,200	841.00	1,009,200
エル・ティー・エス	200	3,000.00	600,000
ミダックホールディングス	1,000	3,610.00	3,610,000
日総工産	1,200	562.00	674,400
キュービーネットホールディングス	800	1,322.00	1,057,600
RPAホールディングス	2,200	278.00	611,600
スプリックス	600	976.00	585,600
マネジメントソリューションズ	900	3,065.00	2,758,500
プロレド・パートナーズ	400	510.00	204,000
and factory	500	384.00	192,000
テノ・ホールディングス	200	528.00	105,600
フロンティア・マネジメント	500	1,240.00	620,000
ピアラ	300	688.00	206,400
コプロ・ホールディングス	300	912.00	273,600
ギークス	200	751.00	150,200
カーブスホールディングス	4,900	880.00	4,312,000
フォーラムエンジニアリング	900	840.00	756,000
Fast Fitness Japan	500	1,415.00	707,500
ダイレクトマーケティングミックス	1,800	1,629.00	2,932,200
ポピンズ	200	1,508.00	301,600
LITALICO	1,200	2,424.00	2,908,800
アドバンテッジリスクマネジメント	700	414.00	289,800
リログループ	8,900	2,060.00	18,334,000
東祥	1,100	1,251.00	1,376,100
ビーウィズ	500	1,210.00	605,000
TREホールディングス	3,400	1,560.00	5,304,000
人・夢・技術グループ	700	2,670.00	1,869,000
エイチ・アイ・エス	4,200	2,044.00	8,584,800
ラックランド	500	2,830.00	1,415,000

共立メンテナンス	2,700	6,260.00	16,902,000	
イチネンホールディングス	1,700	1,232.00	2,094,400	
建設技術研究所	800	2,838.00	2,270,400	
スペース	1,100	862.00	948,200	
燦ホールディングス	700	1,703.00	1,192,100	
スバル興業	100	8,680.00	868,000	
東京テアトル	600	1,100.00	660,000	
タナベコンサルティンググループ	600	619.00	371,400	
ナガワ	400	6,990.00	2,796,000	
東京都競馬	1,300	4,040.00	5,252,000	
常盤興産	600	1,156.00	693,600	
カナモト	2,900	2,235.00	6,481,500	
西尾レントオール	1,500	2,962.00	4,443,000	
トランス・コスモス	2,000	3,125.00	6,250,000	
乃村工藝社	7,000	1,059.00	7,413,000	
藤田観光	700	3,090.00	2,163,000	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,649.00	1,649,000	
日本管財	1,700	2,510.00	4,267,000	
トーカイ	1,400	1,869.00	2,616,600	
白洋舎	200	1,586.00	317,200	
セコム	16,300	8,270.00	134,801,000	
セントラル警備保障	900	2,504.00	2,253,600	
丹青社	3,100	802.00	2,486,200	
メイテック	6,400	2,538.00	16,243,200	
応用地質	1,600	2,323.00	3,716,800	
船井総研ホールディングス	3,400	2,551.00	8,673,400	
進学会ホールディングス	500	302.00	151,000	
オオバ	1,000	673.00	673,000	
いであ	400	1,536.00	614,400	
学究社	600	1,675.00	1,005,000	
ベネッセホールディングス	6,000	2,165.00	12,990,000	
イオンディライト	1,800	2,947.00	5,304,600	
ナック	700	926.00	648,200	
ダイセキ	3,300	4,615.00	15,229,500	
ステップ	600	1,853.00	1,111,800	
合 計	18,153,200		43,556,733,190	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

	（単位：円）	
	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,197,954,079	523,877,387
コール・ローン	2,888,755,206	1,223,548,757
株式	250,167,589,782	245,823,775,339
投資証券	5,798,044,857	5,778,898,058
派生商品評価勘定	241,792,102	69,749,980
未収入金	68,197	63,736,671
未収配当金	151,944,458	173,219,298
差入委託証拠金	618,174,626	2,851,468,691
流動資産合計	261,064,323,307	256,508,274,181
資産合計	261,064,323,307	256,508,274,181
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,737,315	43,385,741
未払金	-	12,815,074
未払解約金	172,290,676	127,255,249
未払利息	1,551	1,829
流動負債合計	179,029,542	183,457,893
負債合計	179,029,542	183,457,893
純資産の部		
元本等		
元本	62,029,182,999	59,202,311,151
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	198,856,110,766	197,122,505,137
元本等合計	260,885,293,765	256,324,816,288
純資産合計	260,885,293,765	256,324,816,288
負債純資産合計	261,064,323,307	256,508,274,181

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
1.	期首	2020年11月 7日	2021年11月 9日
	期首元本額	80,972,691,731円	62,029,182,999円
	期首からの追加設定元本額	5,505,535,862円	11,184,661,253円
	期首からの一部解約元本額	24,449,044,594円	14,011,533,101円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	25,465,344,132円	29,833,098,571円
	DCインデックスバランス(株式20)	110,868,769円	118,853,718円
	DCインデックスバランス(株式40)	304,596,290円	324,006,756円
	DCインデックスバランス(株式60)	601,540,552円	642,259,230円
	DCインデックスバランス(株式80)	649,449,696円	698,807,858円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	1,498,519,588円	1,448,605,235円
	日興五大陸株式ファンド	3,935,036,100円	3,615,709,890円
	インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	19,546,879円	13,870,404円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	104,560,092円	90,192,400円
	インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	6,102,747,886円	5,909,335,825円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	16,508,539,257円	10,381,598,812円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,665,248円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,082,472円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	4,003,307円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	3,238,663円	-円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,365,631,865円	1,802,386,658円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	19,506,309円	17,776,357円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	55,348,650円	50,998,904円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	86,526,309円	77,934,113円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	81,118,655円	76,151,427円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,106,312,280円	4,100,724,993円
計	62,029,182,999円	59,202,311,151円
2. 受益権の総数	62,029,182,999口	59,202,311,151口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,029,505,280
投資証券	41,267,470
合計	6,070,772,750

（2022年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,198,873,514
投資証券	42,740,395
合計	3,156,133,119

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2021年11月 8日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,676,631,591	-	4,893,378,713	216,747,122
合計		4,676,631,591	-	4,893,378,713	216,747,122

（2022年11月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,763,988,331	-	4,790,843,862	26,855,531
合計		4,763,988,331	-	4,790,843,862	26,855,531

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（2021年11月 8日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,870,905,510	-	2,889,217,850	18,312,340

	米ドル	2,252,531,540	-	2,271,719,730	19,188,190
	ユーロ	618,373,970	-	617,498,120	875,850
	売建	7,282,825	-	7,287,500	4,675
	スウェーデンク ローナ	7,282,825	-	7,287,500	4,675
	合計	2,878,188,335	-	2,896,505,350	18,307,665

(2022年11月 7日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	1,352,029,765	-	1,351,630,730	399,035	
	米ドル	735,301,500	-	732,400,480	2,901,020	
	ユーロ	616,728,265	-	619,230,250	2,501,985	
	売建	11,866,800	-	11,959,057	92,257	
	加ドル	11,866,800	-	11,959,057	92,257	
	合計	1,363,896,565	-	1,363,589,787	491,292	

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年11月 8日現在		2022年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	4.2058円	1口当たり純資産額	4.3296円
(1万口当たり純資産額)	(42,058円)	(1万口当たり純資産額)	(43,296円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	12,750	48.99	624,622.50	
	BAKER HUGHES CO	37,155	29.11	1,081,582.05	
	CHENIERE ENERGY INC	8,600	171.78	1,477,308.00	
	CHEVRON CORP	70,591	183.42	12,947,801.22	
	CONOCOPHILLIPS	48,956	132.32	6,477,857.92	
	COTERRA ENERGY INC	30,170	28.93	872,818.10	
	DEVON ENERGY CORPORATION	23,510	71.48	1,680,494.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,310	161.37	1,018,244.70	
	EOG RESOURCES INC	22,232	142.23	3,162,057.36	
	EQT CORP	12,660	41.08	520,072.80	
	EXXON MOBIL CORP	159,151	112.31	17,874,248.81	
	HALLIBURTON CO	33,827	38.48	1,301,662.96	
	HESS CORP	10,520	146.53	1,541,495.60	
	KINDER MORGAN INC	75,410	18.17	1,370,199.70	
	MARATHON OIL CORP	26,600	32.03	851,998.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	20,282	117.65	2,386,177.30	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,591	73.27	2,607,752.57	
	ONEOK INC	16,840	60.74	1,022,861.60	
	PHILLIPS 66	18,125	103.48	1,875,575.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,740	255.06	2,229,224.40	
SCHLUMBERGER LTD	53,121	53.10	2,820,725.10		

TARGA RESOURCES CORP	8,180	70.37	575,626.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	230	2,566.00	590,180.00
VALERO ENERGY CORP	15,292	128.72	1,968,386.24
WILLIAMS COS INC	45,994	33.54	1,542,638.76
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,365	276.06	2,309,241.90
ALBEMARLE CORP	4,365	284.99	1,243,981.35
ALCOA CORP	6,700	42.40	284,080.00
AMCOR PLC	54,600	11.16	609,336.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	174.56	530,662.40
BALL CORP	12,500	50.85	635,625.00
CELANESE CORP	4,090	91.94	376,034.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	105.38	824,071.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	19,100	13.02	248,682.00
CORTEVA INC	27,272	65.37	1,782,770.64
CROWN HOLDINGS INC	4,565	75.07	342,694.55
DOW INC	27,325	49.03	1,339,744.75
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	61.93	1,186,702.66
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	80.25	386,403.75
ECOLAB INC	9,560	134.75	1,288,210.00
FMC CORP	4,840	124.50	602,580.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	56,338	35.19	1,982,534.22
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	33.67	460,268.90
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	94.83	914,635.35
LINDE PLC	19,045	308.93	5,883,571.85
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	83.66	884,286.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	337.16	795,697.60
MOSAIC CO/THE	13,580	49.29	669,358.20
NEWMONT CORP	30,452	40.99	1,248,227.48
NUCOR CORP	9,989	133.56	1,334,130.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	124.50	445,710.00
PPG INDUSTRIES INC	8,774	115.46	1,013,046.04
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	92.83	460,436.80
SEALED AIR CORP	5,746	43.46	249,721.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,311	216.23	2,013,317.53
STEEL DYNAMICS INC	7,140	95.40	681,156.00

VULCAN MATERIALS CO	5,563	170.15	946,544.45
WESTLAKE CORP	1,360	100.01	136,013.60
WESTROCK CO	9,989	34.62	345,819.18
3M CO	21,016	124.84	2,623,637.44
AERCAP HOLDINGS NV	4,850	55.66	269,951.00
ALLEGION PLC	3,340	103.12	344,420.80
AMETEK INC	8,533	135.25	1,154,088.25
BOEING CO/THE	21,152	160.01	3,384,531.52
CARLISLE COS INC	2,250	225.57	507,532.50
CARRIER GLOBAL CORP	31,608	40.28	1,273,170.24
CATERPILLAR INC	20,056	227.85	4,569,759.60
CUMMINS INC	5,195	238.37	1,238,332.15
DEERE & CO	11,000	395.09	4,345,990.00
DOVER CORP	5,350	133.06	711,871.00
EATON CORP PLC	15,116	158.69	2,398,758.04
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	89.09	2,003,634.10
FASTENAL CO	21,616	49.49	1,069,775.84
FORTIVE CORP	12,674	64.59	818,613.66
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,050	57.46	290,173.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	101.25	247,050.00
GENERAL DYNAMICS CORP	8,937	249.36	2,228,530.32
GENERAL ELECTRIC CO	41,417	81.07	3,357,676.19
HEICO CORP	1,800	156.19	281,142.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	122.35	303,428.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,786	207.85	5,359,620.10
HOWMET AEROSPACE INC	13,763	36.04	496,018.52
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	243.95	373,243.50
IDEX CORP	2,880	222.59	641,059.20
ILLINOIS TOOL WORKS	11,775	215.15	2,533,391.25
INGERSOLL-RAND INC	15,158	52.92	802,161.36
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,770	48.27	278,517.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25,894	63.81	1,652,296.14
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,220	229.33	1,655,762.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	234.38	324,616.30
LOCKHEED MARTIN CORP	9,076	481.67	4,371,636.92

MASCO CORP	9,849	43.55	428,923.95
NORDSON CORP	2,345	220.05	516,017.25
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,604	522.77	2,929,603.08
OTIS WORLDWIDE CORP	15,644	73.22	1,145,453.68
OWENS CORNING	3,550	83.92	297,916.00
PACCAR INC	12,924	99.12	1,281,026.88
PARKER HANNIFIN CORP	4,775	298.88	1,427,152.00
PENTAIR PLC	5,998	41.06	246,277.88
PLUG POWER INC	19,280	14.79	285,151.20
QUANTA SERVICES INC	5,710	146.77	838,056.70
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	56,016	95.22	5,333,843.52
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	247.43	1,064,691.29
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,670	40.71	230,825.70
SMITH (A.O.) CORP	5,020	55.98	281,019.60
SNAP-ON INC	1,975	229.14	452,551.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	74.64	433,359.84
TEXTRON INC	7,956	68.52	545,145.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,696	166.74	1,449,971.04
TRANSDIGM GROUP INC	1,940	579.61	1,124,443.40
UNITED RENTALS INC	2,665	323.87	863,113.55
WABTEC CORP	6,470	95.45	617,561.50
WW GRAINGER INC	1,667	593.64	989,597.88
XYLEM INC	6,678	107.21	715,948.38
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	106.83	541,628.10
CINTAS CORP	3,457	410.64	1,419,582.48
CLARIVATE PLC	10,850	10.09	109,476.50
COPART INC	7,850	57.38	450,433.00
COPART INC(N)	7,850	57.38	450,433.00
COSTAR GROUP INC	14,910	79.97	1,192,352.70
EQUIFAX INC	4,574	163.09	745,973.66
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	118.02	575,937.60
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	105.76	524,569.60
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	129.91	1,056,168.30
ROBERT HALF INTL INC	3,975	74.63	296,654.25
ROLLINS INC	8,265	41.91	346,386.15

TRANSUNION	7,270	52.24	379,784.80
VERISK ANALYTICS INC	5,800	166.52	965,816.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,566	136.45	1,305,280.70
WASTE MANAGEMENT INC	15,584	155.77	2,427,519.68
AMERCO	375	540.12	202,545.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	89.97	443,552.10
CSX CORP	82,069	29.63	2,431,704.47
DELTA AIR LINES INC	5,515	32.76	180,671.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,147	94.86	583,104.42
FEDEX CORP	9,448	156.66	1,480,123.68
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	51,400	2.83	145,462.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	173.25	544,005.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,630	48.26	271,703.80
LYFT INC-A	10,570	13.74	145,231.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,995	233.80	2,103,031.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	271.91	993,831.05
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	37.08	202,827.60
UBER TECHNOLOGIES INC	55,860	28.39	1,585,865.40
UNION PACIFIC CORP	23,801	196.70	4,681,656.70
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,827	165.69	4,610,655.63
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,920	23.17	67,656.40
APTIV PLC	10,100	97.63	986,063.00
BORGWARNER INC	9,120	37.94	346,012.80
FORD MOTOR COMPANY	147,945	13.51	1,998,736.95
GENERAL MOTORS CORP	52,975	39.00	2,066,025.00
LEAR CORP	2,290	136.52	312,630.80
LUCID GROUP INC	16,510	13.89	229,323.90
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	11,810	31.99	377,801.90
TESLA INC	99,765	207.47	20,698,244.55
DR HORTON INC	12,496	75.18	939,449.28
GARMIN LTD	5,865	86.53	507,498.45
HASBRO INC	5,188	62.19	322,641.72
LENNAR CORP-CL A	10,040	79.61	799,284.40
LULULEMON ATHLETICA INC	4,380	325.57	1,425,996.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	90.00	169,020.00

NEWELL BRANDS INC	14,666	13.11	192,271.26
NIKE INC -CL B	48,078	95.79	4,605,391.62
NVR INC	118	4,161.90	491,104.20
PULTE GROUP INC	8,850	38.26	338,601.00
VF CORP	12,170	28.25	343,802.50
WHIRLPOOL CORP	2,079	133.33	277,193.07
AIRBNB INC-CLASS A	14,000	96.09	1,345,260.00
ARAMARK	8,880	34.85	309,468.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,533	1,874.40	2,873,455.20
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	42.64	339,840.80
CARNIVAL CORP	35,077	9.00	315,693.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,035	1,397.57	1,446,484.95
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	141.34	685,923.02
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	359.65	494,518.75
EXPEDIA GROUP INC	5,662	92.63	524,471.06
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	130.01	1,384,606.50
LAS VEGAS SANDS CORP	12,900	40.24	519,096.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	148.96	1,589,850.08
MCDONALD'S CORP	28,011	274.62	7,692,380.82
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	33.84	436,536.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	54.70	478,515.60
STARBUCKS CORP	43,494	91.86	3,995,358.84
VAIL RESORTS INC	1,520	215.55	327,636.00
WYNN RESORTS LTD	4,180	70.81	295,985.80
YUM! BRANDS INC	10,554	121.78	1,285,266.12
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,400	71.96	2,115,624.00
ALPHABET INC-CL A	226,940	86.58	19,648,465.20
ALPHABET INC-CL C	212,810	86.70	18,450,627.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	19,410	5.65	109,666.50
CABLE ONE INC	210	683.28	143,488.80
CHARTER COMMUNICATION-A	4,476	348.82	1,561,318.32
COMCAST CORP-CLASS A	169,414	31.00	5,251,834.00
DISH NETWORK CORP-A	9,279	13.35	123,874.65
ELECTRONIC ARTS INC	10,494	129.76	1,361,701.44
FOX CORP - CLASS A	13,084	29.84	390,426.56

FOX CORP- CLASS B	5,466	27.83	152,118.78
IAC INC	3,090	45.26	139,853.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.50	445,332.00
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	80.64	391,104.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	41.79	138,951.75
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,726	41.65	238,487.90
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,130	53.79	383,522.70
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	70.72	454,022.40
MATCH GROUP INC	10,912	43.02	469,434.24
META PLATFORMS INC-CLASS A	86,740	90.79	7,875,124.60
NETFLIX INC	16,695	260.79	4,353,889.05
NEWS CORP - CLASS A	14,750	16.68	246,030.00
OMNICOM GROUP	7,807	72.22	563,821.54
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	15.57	355,354.11
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	22.39	469,070.50
ROBLOX CORP -CLASS A	13,390	40.58	543,366.20
ROKU INC	4,700	49.59	233,073.00
SEA LTD-ADR	13,370	44.01	588,413.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	6.16	186,524.80
SNAP INC - A	40,460	9.14	369,804.40
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,370	108.53	691,336.10
THE WALT DISNEY CO.	68,942	99.58	6,865,244.36
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	16,510	46.25	763,587.50
WARNER BROS DISCOVERY INC	86,760	10.43	904,906.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	29.28	288,115.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,328	181.07	421,530.96
AMAZON.COM INC	345,470	90.98	31,430,860.60
AUTOZONE INC	732	2,465.10	1,804,453.20
BATH & BODY WORKS INC	9,270	31.97	296,361.90
BEST BUY CO INC	7,394	68.20	504,270.80
BURLINGTON STORES INC	2,585	138.90	359,056.50
CARMAX INC	5,949	62.79	373,537.71
CHEWY INC - CLASS A	3,410	33.87	115,496.70
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,545	248.10	2,120,014.50
DOLLAR TREE INC	8,466	156.40	1,324,082.40

DOORDASH INC - A	6,960	51.57	358,927.20
EBAY INC	21,897	40.07	877,412.79
ETSY INC	4,800	98.35	472,080.00
GENUINE PARTS CO	5,321	178.20	948,202.20
HOME DEPOT INC	38,875	284.03	11,041,666.25
LKQ CORP	10,260	51.72	530,647.20
LOWE'S COS INC	24,212	182.15	4,410,215.80
MERCADOLIBRE INC	1,695	938.57	1,590,876.15
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,450	815.74	1,998,563.00
POOL CORP	1,540	292.62	450,634.80
ROSS STORES INC	13,162	93.88	1,235,648.56
TARGET CORP	17,610	159.63	2,811,084.30
TJX COMPANIES INC	44,466	71.19	3,165,534.54
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,230	206.56	873,748.80
ULTA BEAUTY INC	1,970	418.32	824,090.40
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	32.74	92,981.60
COSTCO WHOLESALE CORP	16,754	486.41	8,149,313.14
KROGER CO	25,910	46.40	1,202,224.00
SYSCO CORP	19,236	82.25	1,582,161.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,082	37.07	1,003,929.74
WALMART INC	57,262	140.97	8,072,224.14
ALTRIA GROUP INC	68,708	45.50	3,126,214.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,073	95.19	2,005,938.87
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	67.15	784,312.00
BUNGE LTD	5,577	99.53	555,078.81
CAMPBELL SOUP CO	7,885	50.83	400,794.55
COCA-COLA CO/THE	156,032	59.26	9,246,456.32
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	48.20	371,622.00
CONAGRA BRANDS INC	18,040	35.98	649,079.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,115	244.83	1,497,135.45
GENERAL MILLS INC	22,579	79.06	1,785,095.74
HERSHEY CO/THE	5,395	229.03	1,235,616.85
HORMEL FOODS CORP	11,500	46.06	529,690.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	149.38	612,458.00
KELLOGG CO	9,358	69.86	653,749.88

KEURIG DR PEPPER INC	29,120	36.98	1,076,857.60
KRAFT HEINZ CO/THE	27,151	38.02	1,032,281.02
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,250	79.02	730,935.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,610	51.20	338,432.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	52,525	63.22	3,320,630.50
MONSTER BEVERAGE CORP	14,810	97.94	1,450,491.40
PEPSICO INC	52,401	178.78	9,368,250.78
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	58,728	89.98	5,284,345.44
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	67.30	733,973.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,090	71.40	649,026.00
CLOROX COMPANY	4,646	140.69	653,645.74
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,980	73.19	2,194,236.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,580	210.53	1,806,347.40
KIMBERLY-CLARK CORP	12,523	122.52	1,534,317.96
PROCTER & GAMBLE CO	90,719	134.44	12,196,262.36
ABBOTT LABORATORIES	66,266	98.07	6,498,706.62
ABIOMED INC	1,870	373.99	699,361.30
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	180.93	513,841.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	161.64	933,309.36
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,739	50.58	947,818.62
BECTON DICKINSON AND CO	10,832	220.84	2,392,138.88
BOSTON SCIENTIFIC CORP	54,038	41.59	2,247,440.42
CARDINAL HEALTH INC	10,305	79.52	819,453.60
CENTENE CORP	21,847	81.73	1,785,555.31
CIGNA CORP	11,945	322.13	3,847,842.85
COOPER COS INC/THE	1,715	270.62	464,113.30
CVS HEALTH CORP	49,678	99.56	4,945,941.68
DAVITA INC	2,108	70.38	148,361.04
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	27.15	223,227.30
DEXCOM INC	15,030	114.88	1,726,646.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23,190	68.54	1,589,442.60
ELEVANCE HEALTH INC	9,131	526.66	4,808,932.46
HCA HEALTHCARE INC	8,830	211.91	1,871,165.30
HENRY SCHEIN INC	5,280	72.69	383,803.20
HOLOGIC INC	9,208	75.23	692,717.84

HUMANA INC	4,805	552.05	2,652,600.25
IDEXX LABORATORIES INC	3,150	371.79	1,171,138.50
INSULET CORP	2,600	313.00	813,800.00
INTUITIVE SURGICAL INC	13,625	239.53	3,263,596.25
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	227.99	778,585.85
MASIMO CORP	2,020	125.09	252,681.80
MCKESSON CORP	5,449	396.65	2,161,345.85
MEDTRONIC PLC	50,428	84.65	4,268,730.20
MOLINA HEALTHCARE INC	2,145	330.55	709,029.75
NOVOCURE LTD	3,430	70.57	242,055.10
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	143.62	629,917.32
RESMED INC	5,380	210.89	1,134,588.20
STERIS PLC	3,710	162.94	604,507.40
STRYKER CORP	12,923	210.98	2,726,494.54
TELADOC HEALTH INC	6,610	27.28	180,320.80
TELEFLEX INC	1,760	202.39	356,206.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,440	538.17	19,072,744.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,460	112.07	275,692.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,240	166.81	874,084.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,642	104.85	801,263.70
ABBVIE INC	66,816	145.28	9,707,028.48
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,240	136.08	1,529,539.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,520	208.34	941,696.80
AMGEN INC	20,226	269.04	5,441,603.04
AVANTOR INC	22,710	20.06	455,562.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	378.20	325,252.00
BIO-TECHNE CORP	1,480	303.57	449,283.60
BIOGEN INC	5,543	281.82	1,562,128.26
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	82.49	588,978.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	80,595	78.78	6,349,274.10
CATALENT INC	6,520	42.45	276,774.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	220.34	420,849.40
DANAHER CORP	26,139	246.97	6,455,548.83
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	13.03	215,333.78
ELI LILLY & CO	30,539	357.41	10,914,943.99

EXACT SCIENCES CORP	6,510	37.57	244,580.70
GILEAD SCIENCES INC	47,594	80.34	3,823,701.96
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,990	77.14	616,348.60
ILLUMINA INC	5,915	224.36	1,327,089.40
INCYTE CORP	7,110	77.30	549,603.00
IQVIA HOLDINGS INC	7,008	204.10	1,430,332.80
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	146.43	358,753.50
JOHNSON & JOHNSON	99,421	171.48	17,048,713.08
MERCK & CO. INC.	95,633	99.20	9,486,793.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	835	1,284.51	1,072,565.85
MODERNA INC	12,545	158.41	1,987,253.45
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	121.82	442,206.60
PERKINELMER INC	4,700	130.49	613,303.00
PFIZER INC	212,220	47.22	10,021,028.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,100	740.21	3,034,861.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,010	41.94	545,639.40
SEAGEN INC	5,320	127.22	676,810.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.47	369,207.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,809	495.55	7,338,599.95
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,710	308.82	2,998,642.20
VIATRIS INC	45,819	9.70	444,444.30
WATERS CORP	2,246	305.07	685,187.22
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,780	215.59	599,340.20
ZOETIS INC	17,875	133.67	2,389,351.25
BANK OF AMERICA CORP	274,539	36.79	10,100,289.81
CITIGROUP INC	73,177	45.13	3,302,478.01
CITIZENS FINANCIAL GROUP	17,690	40.12	709,722.80
FIFTH THIRD BANCORP	25,549	35.13	897,536.37
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	820.23	369,103.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	114.60	773,550.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	15.38	826,213.60
JPMORGAN CHASE & CO	110,990	130.68	14,504,173.20
KEYCORP	34,648	18.23	631,633.04
M & T BANK CORP	6,733	167.02	1,124,545.66
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,720	156.50	2,460,180.00

REGIONS FINANCIAL CORP	35,164	22.46	789,783.44	
SIGNATURE BANK	2,390	148.53	354,986.70	
SVB FINANCIAL GROUP	2,375	213.20	506,350.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	50,640	43.66	2,210,942.40	
US BANCORP	52,651	42.83	2,255,042.33	
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	54.12	344,744.40	
WELLS FARGO & CO	143,550	46.74	6,709,527.00	
ALLY FINANCIAL INC	12,240	25.68	314,323.20	
AMERICAN EXPRESS CO	24,284	144.72	3,514,380.48	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,135	313.87	1,297,852.45	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,090	62.58	944,332.20	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	28,632	42.49	1,216,573.68	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,585	287.47	13,966,729.95	
BLACKROCK INC	5,715	656.15	3,749,897.25	
BLACKSTONE INC	26,850	90.04	2,417,574.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	102.53	1,582,550.55	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	27.94	213,741.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	128.30	505,502.00	
CME GROUP INC	13,670	170.67	2,333,058.90	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,270	58.82	251,161.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	99.85	1,073,387.50	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	29.87	430,725.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	408.45	571,830.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	10,315	23.33	240,648.95	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	38.91	97,275.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,943	357.91	4,632,429.13	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,070	96.62	2,035,783.40	
INVESCO LTD	13,527	15.73	212,779.71	
KKR & CO INC -A	21,010	51.33	1,078,443.30	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,005	266.93	802,124.65	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	233.99	332,265.80	
MOODY'S CORP	6,142	258.96	1,590,532.32	
MORGAN STANLEY	49,733	84.85	4,219,845.05	
MSCI INC	3,035	460.91	1,398,861.85	
NASDAQ INC	12,955	61.90	801,914.50	

NORTHERN TRUST CORP	7,340	84.47	620,009.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,010	120.44	844,284.40
S&P GLOBAL INC	13,155	316.40	4,162,242.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	54,663	79.05	4,321,110.15
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,175	54.52	227,621.00
STATE STREET CORP	13,717	75.45	1,034,947.65
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	35.02	665,730.20
T ROWE PRICE GROUP INC	8,125	102.83	835,493.75
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	55.87	234,654.00
AFLAC INC	22,934	67.18	1,540,706.12
ALLSTATE CORP	10,243	129.12	1,322,576.16
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	145.99	388,333.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,525	57.92	1,710,088.00
AON PLC	7,922	279.71	2,215,862.62
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,055	56.86	799,167.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,940	188.39	1,495,816.60
ASSURANT INC	1,960	121.22	237,591.20
BROWN & BROWN INC	9,090	55.77	506,949.30
CHUBB LTD	16,065	209.16	3,360,155.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,610	99.79	559,821.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	264.33	248,470.20
EVEREST RE GROUP LTD	1,469	333.16	489,412.04
FNF GROUP	9,591	39.50	378,844.50
GLOBE LIFE INC	3,586	113.99	408,768.14
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	73.79	913,667.78
LINCOLN NATIONAL CORP	6,453	34.42	222,112.26
LOEWS CORP	7,105	55.47	394,114.35
MARKEL CORP	500	1,211.01	605,505.00
MARSH & MCLENNAN COS	18,933	160.37	3,036,285.21
METLIFE INC	26,335	74.11	1,951,686.85
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	89.88	855,657.60
PROGRESSIVE CORP	22,210	126.62	2,812,230.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,972	105.06	1,467,898.32
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	183.06	1,627,220.34
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	221.21	928,639.58

WR BERKLEY CORP	8,091	74.88	605,854.08
CBRE GROUP INC - A	12,090	70.76	855,488.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	4.17	168,885.00
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	32.52	207,152.40
ACCENTURE PLC-CL A	23,998	261.16	6,267,317.68
ADOBE INC	17,889	285.75	5,111,781.75
AFFIRM HOLDINGS INC	6,670	16.12	107,520.40
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	84.10	507,123.00
ANSYS INC	3,295	213.91	704,833.45
APPLOVIN CORP-CLASS A	3,960	14.84	58,766.40
AUTODESK INC	8,380	193.69	1,623,122.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,926	236.86	3,772,232.36
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	33.05	248,866.50
BILL.COM HOLDINGS INC	3,630	106.33	385,977.90
BLACK KNIGHT INC	5,860	55.05	322,593.00
BLOCK INC	19,400	60.11	1,166,134.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	133.44	587,136.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,230	142.41	1,456,854.30
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	60.56	319,756.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	125.60	482,304.00
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	41.09	400,627.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,278	52.63	1,014,601.14
COUPA SOFTWARE INC	2,800	42.39	118,692.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,760	127.56	989,865.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	143.55	236,857.50
DATADOG INC-CLASS A	9,100	70.38	640,458.00
DOCUSIGN INC	7,480	40.86	305,632.80
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	21.40	249,524.00
DYNATRACE INC	7,560	32.49	245,624.40
EPAM SYSTEMS INC	2,145	312.52	670,355.40
FAIR ISAAC CORP	970	435.35	422,289.50
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	22,978	60.17	1,382,586.26
FISERV INC	22,934	94.32	2,163,134.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,690	177.17	476,587.30
FORTINET INC	25,525	47.10	1,202,227.50

GARTNER INC	3,050	319.50	974,475.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,589	97.45	1,031,898.05
GODADDY INC-CLASS A	6,020	67.53	406,530.60
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	53.32	153,028.40
HUBSPOT INC	1,725	265.69	458,315.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,072	136.96	4,666,501.12
INTUIT INC	10,081	361.19	3,641,156.39
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	180.46	577,472.00
MASTERCARD INC	32,855	318.37	10,460,046.35
MICROSOFT CORP	268,054	221.39	59,344,475.06
MONGODB INC	2,520	145.38	366,357.60
NORTONLIFELOCK INC	22,205	22.16	492,062.80
OKTA INC	5,670	45.02	255,263.40
ORACLE CORP	60,653	76.00	4,609,628.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	61,050	7.93	484,126.50
PALO ALTO NETWORKS INC	11,085	142.21	1,576,397.85
PAYCHEX INC	12,032	113.76	1,368,760.32
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	306.20	595,559.00
PAYPAL HOLDINGS INC	41,727	75.18	3,137,035.86
PTC INC	4,160	124.24	516,838.40
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,990	29.75	88,952.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,960	396.03	1,568,278.80
SALESFORCE INC	37,616	139.77	5,257,588.32
SERVICENOW INC	7,550	361.75	2,731,212.50
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,310	132.31	1,099,496.10
SPLUNK INC	6,120	72.03	440,823.60
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	48.98	414,860.60
SYNOPSYS INC	5,722	276.57	1,582,533.54
TWILIO INC - A	6,435	42.74	275,031.90
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,570	287.93	452,050.10
UNITY SOFTWARE INC	6,770	25.26	171,010.20
VERISIGN INC	3,690	176.69	651,986.10
VISA INC-CLASS A SHARES	62,252	196.98	12,262,398.96
VMWARE INC-CLASS A	7,697	110.73	852,288.81
WESTERN UNION CO	14,561	12.81	186,526.41

WIX.COM LTD	2,280	70.35	160,398.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,350	132.63	974,830.50
ZENDESK INC	4,780	76.18	364,140.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,530	77.46	660,733.80
ZSCALER INC	3,190	121.00	385,990.00
AMPHENOL CORP-CL A	22,030	76.27	1,680,228.10
APPLE INC	610,624	138.38	84,498,149.12
ARISTA NETWORKS INC	9,330	131.07	1,222,883.10
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	104.20	262,584.00
CDW CORP/DE	5,040	172.41	868,946.40
CISCO SYSTEMS INC	156,810	44.52	6,981,181.20
COGNEX CORP	6,480	46.04	298,339.20
CORNING INC	29,878	32.89	982,687.42
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	39.00	396,708.00
F5 INC	2,385	137.81	328,676.85
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	48,285	14.25	688,061.25
HP INC	40,475	28.29	1,145,037.75
JUNIPER NETWORKS INC	11,943	30.12	359,723.16
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,760	163.85	1,107,626.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,220	254.87	1,585,291.40
NETAPP INC	8,246	68.79	567,242.34
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	51.12	398,429.28
TE CONNECTIVITY LTD	11,995	116.68	1,399,576.60
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	395.03	691,302.50
TRIMBLE INC	9,520	53.79	512,080.80
WESTERN DIGITAL CORP	11,818	35.44	418,829.92
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	230.56	478,412.00
AT&T INC	271,177	18.32	4,967,962.64
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,435	17.60	95,656.00
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,131	18.39	204,699.09
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	5.92	203,565.12
T-MOBILE US INC	23,779	148.83	3,539,028.57
VERIZON COMMUNICATIONS INC	158,977	37.24	5,920,303.48
AES CORP	25,138	26.46	665,151.48
ALLIANT ENERGY CORP	9,590	52.73	505,680.70

AMEREN CORPORATION	9,572	81.03	775,619.16
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,348	89.57	1,733,000.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	139.04	932,263.20
ATMOS ENERGY CORP	5,310	106.03	563,019.30
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	28.48	682,722.56
CMS ENERGY CORP	11,090	57.03	632,462.70
CONSOLIDATED EDISON INC	13,356	90.04	1,202,574.24
CONSTELLATION ENERGY	12,258	94.32	1,156,174.56
DOMINION ENERGY INC	30,271	67.13	2,032,092.23
DTE ENERGY COMPANY	7,188	112.39	807,859.32
DUKE ENERGY CORP	29,256	93.61	2,738,654.16
EDISON INTERNATIONAL	14,439	59.03	852,334.17
ENERGY CORP	7,507	110.72	831,175.04
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	44.21	406,289.90
EVERGY INC	8,720	62.60	545,872.00
EVERSOURCE ENERGY	12,680	77.18	978,642.40
EXELON CORP	36,716	37.18	1,365,100.88
FIRSTENERGY CORP	20,205	37.90	765,769.50
NEXTERA ENERGY INC	74,380	78.80	5,861,144.00
NISOURCE INC	15,610	25.89	404,142.90
NRG ENERGY INC	8,760	44.35	388,506.00
P G & E CORP	55,800	15.31	854,298.00
PPL CORP	26,948	27.00	727,596.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,748	57.89	1,085,321.72
SEMPRA ENERGY	11,762	154.83	1,821,110.46
SOUTHERN CO	39,885	64.91	2,588,935.35
UGI CORP	7,720	34.94	269,736.80
VISTRA CORP	14,720	22.85	336,352.00
WEC ENERGY GROUP INC	11,770	91.39	1,075,660.30
XCEL ENERGY INC	20,304	65.55	1,330,927.20
ADVANCED MICRO DEVICES	60,954	62.19	3,790,729.26
ANALOG DEVICES INC	19,737	144.29	2,847,851.73
APPLIED MATERIALS INC	32,783	91.70	3,006,201.10
BROADCOM INC	15,295	465.30	7,116,763.50
ENPHASE ENERGY INC	5,065	282.44	1,430,558.60

	ENTEGRIS INC	5,660	63.94	361,900.40	
	INTEL CORP	154,962	28.20	4,369,928.40	
	KLA CORP	5,599	328.03	1,836,639.97	
	LAM RESEARCH CORP	5,192	419.54	2,178,251.68	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	32,084	38.97	1,250,313.48	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,258	63.86	1,357,535.88	
	MICRON TECHNOLOGY INC	42,347	56.16	2,378,207.52	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	351.74	599,716.70	
	NVIDIA CORP	94,450	141.56	13,370,342.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	9,847	151.06	1,487,487.82	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,180	63.19	1,022,414.20	
	QORVO INC	4,240	86.85	368,244.00	
	QUALCOMM INC	42,112	106.69	4,492,929.28	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,960	87.93	524,062.80	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	219.00	439,095.00	
	TERADYNE INC	6,190	84.72	524,416.80	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	34,912	162.65	5,678,436.80	
米ドル小計		12,834,552		1,229,742,238.75	(180,821,298,785)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	19.62	500,506.20	
	CAMECO CORP	16,352	30.76	502,987.52	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	43,424	82.45	3,580,308.80	
	CENOVUS ENERGY INC	52,203	28.49	1,487,263.47	
	ENBRIDGE INC	76,937	54.17	4,167,677.29	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	77.12	688,064.64	
	KEYERA CORP	8,460	29.22	247,201.20	
	PARKLAND CORP	6,170	25.89	159,741.30	
	PEMBINA PIPELINE CORP	20,412	45.89	936,706.68	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	48.70	2,604,914.30	
	TC ENERGY CORP	36,643	60.06	2,200,778.58	
	TOURMALINE OIL CORP	12,040	81.55	981,862.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,806	58.51	983,319.06	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	19.13	1,331,907.12	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	61.93	356,097.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	29.30	663,645.00	

FRANCO-NEVADA CORP	7,175	171.36	1,229,508.00
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	10.37	254,168.70
KINROSS GOLD CORP	46,025	5.23	240,710.75
LUNDIN MINING CORP	25,010	8.04	201,080.40
NUTRIEN LTD	20,478	98.79	2,023,021.62
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,660	20.10	153,966.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	45.61	819,839.75
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	105.09	257,470.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,865	46.27	780,343.55
CAE INC	12,305	24.30	299,011.50
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	104.19	339,659.40
WSP GLOBAL INC	4,590	163.73	751,520.70
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	33.67	249,494.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	84.07	339,642.80
THOMSON REUTERS CORP	6,546	141.48	926,128.08
AIR CANADA	7,190	18.77	134,956.30
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,088	160.67	3,548,878.96
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34,881	102.28	3,567,628.68
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	124.18	398,617.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	76.29	813,861.72
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	89.37	140,310.90
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	39.13	275,475.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	81.85	900,186.30
QUEBECOR INC -CL B	6,110	26.35	160,998.50
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	35.58	621,404.70
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	152.15	299,735.50
DOLLARAMA INC	10,360	79.41	822,687.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	31,090	61.65	1,916,698.50
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	34.76	241,582.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	112.36	712,250.04
METRO INC	8,750	72.21	631,837.50
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	151.72	426,029.76
SAPUTO INC	9,620	32.91	316,594.20
BANK OF MONTREAL	25,231	126.87	3,201,056.97
BANK OF NOVA SCOTIA	45,169	65.85	2,974,378.65

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,740	62.44	2,106,725.60
NATIONAL BANK OF CANADA	12,600	93.81	1,182,006.00
ROYAL BANK OF CANADA	53,399	127.32	6,798,760.68
TORONTO-DOMINION BANK	68,920	87.97	6,062,892.40
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	52,859	54.51	2,881,344.09
IGM FINANCIAL INC	3,335	37.64	125,529.40
ONEX CORPORATION	2,765	69.64	192,554.60
TMX GROUP LTD	2,170	132.39	287,286.30
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	692.14	622,926.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	30.09	340,739.16
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	76.79	312,919.25
INTACT FINANCIAL CORP	6,535	207.66	1,357,058.10
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	22.60	1,625,414.60
POWER CORP OF CANADA	20,479	33.03	676,421.37
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,544	59.95	1,291,562.80
FIRSTSERVICE CORP	1,500	161.55	242,325.00
BLACKBERRY LTD	22,208	5.93	131,693.44
CGI INC	8,030	106.99	859,129.70
CONSTELLATION SOFTWARE INC	740	1,835.35	1,358,159.00
LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	20.12	88,326.80
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	39.11	87,997.50
OPEN TEXT CORP	9,610	36.13	347,209.30
SHOPIFY INC - CLASS-A	42,330	43.33	1,834,158.90
BCE INC	3,000	61.75	185,250.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	56.66	786,157.50
TELUS CORP	12,662	28.70	363,399.40
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	14.89	403,221.20
ALTAGAS LTD	11,170	23.55	263,053.50
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	42.44	231,085.80
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.28	160,876.80
EMERA INC	10,460	49.82	521,117.20
FORTIS INC	17,195	53.35	917,353.25
HYDRO ONE LTD	13,230	33.86	447,967.80
NORTHLAND POWER INC	8,600	39.37	338,582.00
	1,536,099		87,794,921.33

加ドル小計				(9,545,941,796)
ユーロ	ENI SPA	92,446	14.01	1,295,168.46
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	10.99	206,117.45
	NESTE OYJ	16,380	45.47	744,798.60
	OMV AG	5,480	49.56	271,588.80
	REPSOL SA	54,849	14.29	784,066.45
	TENARIS SA	17,895	16.64	297,862.27
	TOTALENERGIES SE	93,897	57.76	5,423,490.72
	AIR LIQUIDE SA	19,879	132.92	2,642,316.68
	AKZO NOBEL	6,937	63.46	440,222.02
	ARCELORMITTAL	20,552	23.51	483,177.52
	ARKEMA	2,215	83.76	185,528.40
	BASF SE	34,575	46.81	1,618,628.62
	COVESTRO AG	7,410	35.33	261,795.30
	CRH PLC	28,450	36.90	1,049,947.25
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.67	153,654.10
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	48.26	275,805.90
	KONINKLIJKE DSM NV	6,392	117.05	748,183.60
	OCI NV	4,810	39.50	189,995.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	33.65	304,532.50
	SOLVAY SA	2,811	94.46	265,527.06
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,785	13.92	275,506.12
	SYMRISE AG	4,910	100.90	495,419.00
	UMICORE	7,960	34.01	270,719.60
	UPM-KYMMENE OYJ	21,098	35.19	742,438.62
	VOESTALPINE AG	4,249	23.70	100,701.30
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,896	25.75	280,572.00
	AIRBUS GROUP SE	22,308	114.00	2,543,112.00
	ALSTOM	11,635	21.72	252,712.20
	BOUYGUES SA	8,460	29.53	249,823.80
	BRENTAG SE	5,605	62.74	351,657.70
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	13.31	525,878.10	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	18,426	41.71	768,548.46	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	16,776	27.56	462,430.44	
DASSAULT AVIATION SA	900	149.00	134,100.00	

EIFFAGE	3,250	92.20	299,650.00
FERROVIAL SA	18,485	23.60	436,246.00
FERROVIAL SA -RTS(N)	18,485	0.42	7,880.15
GEA GROUP AG	6,020	37.11	223,402.20
IMCD NV	2,120	130.55	276,766.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	51.28	302,552.00
KION GROUP AG	2,874	24.20	69,550.80
KNORR-BREMSE AG	2,970	47.42	140,837.40
KONE OYJ-B	13,614	44.35	603,780.90
LEGRAND SA	10,058	74.08	745,096.64
MTU AERO ENGINES AG	2,020	183.60	370,872.00
PRYSMIAN SPA	9,565	32.47	310,575.55
RATIONAL AG	230	520.50	119,715.00
RHEINMETALL AG	1,730	154.20	266,766.00
SAFRAN SA	12,790	113.60	1,452,944.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,418	131.64	2,687,825.52
SIEMENS AG-REG	28,996	113.04	3,277,707.84
SIEMENS ENERGY AG	15,843	12.27	194,393.61
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,870	17.94	159,127.80
THALES SA	4,015	125.35	503,280.25
VINCI SA	19,890	96.00	1,909,440.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	7.26	132,023.16
BUREAU VERITAS SA	10,920	25.51	278,569.20
RANDSTAD NV	4,675	51.02	238,518.50
TELEPERFORMANCE	2,240	273.00	611,520.00
WOLTERS KLUWER	10,027	99.54	998,087.58
ADP	1,090	137.45	149,820.50
AENA SA	2,870	117.50	337,225.00
ATLANTIA SPA	18,740	22.69	425,210.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	7.09	169,500.24
DEUTSCHE POST AG-REG	36,733	35.52	1,304,756.16
GETLINK	17,310	15.84	274,190.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,385	79.80	988,323.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	75.80	167,518.00
CONTINENTAL AG	4,385	54.20	237,667.00

DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	100.00	438,000.00
FERRARI NV	4,474	201.40	901,063.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	29,922	59.74	1,787,540.28
MICHELIN (CGDE)	25,266	25.73	650,094.18
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	57.20	324,324.00
RENAULT SA	6,837	30.51	208,631.05
STELLANTIS NV	83,216	13.56	1,128,741.82
VALEO SA	7,420	17.37	128,922.50
VOLKSWAGEN AG	1,151	174.00	200,274.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,003	133.08	931,959.24
ADIDAS AG	6,451	114.04	735,672.04
HERMES INTERNATIONAL	1,172	1,357.00	1,590,404.00
KERING	2,782	503.40	1,400,458.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,514	666.20	7,004,426.80
MONCLER SPA	8,080	45.39	366,751.20
PUMA SE	4,200	46.08	193,536.00
SEB SA	987	67.65	66,770.55
ACCOR SA	6,056	24.20	146,555.20
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,356	131.25	834,225.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	34.25	133,575.00
SODEXO	3,240	89.92	291,340.80
BOLLORE SE	33,530	5.11	171,505.95
PUBLICIS GROUPE	8,645	57.78	499,508.10
SCOUT24 SE	2,970	52.20	155,034.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	27.79	97,542.90
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	19.62	544,118.06
VIVENDI SE	26,070	8.37	218,362.32
D'IETEREN GROUP	1,050	165.10	173,355.00
DELIVERY HERO SE	6,600	35.22	232,452.00
INDITEX	42,275	23.55	995,576.25
JUST EAT TAKEAWAY	6,460	19.99	129,135.40
PROSUS	30,720	50.12	1,539,686.40
ZALANDO SE	8,260	25.08	207,160.80
CARREFOUR SA	22,633	16.42	371,633.86
HELLOFRESH SE	6,070	21.31	129,351.70

JERONIMO MARTINS	10,585	20.72	219,321.20
KESKO OYJ-B SHS	10,930	20.65	225,704.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,478	28.18	1,084,502.43
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,441	52.23	1,694,393.43
DANONE	23,614	50.04	1,181,644.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	9.31	184,843.20
HEINEKEN HOLDING NV	3,675	68.70	252,472.50
HEINEKEN NV	9,673	83.76	810,210.48
JDE PEET'S NV	4,010	28.78	115,407.80
KERRY GROUP PLC-A	5,910	87.30	515,943.00
PERNOD-RICARD SA	7,726	182.80	1,412,312.80
REMY COINTREAU	810	159.50	129,195.00
BEIERSDORF AG	3,805	96.48	367,106.40
HENKEL AG & CO KGAA	3,450	59.10	203,895.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	62.48	424,426.64
L'OREAL	9,161	321.40	2,944,345.40
AMPLIFON SPA	4,830	25.19	121,667.70
BIOMERIEUX	1,690	89.44	151,153.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	119.80	192,878.00
DIASORIN ITALIA SPA	930	129.20	120,156.00
ESSILORLUXOTTICA	10,755	161.80	1,740,159.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	28.64	218,036.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	23.20	364,124.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32,510	12.64	411,056.44
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	45.71	486,354.40
ARGENX SE	1,985	371.80	738,023.00
BAYER AG-REG	37,444	53.88	2,017,482.72
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	64.96	328,048.00
GRIFOLS SA	12,050	8.85	106,666.60
IPSEN	1,350	103.40	139,590.00
MERCK KGAA	4,810	164.40	790,764.00
ORION OYJ-CLASS B	3,620	47.21	170,900.20
QIAGEN N.V.	8,384	42.87	359,422.08
RECORDATI SPA	3,720	38.48	143,145.60
SANOFI	43,186	87.88	3,795,185.68

SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	960	337.30	323,808.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	306.60	331,128.00
UCB SA	4,928	76.44	376,696.32
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	10.41	157,995.55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	250,583	5.30	1,329,092.23
BANCO SANTANDER SA	643,689	2.66	1,718,005.94
BNP PARIBAS	41,972	50.63	2,125,042.36
CAIXABANK S.A	163,050	3.25	530,238.60
COMMERZBANK AG	40,474	8.22	332,777.22
CREDIT AGRICOLE SA	55,242	9.62	531,814.73
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	28.03	364,894.54
FINECOBANK SPA	23,540	14.17	333,679.50
ING GROEP NV-CVA	146,925	10.94	1,607,359.50
INTESA SANPAOLO	613,793	2.06	1,267,482.54
KBC GROEP NV	9,719	53.00	515,107.00
MEDIOBANCA SPA	20,580	9.39	193,410.84
SOCIETE GENERALE	29,859	24.10	719,601.90
UNICREDIT SPA	79,316	13.04	1,034,439.27
AMUNDI SA	2,140	49.54	106,015.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	9.72	787,173.81
DEUTSCHE BOERSE AG	7,000	158.65	1,110,550.00
EURAZEO SE	1,487	58.15	86,469.05
EURONEXT NV	3,470	64.38	223,398.60
EXOR NV	4,164	68.62	285,733.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	74.52	257,243.04
SOFINA	655	198.60	130,083.00
WENDEL	1,000	80.95	80,950.00
AEGON NV	69,679	4.69	327,073.22
AGEAS	5,924	36.78	217,884.72
ALLIANZ SE-REG	15,338	188.14	2,885,691.32
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	15.68	662,659.88
AXA SA	69,562	25.91	1,802,699.23
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	164.25	373,668.75
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,176	272.20	1,408,907.20
NN GROUP NV	10,270	42.76	439,145.20

POSTE ITALIANE SPA	19,560	9.02	176,548.56
SAMPO OYJ-A SHS	17,799	45.82	815,550.18
AROUNDTOWN SA	35,980	2.04	73,723.02
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	66.38	163,958.60
VONOVIA SE	27,119	22.72	616,143.68
ADYEN NV	810	1,291.20	1,045,872.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	51.50	880,135.00
BECHTLE AG	3,070	34.79	106,805.30
CAP GEMINI SA	6,509	160.30	1,043,392.70
DASSAULT SYSTEMES SE	24,650	33.41	823,679.75
EDENRED	9,626	53.70	516,916.20
NEMETSCHEK SE	2,350	46.49	109,251.50
NEXI SPA	21,240	8.57	182,069.28
SAP SE	39,222	96.24	3,774,725.28
WORLDLINE SA	8,950	43.56	389,862.00
NOKIA OYJ	203,856	4.39	896,252.90
CELLNEX TELECOM SA	21,660	32.43	702,433.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	121,716	19.60	2,386,607.32
ELISA OYJ	5,465	48.61	265,653.65
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.17	139,169.58
KONINKLIJKE KPN NV	124,056	2.78	345,495.96
ORANGE S.A.	74,364	9.76	725,792.64
PROXIMUS	5,600	10.60	59,360.00
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.21	87,992.70
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	2.31	107,763.93
TELEFONICA SA	195,629	3.62	709,546.38
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	19.21	76,840.00
ACCIONA SA	830	182.60	151,558.00
E.ON SE	90,999	8.70	791,691.30
EDF	21,315	11.93	254,287.95
EDP RENOVAVEIS SA	11,010	21.32	234,733.20
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	105,831	4.34	459,306.54
ELIA GROUP SA/NV	1,356	129.30	175,330.80
ENAGAS SA	8,610	16.37	140,988.75
ENDESA SA	12,050	16.65	200,692.75

	ENEL SPA	300,937	4.67	1,408,234.69	
	ENGIE	68,324	13.53	924,970.31	
	FORTUM OYJ	16,755	14.38	241,020.67	
	IBERDROLA SA	220,452	10.00	2,205,622.26	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	25.33	158,363.16	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,580	16.36	254,966.70	
	RWE AG	25,835	39.05	1,008,856.75	
	SNAM SPA	72,420	4.64	336,608.16	
	TERNA SPA	53,627	6.86	367,988.47	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,790	23.28	577,111.20	
	VERBUND AG	2,780	77.65	215,867.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,765	223.00	393,595.00	
	ASML HOLDING NV	15,362	464.40	7,134,112.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	49,285	25.76	1,269,828.02	
	STMICROELECTRONICS NV	25,233	31.90	805,058.86	
ユーロ小計		6,962,432		156,765,847.11 (22,895,651,970)	
英ポンド	BP PLC	732,448	4.99	3,661,873.77	
	SHELL PLC-NEW	281,607	25.26	7,114,800.85	
	ANGLO AMERICAN PLC	46,644	29.51	1,376,697.66	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	12.62	180,844.60	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,071	65.10	330,122.10	
	GLENCORE PLC	373,573	5.32	1,987,408.36	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	20.13	147,734.07	
	MONDI PLC	18,370	15.07	276,835.90	
	RIO TINTO PLC	42,025	50.30	2,113,857.50	
	ASHTREAD GROUP PLC	16,770	47.80	801,606.00	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	117,325	7.98	937,192.10	
	BUNZL PLC	12,896	29.00	373,984.00	
	DCC PLC	3,820	49.15	187,753.00	
	FERGUSON PLC	7,952	96.94	770,866.88	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.21	198,092.46	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	0.85	273,229.48	
	SMITHS GROUP PLC	13,603	15.81	215,063.43	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	108.05	312,264.50	

EXPERIAN PLC	33,988	26.93	915,296.84
INTERTEK GROUP PLC	6,025	37.73	227,323.25
RELX PLC	71,505	23.08	1,650,335.40
RENTOKIL INITIAL PLC	95,400	5.20	496,843.20
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	3.88	158,237.92
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	35.84	161,817.60
BURBERRY GROUP PLC	15,504	19.33	299,769.84
PERSIMMON PLC	12,440	13.30	165,452.00
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	0.96	119,821.30
COMPASS GROUP PLC	66,698	18.82	1,255,589.85
ENTAIN PLC	21,400	12.84	274,776.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,263	47.89	395,715.07
WHITBREAD PLC	8,110	25.76	208,913.60
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	5.40	197,210.88
INFORMA PLC	56,580	5.77	326,919.24
PEARSON PLC	26,089	9.51	248,158.56
WPP PLC	41,144	8.00	329,152.00
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.04	101,292.67
KINGFISHER PLC	78,137	2.26	176,824.03
NEXT PLC	4,637	51.28	237,785.36
OCADO GROUP PLC	22,670	6.34	143,727.80
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.08	147,344.28
TESCO PLC	277,818	2.23	620,089.77
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	14.23	186,834.37
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	81,097	33.76	2,738,240.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	19.00	146,148.45
DIAGEO PLC	86,102	36.88	3,175,441.76
IMPERIAL BRANDS PLC	33,172	21.18	702,582.96
HALEON PLC	194,651	2.75	535,874.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,545	57.38	1,523,152.10
UNILEVER PLC	96,702	40.53	3,919,815.57
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	31,596	10.48	331,126.08
ASTRAZENECA PLC	58,632	107.42	6,298,249.44
GSK PLC	154,590	14.45	2,234,753.04

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	12.47	71,577.80	
	BARCLAYS PLC	613,451	1.53	941,769.97	
	HSBC HOLDINGS PLC	755,991	4.90	3,704,355.90	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,553,536	0.42	1,091,636.64	
	NATWEST GROUP PLC	192,985	2.38	459,304.30	
	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	5.54	529,199.32	
	3I GROUP PLC	36,819	12.21	449,559.99	
	ABRDN PLC	88,515	1.69	149,988.66	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	7.96	103,639.20	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,467	77.00	959,959.00	
	M&G PLC	99,522	1.76	176,054.41	
	SCHRODERS PLC	30,299	4.04	122,589.75	
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	10.72	220,291.50	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	20.20	137,259.00	
	AVIVA PLC	101,624	4.29	436,271.83	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.38	537,726.33	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.51	166,567.30	
	PRUDENTIAL PLC	101,732	9.13	929,423.55	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	31.40	141,771.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	7.19	279,337.28	
	HALMA PLC	14,690	21.57	316,863.30	
	BT GROUP PLC	267,752	1.14	305,505.03	
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	1.04	1,043,962.73	
	NATIONAL GRID PLC	134,938	9.67	1,305,390.21	
	SEVERN TRENT PLC	9,023	25.52	230,266.96	
	SSE PLC	39,837	15.78	628,827.04	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	9.52	248,676.23	
英債券小計		10,709,387		67,598,615.52	(11,260,577,373)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	16.09	128,559.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	622.50	168,075.00	
	GIVAUDAN-REG	348	2,903.00	1,010,244.00	
	HOLCIM LTD	20,649	46.91	968,644.59	
	SIG GROUP AG	10,900	19.99	217,891.00	
	SIKA AG-REG	5,505	224.20	1,234,221.00	

ABB LTD-REG	61,275	28.23	1,729,793.25
GEBERIT AG-REG	1,490	419.20	624,608.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	161.80	173,126.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,310	167.50	219,425.00
VAT GROUP AG	1,015	224.40	227,766.00
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	31.53	214,940.01
SGS SA-REG	238	2,182.00	519,316.00
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	209.00	451,440.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,549	104.30	2,038,960.70
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	244.80	275,400.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	45.30	83,805.00
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,908.00	248,040.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,610.00	384,400.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	95,800.00	383,200.00
NESTLE SA-REG	106,540	108.66	11,576,636.40
ALCON INC	18,644	57.42	1,070,538.48
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	225.80	463,115.80
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,050	94.94	384,507.00
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,400	71.25	99,750.00
LONZA GROUP AG-REG	2,793	479.20	1,338,405.60
NOVARTIS AG-REG	81,883	81.17	6,646,443.11
ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	397.80	405,756.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,568	326.40	8,671,795.20
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	98,798	4.18	413,568.42
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	49.27	414,853.40
PARTNERS GROUP HOLDING AG	850	901.20	766,020.00
UBS GROUP AG-REG	133,062	16.25	2,162,257.50
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	138.00	240,120.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,140	483.70	551,418.00
SWISS RE AG	11,379	75.32	857,066.28
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,651	429.50	2,427,104.50
SWISS PRIME SITE-REG	2,711	80.70	218,777.70
TEMENOS AG	2,280	56.86	129,640.80
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	50.20	334,332.00
SWISSCOM AG-REG	964	488.50	470,914.00

スイスフラン小計		662,339		50,944,874.84 (7,515,897,385)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	351.00	3,611,790.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	405.00	1,425,600.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	133.65	3,031,182.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	280.10	2,999,871.00	
	ASSA ABLOY AB-B	37,490	224.50	8,416,505.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	102,900	121.28	12,479,712.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	109.02	6,199,967.40	
	EPIROC AB-A	24,905	173.75	4,327,243.75	
	EPIROC AB-B	15,450	150.85	2,330,632.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	67.38	1,010,700.00	
	INDUTRADE AB	10,180	190.00	1,934,200.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	184.90	1,257,320.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	159.10	1,347,577.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,420	88.00	4,964,960.00	
	SANDVIK AB	40,890	177.45	7,255,930.50	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	168.95	2,431,190.50	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	166.10	2,338,521.90	
	VOLVO AB-A SHS	7,120	195.00	1,388,400.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	56,670	185.94	10,537,219.80	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	91.06	1,619,775.28	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	48.38	987,054.00	
	ELECTROLUX AB-B	8,095	134.52	1,088,939.40	
	EVOLUTION AB	6,740	1,014.60	6,838,404.00	
	EMBRACER GROUP AB	23,940	52.71	1,261,877.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	116.02	3,230,924.96	
	SWEDISH MATCH AB	56,700	115.05	6,523,335.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	231.30	5,480,653.50		
GETINGE AB-B SHS	7,680	232.20	1,783,296.00		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	209.50	1,493,735.00		
NORDEA BANK ABP	126,012	106.32	13,397,595.84		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	117.90	7,362,855.00		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	53,420	104.40	5,577,048.00		
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	166.75	5,761,212.50		

	EQT AB	10,680	217.80	2,326,104.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	251.10	1,251,482.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	248.10	1,483,638.00	
	INVESTOR AB-A SHS	19,180	187.50	3,596,250.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	180.80	12,538,480.00	
	KINNEVIK AB - B	8,285	135.55	1,123,031.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	435.30	1,562,727.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	41.05	953,181.00	
	SAGAX AB-B	7,910	205.00	1,621,550.00	
	ERICSSON LM-B SHS	107,615	60.12	6,469,813.80	
	HEXAGON AB-B SHS	71,970	108.15	7,783,555.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	90.80	2,110,646.00	
	TELIA CO AB	94,230	29.06	2,738,323.80	
	スウェーデンクローナ小計	1,441,521		187,254,012.48	(2,518,566,467)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	361.50	4,374,150.00	
	EQUINOR ASA	36,424	392.75	14,305,526.00	
	NORSK HYDRO A S	50,660	69.38	3,514,790.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	463.00	3,088,210.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	377.00	1,470,300.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	72.75	829,350.00	
	MOWI ASA	16,360	155.30	2,540,708.00	
	ORKLA ASA	32,290	68.12	2,199,594.80	
	SALMAR ASA	2,100	334.40	702,240.00	
	DNB BANK ASA	35,845	182.20	6,530,959.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	188.90	1,399,749.00	
TELENOR ASA	23,915	93.18	2,228,399.70		
	ノルウェークローネ小計	239,074		43,183,977.30	(617,099,035)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	425.70	1,634,688.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	394.40	3,220,276.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,500.00	472,500.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,290	154.36	5,910,444.40	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	110	14,120.00	1,553,200.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	14,585.00	2,844,075.00	

	DSV A/S	6,940	1,021.00	7,085,740.00	
	PANDORA A/S	3,310	410.30	1,358,093.00	
	CARLSBERG AS-B	3,630	906.20	3,289,506.00	
	COLOPLAST-B	4,485	809.00	3,628,365.00	
	DEMANT A/S	3,640	177.95	647,738.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	169.70	843,409.00	
	GENMAB A/S	2,475	2,964.00	7,335,900.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	62,645	841.70	52,728,296.50	
	DANSKE BANK A/S	26,635	121.70	3,241,479.50	
	TRYG A/S	13,945	163.10	2,274,429.50	
	ORSTED A/S	7,030	621.20	4,367,036.00	
	デンマーククロネ小計	190,620		102,435,175.90	(2,010,802,502)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	28.09	246,489.75	
	SANTOS LTD	121,660	8.00	973,280.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	28.28	236,703.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,206	38.17	2,717,933.02	
	BHP GROUP LTD	191,757	38.56	7,394,149.92	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	16.04	293,692.40	
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	2.01	138,690.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,055	15.87	1,016,552.85	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	32.97	559,006.35	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,240	73.52	458,764.80	
	NEWCREST MINING LTD	35,809	17.40	623,076.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	8.76	369,584.40	
	ORICA LIMITED	17,675	14.16	250,278.00	
	RIO TINTO LTD	14,098	92.80	1,308,294.40	
	SOUTH32 LTD	169,887	3.81	647,269.47	
	REECE LTD	10,200	14.97	152,694.00	
	BRAMBLES LTD	54,798	11.40	624,697.20	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.63	267,059.10	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.97	209,129.10	
	TRANSURBAN GROUP	113,696	13.50	1,534,896.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	37.16	874,003.20	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	54.33	115,722.90	

	IDP EDUCATION LTD	7,220	28.99	209,307.80	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.27	365,315.58	
	REA GROUP LTD	1,820	119.11	216,780.20	
	SEEK LTD	12,860	21.77	279,962.20	
	WESFARMERS LTD	42,585	45.23	1,926,119.55	
	COLES GROUP LTD	49,255	16.18	796,945.90	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	6.98	352,224.76	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	45,612	32.56	1,485,126.72	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	12.68	353,848.08	
	COCHLEAR LTD	2,527	195.31	493,548.37	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	57.82	410,811.10	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	32.19	568,475.40	
	CSL LTD	18,282	275.60	5,038,519.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	110,339	25.50	2,813,644.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	64,677	103.05	6,664,964.85	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,003	32.12	3,918,736.36	
	WESTPAC BANKING CORP	131,371	24.14	3,171,295.94	
	ASX LTD	7,105	67.74	481,292.70	
	MACQUARIE GROUP LTD	13,614	170.37	2,319,417.18	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.94	469,917.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	2.82	305,772.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	12.62	696,750.20	
	SUNCORP GROUP LTD	59,226	11.73	694,720.98	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	25.90	541,569.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	57.96	343,123.20	
	XERO LTD	4,930	74.89	369,207.70	
	TELSTRA GROUP LTD	144,984	3.90	565,437.60	
	APA GROUP	45,818	10.48	480,172.64	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	5.74	392,156.80	
豪ドル小計		2,595,761		57,737,131.67 (5,462,510,027)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.46	351,850.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	19.50	451,035.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.16	395,520.20	
	MERCURY NZ LTD	20,400	5.64	115,056.00	

	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	4.74	217,945.20	
ニュージーランドドル小計		213,252		1,531,407.30	(132,604,558)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	41.00	4,231,528.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	78.50	4,121,250.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	12.06	856,260.00	
	MTR CORP	57,500	34.80	2,001,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	13.64	709,280.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	81,000	42.15	3,414,150.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	16.90	1,632,540.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	75,600	14.98	1,132,488.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	19.06	1,294,174.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.27	1,280,547.38	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	134,500	25.20	3,389,400.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	112.70	3,279,570.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,600	246.20	10,980,520.00	
	AIA GROUP LTD	456,790	65.55	29,942,584.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	73,038	44.95	3,283,058.10	
	ESR GROUP LTD	75,800	13.90	1,053,620.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	10.76	839,280.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	20.80	1,204,340.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	16.36	1,008,855.76	
	SINO LAND CO	123,050	8.85	1,088,992.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,480	88.25	4,631,360.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	54.90	961,683.30	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	15.86	659,776.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	33.95	2,166,010.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.79	1,318,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	37.55	938,750.00	
CLP HOLDINGS LTD	59,500	54.30	3,230,850.00		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	5.05	479,750.00		
HONG KONG & CHINA GAS	403,237	6.25	2,520,231.25		
POWER ASSETS HOLDINGS	49,500	37.40	1,851,300.00		
香港ドル小計		3,049,281		95,501,649.59	(1,788,745,896)

シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	7.11	379,389.60	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.33	210,789.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.34	287,826.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.80	169,935.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.95	292,142.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	67,395	34.47	2,323,105.65	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	124,040	12.04	1,493,441.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	28.40	1,187,120.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	32,800	8.44	276,832.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.21	337,050.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.82	135,286.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	6.26	97,343.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	16.13	159,687.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	304,780	2.52	768,045.60	
シンガポールドル小計		1,174,185		8,117,992.95	(848,005,543)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	30.21	788,178.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	690.00	696,900.00	
	BANK HAPOLIM BM	46,265	34.00	1,573,010.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	34.18	2,138,471.70	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	20.55	993,181.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	131.50	644,350.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	262.50	467,250.00	
	NICE LTD	2,440	619.00	1,510,360.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,700	6.29	432,123.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	3,740	145.20	543,048.00	
イスラエルシュケル小計		265,820		9,786,873.10	(406,074,002)
合 計		41,874,323		245,823,775,339	(245,823,775,339)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,250	911,875.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	371,413.70	
		AMERICAN TOWER CORP	17,309	3,529,651.28	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	343,392.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,220	873,253.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	409,565.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	412,550.00	
		CROWN CASTLE INC	16,280	2,117,214.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,635	1,029,148.95	
		EQUINIX INC	3,423	2,091,761.07	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	402,825.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,340	817,208.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	531,315.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,960	763,195.20	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	566,886.60	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	299,606.30	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	489,203.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	467,478.80	
		INVITATION HOMES INC	22,810	707,794.30	
		IRON MOUNTAIN INC	10,895	538,321.95	
		KIMCO REALTY CORP	23,760	508,939.20	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	264,272.20	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	660,996.00	
		PROLOGIS INC	34,995	3,766,161.90	
		PUBLIC STORAGE	5,919	1,643,883.87	
		REALTY INCOME CORP	22,221	1,400,145.21	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	381,737.85	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,030	1,097,409.30	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,404	1,433,530.28	
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	602,364.80	
UDR INC	12,100	465,124.00			
VENTAS INC	14,895	588,203.55			
VICI PROPERTIES INC	35,610	1,119,222.30			
VORNADO REALTY TRUST	6,851	158,463.63			

		WELLTOWER INC	18,090	1,102,585.50	
		WEYERHAEUSER CO	27,758	840,512.24	
		WP CAREY INC	7,310	565,794.00	
米ドル小計			498,588	34,273,007.35	(5,039,503,000)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	117,404.00	
加ドル小計			2,800	117,404.00	(12,765,336)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	106,645.00	
		GECINA SA	1,950	178,230.00	
		KLEPIERRE	8,402	172,913.16	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,160	201,718.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	136,430.40	
ユーロ小計			21,597	795,936.96	(116,246,593)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	114,570.14	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	154,099.71	
		SEGRO PLC	45,033	351,527.59	
英ポンド小計			102,258	620,197.44	(103,312,489)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	318,026.52	
		GOODMAN GROUP	63,582	1,070,085.06	
		GPT GROUP	71,335	306,027.15	
		LENDLEASE GROUP	23,367	180,393.24	
		MIRVAC GROUP	159,875	329,342.50	
		SCENTRE GROUP	198,271	569,037.77	
		STOCKLAND	82,300	287,227.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	295,862.82	
豪ドル小計			795,699	3,356,002.06	(317,511,354)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	77,300	3,849,540.00	
香港ドル小計			77,300	3,849,540.00	(72,101,884)
シンガ ポールド	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	353,902.08	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	389,774.16	

ル	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	215,388.44	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	106,000	165,360.00	
シンガポールドル小計		598,355	1,124,424.68	(117,457,402)
合計			5,778,898,058	(5,778,898,058)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 598銘柄	97.3%		72.0%
	投資証券 37銘柄		2.7%	2.0%
加ドル	株式 85銘柄	99.9%		3.8%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 224銘柄	99.5%		9.1%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 80銘柄	99.1%		4.5%
	投資証券 3銘柄		0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 51銘柄	94.5%		2.2%
	投資証券 8銘柄		5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 30銘柄	96.1%		0.7%
	投資証券 1銘柄		3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.8%		0.3%
	投資証券 4銘柄		12.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%		0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）		
	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	150,138,514	135,028,907
国債証券	37,223,310,744	40,125,576,710
地方債証券	4,809,488,005	3,456,279,410
特殊債券	5,299,735,290	3,529,893,000
社債券	1,415,554,089	603,587,000
未収利息	98,136,584	93,944,383
前払費用	3,351,344	777,937
流動資産合計	48,999,714,570	47,945,087,347
負債の部		
流動負債		
未払解約金	38,332,570	20,543,058
未払利息	80	201
流動負債合計	38,332,650	20,543,259
純資産の部		
元本等		
元本	34,595,028,808	35,316,879,855
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	14,366,353,112	12,607,664,233
元本等合計	48,961,381,920	47,924,544,088
純資産合計	48,961,381,920	47,924,544,088
負債純資産合計	48,999,714,570	47,945,087,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
1.	期首	2020年11月 7日	2021年11月 9日
	期首元本額	30,950,687,612円	34,595,028,808円
	期首からの追加設定元本額	5,221,516,392円	4,280,220,487円
	期首からの一部解約元本額	1,577,175,196円	3,558,369,440円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	4,213,202,449円	4,858,706,532円
	DCインデックスバランス（株式40）	3,863,811,278円	4,506,974,026円
	DCインデックスバランス（株式60）	2,816,463,929円	3,330,997,716円
	DCインデックスバランス（株式80）	464,079,158円	546,153,242円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,234,982,215円	2,213,868,321円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,122,797,086円	4,491,668,687円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,703,336,062円	1,615,057,133円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,032,467円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	30,008,281円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	99,004,620円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	244,363,632円	- 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,024,703,763円	3,381,046,243円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,462,295,657円	1,483,723,424円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,449,082,259円	1,428,807,915円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	816,378,095円	810,580,735円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	117,292,874円	119,645,043円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,587,744,524円	6,156,699,546円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	340,450,459円	372,951,292円
	計	34,595,028,808円	35,316,879,855円
2.	受益権の総数	34,595,028,808口	35,316,879,855口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	162,726,601
地方債証券	346,247
特殊債券	2,872,940
社債券	36,549
合計	165,909,239

（2022年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	92,048,340
地方債証券	124,760
特殊債券	1,274,000
社債券	44,000
合計	93,403,100

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年11月 8日現在		2022年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.4153円	1口当たり純資産額	1.3570円
(1万口当たり純資産額)	(14,153円)	(1万口当たり純資産額)	(13,570円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第153回利付国債(5年)	300,000,000	299,172,000	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	84,928,900	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	145,515,000	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	98,941,700	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	110,204,750	
	第5回利付国債(40年)	75,000,000	83,494,500	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	118,806,600	
	第7回利付国債(40年)	80,000,000	82,532,000	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	90,754,450	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	90,366,900	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	102,420,000	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	110,343,800	
	第12回利付国債(40年)	175,000,000	122,841,250	
	第13回利付国債(40年)	180,000,000	125,346,600	
	第14回利付国債(40年)	150,000,000	111,544,500	
	第15回利付国債(40年)	140,000,000	113,933,400	
	第333回利付国債(10年)	210,000,000	211,887,900	
	第334回利付国債(10年)	120,000,000	121,258,800	
	第335回利付国債(10年)	490,000,000	494,983,300	
	第336回利付国債(10年)	180,000,000	182,075,400	
	第337回利付国債(10年)	230,000,000	231,679,000	
	第338回利付国債(10年)	390,000,000	394,102,800	
	第339回利付国債(10年)	570,000,000	576,634,800	
	第340回利付国債(10年)	620,000,000	627,824,400	
	第341回利付国債(10年)	700,000,000	707,420,000	
	第342回利付国債(10年)	530,000,000	532,406,200	
第343回利付国債(10年)	545,000,000	547,359,850		
第344回利付国債(10年)	700,000,000	702,702,000		

第345回利付国債(10年)	660,000,000	662,164,800	
第346回利付国債(10年)	690,000,000	691,800,900	
第347回利付国債(10年)	580,000,000	580,928,000	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	500,360,000	
第349回利付国債(10年)	640,000,000	640,160,000	
第350回利付国債(10年)	640,000,000	639,827,200	
第351回利付国債(10年)	535,000,000	534,400,800	
第352回利付国債(10年)	590,000,000	588,796,400	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	398,908,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	323,771,500	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	348,281,500	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	347,746,000	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	555,094,400	
第358回利付国債(10年)	600,000,000	593,490,000	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	414,825,600	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	572,181,600	
第361回利付国債(10年)	270,000,000	266,141,700	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	393,956,000	
第363回利付国債(10年)	300,000,000	295,332,000	
第364回利付国債(10年)	300,000,000	295,071,000	
第365回利付国債(10年)	300,000,000	295,461,000	
第366回利付国債(10年)	400,000,000	400,364,000	
第367回利付国債(10年)	350,000,000	348,519,500	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	58,884,000	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	80,633,700	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	92,910,400	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	59,417,000	
第8回利付国債(30年)	80,000,000	91,560,000	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	130,904,640	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	180,060,300	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	42,912,800	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	60,782,500	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	132,510,400	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	48,199,600	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	49,224,000	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	84,519,400	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	86,345,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	67,895,300	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	84,000,400	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	72,564,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	207,848,800	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	110,125,040	

第28回利付国債(30年)	144,000,000	178,220,160
第29回利付国債(30年)	176,000,000	215,189,920
第30回利付国債(30年)	147,000,000	177,361,380
第31回利付国債(30年)	120,000,000	142,633,200
第32回利付国債(30年)	160,000,000	192,620,800
第33回利付国債(30年)	135,000,000	155,698,200
第34回利付国債(30年)	180,000,000	213,177,600
第35回利付国債(30年)	128,000,000	147,379,200
第36回利付国債(30年)	135,000,000	155,260,800
第37回利付国債(30年)	161,000,000	181,997,620
第38回利付国債(30年)	135,000,000	150,095,700
第39回利付国債(30年)	115,000,000	129,913,200
第40回利付国債(30年)	130,000,000	144,340,300
第41回利付国債(30年)	160,000,000	174,505,600
第42回利付国債(30年)	135,000,000	147,101,400
第43回利付国債(30年)	155,000,000	168,734,550
第44回利付国債(30年)	150,000,000	163,131,000
第45回利付国債(30年)	120,000,000	125,742,000
第46回利付国債(30年)	120,000,000	125,571,600
第47回利付国債(30年)	125,000,000	133,065,000
第48回利付国債(30年)	85,000,000	86,957,550
第49回利付国債(30年)	140,000,000	142,996,000
第50回利付国債(30年)	95,000,000	85,416,400
第51回利付国債(30年)	90,000,000	71,541,900
第52回利付国債(30年)	130,000,000	108,102,800
第53回利付国債(30年)	105,000,000	89,052,600
第54回利付国債(30年)	110,000,000	97,478,700
第55回利付国債(30年)	110,000,000	97,117,900
第56回利付国債(30年)	90,000,000	79,163,100
第57回利付国債(30年)	100,000,000	87,629,000
第58回利付国債(30年)	100,000,000	87,299,000
第59回利付国債(30年)	170,000,000	144,166,800
第60回利付国債(30年)	120,000,000	106,483,200
第61回利付国債(30年)	100,000,000	84,042,000
第62回利付国債(30年)	120,000,000	95,172,000
第63回利付国債(30年)	90,000,000	69,066,900
第64回利付国債(30年)	100,000,000	76,376,000
第65回利付国債(30年)	110,000,000	84,004,800
第66回利付国債(30年)	180,000,000	137,068,200
第67回利付国債(30年)	110,000,000	87,755,800
第68回利付国債(30年)	140,000,000	111,406,400
第69回利付国債(30年)	110,000,000	89,929,400

第70回利付国債(30年)	110,000,000	89,636,800	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	97,556,400	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	129,771,200	
第73回利付国債(30年)	120,000,000	97,292,400	
第74回利付国債(30年)	130,000,000	114,075,000	
第75回利付国債(30年)	90,000,000	85,001,400	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	102,221,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	34,717,060	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	34,908,140	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	80,401,620	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	108,114,240	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	116,485,600	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	117,891,770	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	123,358,380	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,507,100	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	21,965,580	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	41,933,600	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	168,561,600	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	63,683,400	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	139,778,600	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	325,167,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,360,640	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	272,227,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	65,131,200	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	65,119,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	54,484,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	90,429,600	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	271,212,800	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	49,623,750	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	103,202,600	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	128,973,780	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	33,359,700	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	74,095,560	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	91,323,450	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,340,570	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	36,653,430	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	85,830,360	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,241,000	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	145,447,900	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	148,299,140	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	29,977,290	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	110,041,260	

第111回利付国債(20年)	25,000,000	28,328,250	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	90,127,200	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	327,650,700	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	58,889,480	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	142,437,500	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	154,195,650	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	389,287,850	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,307,500	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	33,474,000	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	187,146,200	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	24,781,020	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	19,017,900	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	223,514,850	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	102,445,200	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	57,914,500	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	119,901,600	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	56,687,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	73,949,850	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	95,987,100	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	169,797,000	
第131回利付国債(20年)	92,000,000	103,346,360	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	152,173,350	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	34,083,300	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	136,764,000	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	33,917,100	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	246,716,800	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	226,480,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	133,642,800	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	258,299,200	
第140回利付国債(20年)	358,000,000	406,219,020	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	221,256,750	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	143,055,000	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	105,748,120	
第144回利付国債(20年)	370,000,000	412,542,600	
第145回利付国債(20年)	315,000,000	357,600,600	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	153,274,950	
第147回利付国債(20年)	98,000,000	110,221,580	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	100,160,100	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	127,903,000	
第150回利付国債(20年)	140,000,000	153,939,800	
第151回利付国債(20年)	140,000,000	150,505,600	
第152回利付国債(20年)	300,000,000	322,011,000	

第153回利付国債(20年)	270,000,000	292,677,300	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	171,260,800	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	281,928,600	
第156回利付国債(20年)	160,000,000	154,512,000	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	140,415,000	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	165,180,500	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	147,315,000	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	138,912,200	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	117,012,000	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	145,723,500	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	159,688,650	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	242,214,300	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	160,799,600	
第166回利付国債(20年)	150,000,000	145,732,500	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	150,041,600	
第168回利付国債(20年)	100,000,000	91,886,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	143,838,400	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	125,223,000	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	151,281,300	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	207,437,000	
第173回利付国債(20年)	150,000,000	134,706,000	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	178,694,000	
第175回利付国債(20年)	140,000,000	126,831,600	
第176回利付国債(20年)	160,000,000	144,342,400	
第177回利付国債(20年)	150,000,000	132,345,000	
第178回利付国債(20年)	120,000,000	107,574,000	
第179回利付国債(20年)	190,000,000	169,715,600	
第180回利付国債(20年)	190,000,000	179,042,700	
第181回利付国債(20年)	190,000,000	181,814,800	
国債証券 合計	39,404,000,000	40,125,576,710	
地方債証券			
第4回東京都公募公債(東京グリーンbond(5年))	100,000,000	99,814,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,525,000	
第32回東京都公募公債(5年)	300,000,000	299,568,000	
第726回東京都公募公債	100,000,000	100,776,000	
第730回東京都公募公債	100,000,000	100,820,000	
第739回東京都公募公債	100,000,000	100,432,000	
第744回東京都公募公債	100,000,000	101,310,000	
令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,818,000	
令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,573,000	
第214回神奈川県公募公債	100,000,000	101,274,000	
平成25年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,832,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	202,120,000	

	平成26年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	100,917,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,787,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,803,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	100,895,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,903,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,857,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,146,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,926,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,240,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,000,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,922,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,192,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,874,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	101,161,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	30,000,000	30,070,410	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,086,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,832,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,806,000	
	地方債証券 合計	3,430,000,000	3,456,279,410	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,087,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	201,352,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,787,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,462,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,541,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,334,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,508,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,814,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,560,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,692,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,734,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,772,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,997,000	
	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,000,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,878,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,222,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,665,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,702,000	

	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,000,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,728,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,931,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,104,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,549,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,926,000	
	第357回信中金債（5年）	100,000,000	99,800,000	
	第363回信中金債（5年）	100,000,000	99,700,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	101,260,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,788,000	
特殊債券 合計		3,500,000,000	3,529,893,000	
社債券	第15回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,801,000	
	第25回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付）	100,000,000	100,799,000	
	第11回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,644,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,707,000	
	第20回KDDI株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,726,000	
	第26回KDDI株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,910,000	
社債券 合計		600,000,000	603,587,000	
合計		46,934,000,000	47,715,336,120	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	298,560,533	266,835,444
コール・ローン	35,325,662	179,752,195
国債証券	159,432,757,316	149,367,586,551
派生商品評価勘定	98,150	124,670
未収入金	-	275,679,970
未収利息	932,284,808	1,051,286,225

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
前払費用	28,148,877	56,469,670
流動資産合計	160,727,175,346	151,197,734,725
資産合計	160,727,175,346	151,197,734,725
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,200	55,382
未払金	-	138,770,725
未払解約金	100,530,054	180,846,213
未払利息	18	268
流動負債合計	100,531,272	319,672,588
負債合計	100,531,272	319,672,588
純資産の部		
元本等		
元本	61,717,731,067	57,628,255,000
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	98,908,913,007	93,249,807,137
元本等合計	160,626,644,074	150,878,062,137
純資産合計	160,626,644,074	150,878,062,137
負債純資産合計	160,727,175,346	151,197,734,725

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
1. 期首	2020年11月 7日	2021年11月 9日

期首元本額	62,261,620,781円	61,717,731,067円
期首からの追加設定元本額	5,112,330,712円	3,307,523,614円
期首からの一部解約元本額	5,656,220,426円	7,396,999,681円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	14,925,804,783円	16,907,701,488円
DCインデックスバランス(株式20)	353,460,353円	387,561,022円
DCインデックスバランス(株式40)	470,928,531円	516,414,415円
DCインデックスバランス(株式60)	619,582,841円	686,650,231円
DCインデックスバランス(株式80)	507,904,451円	563,858,699円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	20,202,755,754円	16,948,433,274円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,289,679,949円	2,353,916,341円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	14,454,175,581円	13,124,592,945円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	896,739,833円	835,736,924円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	157,019,480円	144,328,916円
財産3分法(適格機関投資家専用)	31,637,570円	206,936,247円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,796,840円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,277,904円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,106,515円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	10,284,275円	-円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	1,750,123,599円	173,659,188円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	740,459,525円	586,753,405円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	61,334,317円	58,688,504円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	87,993,007円	82,520,263円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	90,122,520円	84,390,583円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	64,628,132円	61,970,216円
インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	3,711,137,127円	3,604,624,434円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	279,778,180円	299,517,905円
計	61,717,731,067円	57,628,255,000円
2. 受益権の総数	61,717,731,067口	57,628,255,000口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月 8日現在	2022年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,972,116,557
合計	1,972,116,557

(2022年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	455,830,341
合計	455,830,341

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	90,992,000	-	90,895,050	96,950
	米ドル	90,992,000	-	90,895,050	96,950
	合計	90,992,000	-	90,895,050	96,950

(2022年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	353,544,021	-	353,474,733	69,288
	米ドル	227,937,705	-	227,837,830	99,875
	加ドル	7,064,674	-	7,065,240	566
	メキシコペソ	7,307,809	-	7,316,006	8,197

	ユーロ	92,566,219	-	92,583,020	16,801
	英ポンド	11,656,785	-	11,657,590	805
	デンマーククローネ	7,010,829	-	7,015,047	4,218
	合計	353,544,021	-	353,474,733	69,288

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2021年11月 8日現在		2022年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.6026円	1口当たり純資産額	2.6181円
(1万口当たり純資産額)	(26,026円)	(1万口当たり純資産額)	(26,181円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,647,617.62	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	884,292.07	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,919,881.72	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	7,000,000.00	6,685,333.27	
		US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,606,329.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,774,386.31	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/11/30	4,000,000.00	3,824,416.96	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,851,640.64	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	1,944,492.18	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,411,723.43	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,939,218.76	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,450,503.13	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,215,695.29	
		US TREASURY N/B-0.125%-24/02/15	5,000,000.00	4,713,085.95	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,449,023.43	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,580,017.58	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,702,636.70	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	3,721,281.25	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,920,234.38	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	2,890,664.07	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,265,925.00	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,830,000.00	2,642,401.96	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	3,707,792.58	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,372,285.16	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,199,464.83	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,533,338.27	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,381,062.50	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,640,000.00	4,408,543.76	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,432,312.50	
		US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,629,882.80	
		US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,349,388.28	
		US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,161,101.57	
US TREASURY N/B-0.375%-24/09/15	6,000,000.00	5,542,500.00			

US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	1,922,199.79	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,072,984.36	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,040,566.79	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,012,770.32	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,434,937.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,329,671.86	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,255,022.67	
US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	1,800,000.00	1,669,500.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,807,449.21	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,224,208.98	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,431,855.46	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,270,949.80	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,274,302.74	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	1,976,071.08	
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,422,815.62	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,921,826.94	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,153,362.50	
US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,481,171.88	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,110,710.93	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	1,940,542.95	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,575,710.92	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,360,537.50	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,420,839.82	
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,789,453.10	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,308,350.00	
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,798,437.50	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,377,337.50	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,671,406.25	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,412,757.43	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,855,273.43	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,022,484.39	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,389,664.65	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,339,132.81	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	1,800,000.00	1,586,214.84	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,215,593.73	

US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,256,990.61	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,013,273.83	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,888,125.00	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,743,841.80	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,626,816.41	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,877,765.58	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,017,142.58	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,677,985.16	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,199,453.12	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,923,806.25	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,117,343.74	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	320,000.00	298,300.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,410,129.70	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,389,085.94	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,526,793.75	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,456,015.63	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,826,640.62	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	874,725.00	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,830,214.83	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,587,500.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,610,117.18	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,458,506.25	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,617,265.64	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,198,492.18	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,472,605.44	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,766,875.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,572,349.60	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	1,949,461.72	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,799,804.68	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,551,953.12	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,060,000.00	1,886,348.42	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,530,000.00	1,335,462.88	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	3,310,000.00	2,816,215.22	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,450,000.00	2,067,474.61	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,239,464.44	

US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,345,750.00	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,600,609.37	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,767,578.10	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	7,000,000.00	5,824,492.17	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	866,425.77	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,692,096.88	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,100,000.00	1,751,818.36	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,380,640.62	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,200,482.79	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,507,898.42	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,735,223.42	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	183,102.73	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,286,335.92	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,375,018.54	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,698,437.52	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,249,665.22	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	818,137.49	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,865,224.01	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,262,337.50	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,647,357.43	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,792,882.79	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,429,531.25	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,885,656.25	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,259,699.20	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,362,500.00	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	4,000,000.00	3,380,000.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,117,522.98	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	4,219,932.99	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	6,000,000.00	5,099,531.28	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	733,688.65	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,162,466.60	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,129,381.25	
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,837,812.50	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,284,751.74	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,677,503.87	

US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,470,000.00	2,943,061.51	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	1,390,000.00	1,187,418.35	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,616,610.14	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,193,887.01	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,548,823.03	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	3,909,955.06	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	4,771,528.12	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	604,767.18	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,492,328.13	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	6,138,859.33	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,600,000.00	5,996,875.00	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,412,241.44	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,500,000.00	5,366,054.72	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,600,000.00	4,137,843.75	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	3,550,000.00	3,152,289.06	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	825,374.96	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	806,645.47	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	673,664.02	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	733,485.88	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	718,406.24	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,427,428.70	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,441,549.49	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	748,168.94	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	699,496.82	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,582,577.92	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,186,035.14	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,338,553.12	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,757,109.36	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	986,604.29	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,897,296.87	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,562,578.05	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,813,589.82	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	862,795.31	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,501,585.96	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	871,331.25	

US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,061,786.70	
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,025,761.73	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	411,513.67	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	612,875.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,526,796.88	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,432,545.69	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,591,232.42	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,712,724.60	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,868,182.42	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	944,198.43	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,200,000.00	1,842,671.86	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,722,771.47	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,100,000.00	1,643,742.19	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,820,000.00	2,008,478.89	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,093,312.50	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,059,033.39	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	927,270.31	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,500,000.00	1,061,191.41	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,058,847.66	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,438,232.41	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,540,000.00	1,171,061.72	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,554,765.62	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,780,000.00	1,384,158.59	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,482,187.50	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,288,959.37	
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,142,744.14	
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,921,359.38	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,214,095.69	
US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,488,371.07	
US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,603,132.79	
US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,310,175.77	
US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	1,982,434.57	
US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,143,722.66	
US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,327,675.77	
US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,246,581.04	

		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	1,353,315.81	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,696,523.43	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,875,048.84	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,807,859.37	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,247,031.24	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	844,101.56	
米ドル小計			602,450,000.00	522,985,723.54	(76,899,820,789)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	500,000.00	481,819.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/02/01	590,000.00	565,661.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	770,596.81	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	1,450,000.00	1,373,966.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,010,000.00	985,371.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-24/08/01	650,000.00	635,093.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	759,426.13	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	800,000.00	751,836.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	572,596.63	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	760,000.00	715,992.96	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	910,839.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,855,000.00	1,684,447.59	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	883,700.29	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	711,743.34	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,090,000.00	982,245.87	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	420,000.00	378,870.66	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	850,000.00	757,296.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	520,000.00	499,333.12	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	652,729.26	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	540,000.00	609,974.28	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	337,560.49	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	1,871,207.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,109,816.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,966,000.00	1,674,180.72	
CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,950,000.00	1,648,050.30			
CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	790,000.00	694,488.21			
CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	844,725.34			

		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	393,329.68	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	631,796.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	720,353.78	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	750,000.00	650,604.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,403,000.00	1,746,190.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	996,000.00	669,326.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	280,998.00	
加ドル小計			32,189,000.00	28,956,169.40	(3,148,404,298)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	12,100,000.00	11,771,031.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	18,900,000.00	18,167,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	16,700,000.00	16,621,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	21,408,203.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,950,000.00	3,353,796.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,600,000.00	18,903,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	16,670,000.00	15,638,543.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	21,800,000.00	19,211,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,300,000.00	4,521,562.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	3,900,000.00	3,928,031.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,970,000.00	11,462,237.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	13,200,000.00	10,683,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	11,165,565.62	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	2,800,000.00	2,285,500.00			
メキシコペソ小計			186,710,000.00	169,122,534.36	(1,271,513,950)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	117,716.22	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	845,000.00	851,221.73	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	670,000.00	649,063.17	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,265,000.00	1,219,888.83	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	718,497.28	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	852,000.00	813,496.41	

BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	771,630.25	
BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	438,396.75	
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,070,000.00	1,234,796.05	
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	879,828.13	
BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,060,000.00	951,316.08	
BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	661,367.73	
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	871,813.00	
BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	640,000.00	501,440.00	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	600,000.00	657,081.60	
BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	330,000.00	260,700.99	
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	695,000.00	597,125.93	
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	543,170.50	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,080,000.00	1,290,957.48	
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	341,069.72	
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	410,924.01	
BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	151,161.76	
BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	206,499.81	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,112,000.00	1,266,272.20	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	455,000.00	490,279.33	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	480,624.91	
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	473,710.25	
BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	318,722.60	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	341,162.36	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	389,286.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 71/10/31	345,000.00	168,748.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	995,000.00	1,015,160.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,015,000.00	1,045,589.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,250,000.00	1,276,160.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 24/05/31	1,000,000.00	964,816.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	1,100,000.00	1,062,804.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-	1,520,000.00	1,532,974.72	

24/10/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 25/01/31	1,350,000.00	1,281,757.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,350,000.00	1,324,972.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,490,000.00	1,578,330.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,455,000.00	1,444,027.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 26/01/31	1,315,000.00	1,211,314.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,055,000.00	1,034,066.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,360,000.00	1,523,240.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,720,000.00	1,637,288.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 27/01/31	325,000.00	289,958.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,401,533.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,315,000.00	1,202,108.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,400,000.00	1,314,159.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	1,010,000.00	871,088.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,270,000.00	1,176,700.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,275,000.00	1,176,450.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,095,000.00	1,227,197.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,545,000.00	1,823,659.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,445,000.00	1,320,296.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,140,000.00	972,327.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,400,000.00	1,167,138.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-	1,330,000.00	1,229,761.89	

30/07/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,530,000.00	1,333,537.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,155,000.00	897,057.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,045,000.00	827,576.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%- 32/04/30	1,340,000.00	1,063,558.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,450,000.00	1,761,428.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%- 32/10/31	645,000.00	601,737.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,235,000.00	1,127,128.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,195,000.00	998,822.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,250,000.00	1,348,357.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%- 37/07/30	670,000.00	459,229.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,045,000.00	1,226,032.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%- 40/10/31	1,000,000.00	677,815.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,265,000.00	1,454,288.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 42/07/30	300,000.00	191,034.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	930,000.00	1,141,840.98	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,060,000.00	937,620.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	985,000.00	827,260.13	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 50/10/31	1,170,000.00	629,381.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%- 52/10/31	560,000.00	372,777.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	848,000.00	787,592.72	
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,263,573.67	

BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,306,484.00	
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,237,309.77	
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	2,045,000.00	1,926,580.18	
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,491,518.40	
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,250,000.00	1,137,412.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	827,402.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,225,562.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,575,000.00	1,562,721.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,790,000.00	1,757,359.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	870,000.00	840,303.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	1,740,000.00	1,690,540.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,820,000.00	1,730,621.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,710,000.00	2,507,950.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,795,000.00	2,587,555.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	910,000.00	1,080,120.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,580,000.00	1,465,968.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,150,000.00	1,034,669.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	650,000.00	755,915.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,770,000.00	1,626,760.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,098,745.19	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,499,942.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,080,000.00	950,585.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,875,000.00	1,667,836.87	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,830,000.00	1,582,521.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	660,000.00	835,021.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,410,000.00	1,204,276.77
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,920,000.00	1,620,612.48
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	820,000.00	692,879.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,377,296.88
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	2,000,000.00	1,668,936.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	1,565,000.00	1,289,782.23
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	329,685.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	1,238,000.00	1,005,740.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%- 32/08/15	1,680,000.00	1,593,805.92
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,475,000.00	1,837,569.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	892,702.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	726,519.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,131,854.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	1,534,339.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,355,000.00	1,798,970.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,084,235.37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,635,000.00	1,679,292.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,197,000.00	2,271,577.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	1,637,122.44

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,330,000.00	721,515.69
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	348,164.27
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	750,000.00	390,301.50
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/12/15	900,000.00	880,416.00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-24/03/15	830,000.00	807,648.10
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.2%-24/06/14	760,000.00	737,770.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	174,242.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	911,943.14
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/15	1,110,000.00	1,075,012.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/30	250,000.00	241,905.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,686,897.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/04/15	1,360,000.00	1,307,865.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,059,774.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,180,000.00	1,160,023.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/08/15	570,000.00	542,229.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,250,000.00	1,269,647.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,226,036.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,080,000.00	1,070,594.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/12/15	650,000.00	611,868.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,400,438.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,606,428.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	855,000.00	819,925.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-	1,300,000.00	1,246,930.10

25/06/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	964,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,100,000.00	1,076,565.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,045,122.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	775,438.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,330,000.00	1,378,523.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,220,000.00	1,086,273.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,330,000.00	1,250,120.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,164,389.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	600,000.00	527,757.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	824,398.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	989,994.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,059,323.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	368,692.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,094,231.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	928,030.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,275,000.00	1,123,813.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,560,000.00	1,766,032.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,530,000.00	1,405,110.69	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,020,426.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,330,000.00	1,105,978.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-	1,330,000.00	1,395,619.54	

28/09/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,415,000.00	1,338,802.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	1,125,000.00	910,828.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,655,000.00	1,566,058.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,900,036.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,620,000.00	1,574,620.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	975,000.00	809,683.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	925,911.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,367,000.00	1,137,483.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,375,000.00	1,059,664.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,721,282.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,260,000.00	930,119.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	760,682.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,610,000.00	1,292,586.89	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	950,000.00	703,660.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,475,000.00	1,637,303.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	944,658.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	1,656,906.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	871,186.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	635,213.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	749,782.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-	2,005,000.00	1,910,205.60	

37/02/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	255,054.01
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	984,808.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,500,000.00	1,576,102.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	610,000.00	504,680.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,070,000.00	1,124,867.46
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	550,484.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,165,000.00	1,195,976.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	257,546.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,020,000.00	840,333.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	970,000.00	722,887.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	962,016.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	850,000.00	764,362.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	870,000.00	594,103.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	850,000.00	486,999.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 52/09/01	280,000.00	175,113.82
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	630,000.00	434,189.70
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	250,000.00	249,892.75
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	255,000.00	245,342.13
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	347,086.34
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	269,084.28
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	435,000.00	408,814.74
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	91,047.00
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	120,000.00	114,111.76
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	362,159.00

FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	382,142.51	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	239,020.84	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	322,434.07	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	138,705.10	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	535,000.00	454,236.93	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	125,000.00	99,040.15	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	110,000.00	96,843.91	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	266,357.16	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	189,633.91	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	162,326.75	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	259,427.12	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	210,000.00	130,294.15	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	192,670.66	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	118,057.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	206,765.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25	1,140,000.00	1,108,034.40	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,318,199.62	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,439,000.00	2,438,162.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,758,000.00	2,728,138.44	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	135,000.00	127,895.81	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,785,000.00	2,634,484.67	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,492,636.07	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,090,000.00	2,306,475.93	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,070,000.00	1,989,348.66	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,040,000.00	1,888,440.24	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	2,730,000.00	2,832,538.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,294,510.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	3,010,000.00	2,762,626.16	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	1,390,000.00	1,253,620.14	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,275,000.00	2,137,135.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,250,000.00	3,298,392.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,915,000.00	3,566,134.35	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,030,000.00	2,735,696.10	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	1,975,000.00	2,315,326.07	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,990,000.00	2,632,718.92	

FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,162,762.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,965,000.00	2,961,782.97	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,477,897.90	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,290,000.00	3,021,930.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,049,989.12	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	2,178,000.00	1,681,402.93	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,085,000.00	2,610,691.05	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	400,000.00	371,432.32	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,425,000.00	2,021,252.05	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,665,000.00	1,956,951.09	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,049,138.10	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,759,676.85	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,060,000.00	1,718,044.12	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,291,631.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	960,000.00	573,165.12	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,730,000.00	1,755,863.50	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,830,000.00	1,467,030.48	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,388,044.56	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	835,944.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	775,000.00	422,628.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,525,882.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,267,872.96	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	583,137.22	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	460,000.00	467,314.92	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	580,000.00	621,085.69	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	655,000.00	627,548.95	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	296,908.80	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	478,045.36	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	600,000.00	549,999.60	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	546,000.00	541,186.24	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	234,186.75	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	475,000.00	433,899.43	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	485,000.00	382,468.73	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	162,186.85	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	245,773.17	

IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	227,703.68
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	328,736.46
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	159,837.75
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	446,614.43
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	444,000.00	315,502.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	835,000.00	814,960.83
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	989,000.00	987,482.87
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,035,000.00	983,595.42
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	250,000.00	232,751.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,140,000.00	1,070,569.44
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	898,000.00	817,144.08
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	925,000.00	861,970.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	775,000.00	893,211.13
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	879,896.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	535,000.00	460,928.71
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	559,601.35
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	725,000.00	603,374.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	775,000.00	628,752.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	570,000.00	469,960.44
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	848,302.94
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,025,000.00	1,184,746.25
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	325,000.00	217,718.47
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	888,000.00	626,578.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,017,000.00	1,180,548.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,154,000.00	1,191,141.49
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	777,000.00	386,116.93
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	235,000.00	209,123.21
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	90,216.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	105,679.29
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	302,356.79
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	85,674.78
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	535,470.66
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	705,000.00	698,600.01
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	400,000.00	378,402.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	686,587.75

		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	594,516.45	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	140,000.00	137,722.19	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	963,000.00	902,151.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	626,118.08	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	540,000.00	628,278.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	600,330.06	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	140,000.00	119,510.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	885,000.00	772,133.29	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	555,866.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	525,604.36	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	400,000.00	333,832.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	485,000.00	455,190.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	185,958.45	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	942,352.32	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	200,051.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	403,307.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	373,492.59	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	170,000.00	135,752.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	405,000.00	236,095.96	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	190,000.00	222,780.30	
		ユーロ小計	364,988,000.00	339,641,328.93 (49,604,616,090)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	385,729.50	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	473,000.00	224,287.14	
		UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,230,000.00	1,186,833.88	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,030,000.00	1,000,634.70	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	869,583.75	
		UK TREASURY-0.25%-25/01/31	1,230,000.00	1,150,755.70	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,253,132.64	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	763,344.56	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	643,565.30	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	769,899.31	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,220,000.00	1,085,351.04	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	840,000.00	761,737.20	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	879,025.29	

UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	627,148.45	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	650,936.16	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	805,175.50	
UK TREASURY-0.5%-29/01/31	565,000.00	469,403.69	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	720,211.00	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	723,046.40	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,005,000.00	1,096,949.25	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,365,000.00	1,029,319.20	
UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,025,000.00	816,802.00	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,448,562.65	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	370,000.00	278,480.50	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	912,292.95	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,007,000.00	684,482.06	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	1,009,808.80	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	1,021,383.00	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,161,007.40	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,003,891.80	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	967,603.45	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	910,000.00	585,621.40	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,174,921.90	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	1,060,331.75	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,087,047.60	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	236,292.00	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	920,000.00	965,466.40	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,230,000.00	770,674.95	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	445,500.00	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	953,101.25	
UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	305,454.60	
UK TREASURY-1.25%-51/07/31	300,000.00	168,417.00	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	869,580.02	
UK TREASURY-1.5%-53/07/31	180,000.00	106,956.00	
UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	391,149.41	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	1,065,523.22	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	689,376.00	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	818,826.71	

		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	830,000.00	313,034.50	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	833,505.67	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	605,000.00	587,672.80	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	882,000.00	691,917.12	
英債券小計			45,810,000.00	40,520,754.57	(6,749,947,296)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,900,000.00	5,855,435.58	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,420,000.00	4,427,055.64	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,700,000.00	4,462,182.44	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,271,504.38	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,401,584.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,182,467.37	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,812,294.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,985,000.00	3,566,057.71	
スウェーデンクローナ小計			29,735,000.00	28,978,581.32	(389,761,918)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,820,000.00	3,802,406.76	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,190,000.00	3,073,284.28	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,590,538.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,245,620.96	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,340,000.00	2,177,721.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,250,000.00	2,023,366.05	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,150,000.00	2,714,304.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,705,295.16	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	1,900,000.00	1,702,940.74	
ノルウェークローネ小計			23,840,000.00	22,035,478.05	(314,886,981)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	3,190,000.00	3,171,376.78	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,260,000.00	1,204,169.40	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,270,000.00	3,214,099.35	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,310,000.00	3,914,875.57	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,830,000.00	2,458,774.75	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,150,000.00	908,383.85	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,250,000.00	11,510,318.90	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	695,253.52	

デンマーククローネ小計			26,560,000.00	27,077,252.12 (531,526,459)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	1,955,948.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-24/07/25	310,000.00	270,599.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,980,000.00	1,774,891.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,209,211.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,570,000.00	2,259,852.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,590,000.00	2,111,445.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,433,679.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	810,000.00	672,567.30	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,666,824.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,655,877.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	488,150.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	1,916,001.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,226,745.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,500,000.00	881,415.00	
ポーランドズロチ小計			24,805,000.00	19,523,209.50 (607,730,179)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	755,000.00	750,560.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,715,000.00	1,613,730.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	999,006.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	865,636.93	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,130,000.00	1,161,762.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,310,000.00	1,172,243.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,170,000.00	1,231,896.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	945,471.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	850,000.00	794,174.31	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	686,495.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	930,000.00	908,902.03	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	838,492.67	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,300,000.00	1,195,353.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,180,000.00	952,308.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,378,000.00	1,146,406.37	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,790,000.00	1,407,246.57	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,256,569.49			

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,270,000.00	1,049,862.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,092,501.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	790,000.00	727,180.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	464,792.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	722,988.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	518,677.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	642,062.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	587,199.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	608,617.92	
豪ドル小計			27,115,000.00	24,340,140.20	(2,302,820,664)
ニュー ジーラン ドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-24/05/15	500,000.00	470,199.62	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	590,000.00	565,020.46	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	698,471.83	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	622,972.95	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	275,968.92	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	300,000.00	274,287.26	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	380,000.00	301,576.34	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	341,049.06	
ニュージーランドドル小計			4,000,000.00	3,549,546.44	(307,355,226)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	140,000.00	135,959.22	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	505,000.00	497,324.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	538,660.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	470,000.00	461,822.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	229,000.00	211,916.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	453,221.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	205,000.00	189,830.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	537,317.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	279,125.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	450,000.00	434,700.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	518,400.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	258,961.49	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	120,000.00	111,538.99	
SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	351,982.50			

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	434,662.59	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	190,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	287,000.00	262,576.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	332,000.00	305,108.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	278,553.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	169,266.12	
シンガポールドル小計			7,076,000.00	6,621,224.91	(691,653,154)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	773,287.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	836,088.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	620,000.00	619,283.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,550,000.00	1,547,930.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	773,467.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,070,000.00	1,058,957.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	920,000.00	907,874.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,274,070.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	851,168.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	697,631.41	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,014,227.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	915,201.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,170,000.00	1,183,273.65	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	593,820.78	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,290,936.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	200,000.00	196,745.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	660,579.54	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	600,358.26	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	503,896.43	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,560,000.00	1,345,437.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	800,000.00	807,076.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	750,000.00	758,067.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	330,000.00	326,590.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	922,469.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,620,000.00	1,564,733.70			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	912,615.06			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,015,873.99			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	916,945.20	
マレーシアリングット小計			25,785,000.00	24,868,606.03	(770,610,955)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	12,000,000.00	12,130,440.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	14,000,000.00	14,274,820.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	11,000,000.00	11,083,230.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	8,000,000.00	8,138,472.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	13,000,000.00	12,931,152.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	13,000,000.00	12,974,656.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	9,000,000.00	9,203,323.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	12,000,000.00	12,289,254.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	14,000,000.00	14,146,090.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	8,000,000.00	8,224,732.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	22,000,000.00	22,358,336.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	5,000,000.00	5,195,540.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	12,000,000.00	12,280,968.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	8,000,000.00	8,138,988.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,612,227.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	5,000,000.00	4,972,685.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	11,000,000.00	10,954,531.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	8,000,000.00	8,359,672.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	5,000,000.00	5,111,082.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	8,000,000.00	7,986,879.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	6,000,000.00	6,006,420.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	3,000,000.00	2,991,258.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	8,000,000.00	8,936,508.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	6,000,000.00	6,616,869.00			
CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	7,000,000.00	7,485,248.40			
CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	7,000,000.00	7,239,113.00			
中国元小計			249,000,000.00	254,642,497.00	(5,209,628,989)
イスラエル スケジュール	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	760,000.00	746,629.10	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,428,041.37	
		ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	280,000.00	264,283.55	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,267,738.90	

	ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,185,672.92	
	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	482,790.47	
	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,051,148.17	
	ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,201,103.03	
	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,040,000.00	979,872.77	
	ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,286,676.01	
	ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	150,000.00	125,922.67	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	821,978.61	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,490,753.96	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,340,233.96	
イスラエルシュケル小計		14,025,000.00	13,672,845.49 (567,309,603)	
合計			149,367,586,551 (149,367,586,551)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 214銘柄	100.0%	51.4%
加ドル	国債証券 34銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 337銘柄	100.0%	33.2%
英ポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	4.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
豪ドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 26銘柄	100.0%	3.5%

イスラエルシュケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.4%
-----------	------	------	--------	------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年11月30日現在です。

【DCインデックスバランス(株式80)】

【純資産額計算書】

資産総額	15,405,475,193円
負債総額	27,986,985円
純資産総額(-)	15,377,488,208円
発行済口数	4,641,187,577口
1口当たり純資産額(/)	3.3133円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	45,156,393,652円
負債総額	132,931,656円
純資産総額(-)	45,023,461,996円
発行済口数	22,733,814,878口
1口当たり純資産額(/)	1.9805円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	260,893,922,068円
負債総額	1,569,212,923円
純資産総額(-)	259,324,709,145円
発行済口数	59,856,756,163口
1口当たり純資産額(/)	4.3324円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	48,641,484,018円
負債総額	252,428,210円
純資産総額（ - ）	48,389,055,808円
発行済口数	35,620,069,891口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3585円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	150,191,087,030円
負債総額	468,743,309円
純資産総額（ - ）	149,722,343,721円
発行済口数	57,802,413,205口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5902円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2022年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2022年11月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2022年11月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2022年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	860	239,232
株式投資信託	801	203,127
単位型	315	9,875
追加型	486	193,252
公社債投資信託	59	36,104
単位型	46	1,194
追加型	13	34,910

3【委託会社等の経理状況】

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

また、当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則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第64期中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第62期 (2021年3月31日)		第63期 (2022年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,698		42,427
有価証券		17		170
前払費用		785		932
未収入金		225		96
未収委託者報酬		24,738		25,193
未収収益	3	891	3	1,048
関係会社短期貸付金		2,403		5,005
立替金		930		1,056
その他	2	361	2	998
流動資産合計		55,053		76,928
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	245	1	244
器具備品	1	190	1	153
有形固定資産合計		436		397
無形固定資産				
ソフトウェア		241		335

無形固定資産合計	241	335
投資その他の資産		
投資有価証券	22,903	23,969
関係会社株式	25,987	22,366
長期差入保証金	678	652
繰延税金資産	1,845	3,678
投資その他の資産合計	51,414	50,667
固定資産合計	52,092	51,399
資産合計	107,145	128,328

(単位：百万円)

	第62期 (2021年3月31日)		第63期 (2022年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		844		651
未払金		9,834		9,693
未払収益分配金		8		7
未払償還金		71		71
未払手数料		8,956		8,783
その他未払金		798		831
未払費用	3	4,660	3	5,572
未払法人税等		1,090		2,354
未払消費税等	4	775	4	3,669
賞与引当金		3,034		3,958
役員賞与引当金		55		5
訴訟損失引当金		-		7,847
その他		643		1,330
流動負債合計		20,938		35,083
固定負債				
退職給付引当金		1,456		1,395
賞与引当金		156		423
その他		544		390
固定負債合計		2,157		2,209
負債合計		23,095		37,292
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		61,956		68,901
利益剰余金合計		61,956		68,901
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		82,472		89,417
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		1,461		2,350

繰延ヘッジ損益	115	731
評価・換算差額等合計	1,577	1,618
純資産合計	84,049	91,035
負債純資産合計	107,145	128,328

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	78,975	94,938
その他営業収益	3,973	4,743
営業収益合計	82,948	99,682
営業費用		
支払手数料	34,050	42,026
広告宣伝費	953	987
公告費	1	1
調査費	17,813	23,000
調査費	966	1,042
委託調査費	16,825	21,932
図書費	22	25
委託計算費	545	598
営業雑経費	1,053	1,014
通信費	174	143
印刷費	331	308
協会費	51	52
諸会費	11	13
その他	483	494
営業費用計	54,419	67,628
一般管理費		
給料	10,383	11,759
役員報酬	243	156
役員賞与引当金繰入額	55	5
給料・手当	6,766	7,229
賞与	159	143
賞与引当金繰入額	3,158	4,225
交際費	14	22
寄付金	30	29
旅費交通費	57	66
租税公課	485	429
不動産賃借料	939	937
退職給付費用	388	394
退職金	10	169
固定資産減価償却費	138	172
福利費	1,084	1,171
諸経費	4,286	3,888
一般管理費計	17,817	19,042
営業利益	10,711	13,010

(単位：百万円)

	第62期		第63期	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		75		71
受取配当金	1	2,555	1	5,257
有価証券償還益		14		-
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		-		1,548
その他		62		58
営業外収益合計		2,710		6,936
営業外費用				
支払利息		122		177
デリバティブ費用		804		49
時効成立後支払分配金・償還金		25		9
為替差損		59		-
その他		42		39
営業外費用合計		1,054		275
経常利益		12,367		19,672
特別利益				
投資有価証券売却益		774		253
子会社有償減資払戻益		-		1,445
その他		0		-
特別利益合計		774		1,699
特別損失				
投資有価証券売却損		237		132
投資有価証券評価損		5		-
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		125		-
訴訟損失引当金繰入額		-		7,847
特別損失合計		369		7,980
税引前当期純利益		12,773		13,391
法人税、住民税及び事業税		3,722		3,435
法人税等還付税額		-	2	329
法人税等調整額		373		1,851
法人税等合計		3,348		1,255
当期純利益		9,424		12,136

(3) 【株主資本等変動計算書】

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073
当期変動額							

剰余金の配当				2,862	2,862		2,862
当期純利益				9,424	9,424		9,424
自己株式の取得						1,161	1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,561	6,561	1,161	5,399
当期末残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	60	389	329	77,402
当期変動額				
剰余金の配当				2,862
当期純利益				9,424
自己株式の取得				1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,521	273	1,247	1,247
当期変動額合計	1,521	273	1,247	6,647
当期末残高	1,461	115	1,577	84,049

第63期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,944	6,944	-	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	889	847	41	41
当期変動額合計	889	847	41	6,985
当期末残高	2,350	731	1,618	91,035

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)					
	1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物 附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>		建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年					
器具備品	3年～20年					
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 訴訟損失引当金 訴訟による損失に備えるため、損失見込額を計上しております。</p>					

4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務</p> <p>当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務</p> <p>当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬</p> <p>当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法</p> <p>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p> <p>ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理</p> <p>資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

<p>第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)</p>
<p>(収益認識に関する会計基準の適用)</p> <p>「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。</p> <p>収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。収益認識会計基準等の適用による、当財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>(時価の算定に関する会計基準の適用)</p> <p>「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、当財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては、記載しておりません。</p>

（未適用の会計基準等）

- ・ 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）
- (1) 概要
投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。
 - (2) 適用予定日
2023年3月期の期首より適用予定であります。
 - (3) 当該会計基準等の適用による影響
当該適用指針の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

（重要な会計上の見積り）

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

- 1 当事業年度の財務諸表に計上した金額
訴訟損失引当金を7,847百万円計上しております。
- 2 会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報
 - (1) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出方法
訴訟について将来発生しうる損失の見込額を算出し、訴訟損失引当金として計上しています。
 - (2) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出に用いた主要な仮定
原告が主張する損害額に基づき、将来発生することが予想される損失の見積を行っています。
 - (3) 翌事業年度の財務諸表に与える影響
当社では、現在までに想定しうる最善の仮定に基づき訴訟損失引当金を計上しておりますが、今後の経過により、翌事業年度において訴訟損失引当金の追加計上または取り崩しを行う可能性があります。

（貸借対照表関係）

第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,349百万円 器具備品 764百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,390百万円 器具備品 823百万円
2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 257百万円 (流動負債) 未払費用 1,247百万円	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 233百万円 (流動負債) 未払費用 2,314百万円
4 消費税等の取扱い 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。	4 消費税等の取扱い 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。
	5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエ クイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・ リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻 請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マ ネジメント・リミテッドは最大5百万豪ドルを提供 する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタ ル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供 義務を保証しております。

（損益計算書関係）

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 2,498百万円	1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 5,194百万円 2 法人税等還付税額 過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を計上しています。

(株主資本等変動計算書関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,454,500	1,405,500	-	2,860,000

(変動事由の概要)

2020年3月25日の取締役会決議による自己株式の取得	594,300株
2020年7月17日の取締役会決議による自己株式の取得	811,200株

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2011年度ストックオプション(1)	普通株式	1,184,700	-	752,400	432,300	-
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	1,346,000	-	330,000	1,016,000	-
2016年度ストックオプション(2)	普通株式	2,394,000	-	622,000	1,772,000	-
2017年度ストックオプション(1)	普通株式	2,939,000	-	332,000	2,607,000	-
合計		7,863,700	-	2,036,400	5,827,300	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)432,300株、2016年度ストックオプション(1)1,016,000株、2016年度ストックオプション(2)1,088,000株及び2017年度ストックオプション(1)874,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(2)684,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,733,000株は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29日

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	432,300	-	432,300	-	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,016,000	-	928,000	88,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,772,000	-	956,000	816,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,607,000	-	1,071,000	1,536,000	-
合計		5,827,300	-	3,387,300	2,440,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2016年度ストックオプション(1)88,000株、2016年度ストックオプション(2)816,000株及び2017年度ストックオプション(1)847,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2017年度ストックオプション(1)689,000株は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年5月25日 取締役会	普通株式	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

(リース取引関係)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円	1年内	911百万円
1年超	5,236百万円	1年超	4,324百万円
合計	6,148百万円	合計	5,236百万円

(金融商品関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネへの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,698	24,698	-
(2) 未収委託者報酬	24,738	24,738	-
(3) 未収収益	891	891	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,403	2,403	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,905	22,905	-
(6) 未払金	(9,834)	(9,834)	-
(7) 未払費用	(4,660)	(4,660)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(188)	(188)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(453)	(453)	-

デリバティブ取引計	(642)	(642)	-
-----------	-------	-------	---

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

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

- (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
- (5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。
- (6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
- (8) デリバティブ取引
(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式(貸借対照表計上額23,094百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,698	-	-	-
未収委託者報酬	24,738	-	-	-
未収収益	891	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	17	812	10,348	20
合計	50,346	812	10,348	20

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

(有価証券関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	16,914	14,476	2,438
	小計	16,914	14,476	2,438
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,990	6,322	332
	小計	5,990	6,322	332
合計		22,905	20,799	2,105

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について5百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	5,735	774	237
合計	5,735	774	237

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,188	3,369	180
	小計	3,188	3,369	180
合計		24,123	20,735	3,387

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,079	253	132
合計	3,079	253	132

(デリバティブ取引関係)

第62期(2021年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,670	-	75	75
	買建	-	-	-	-
合計		2,670	-	75	75

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,713	-	112	112
合計		1,713	-	112	112

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,620	-	273
	香港ドル		862	-	57
	人民元		1,684	-	117
	ユーロ		180	-	5
合計			7,347	-	453

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第63期(2022年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,306	-	262	262
	買建	-	-	-	-
合計		2,306	-	262	262

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	4,708	-	293	293
合計		4,708	-	293	293

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		5,445	-	367
	豪ドル		222	-	20
	香港ドル		1,097	-	59
	人民元		5,185	-	324
	ユーロ		35	-	0
	合計		11,986	-	772

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964

(退職給付関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,363
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	6
退職給付の支払額	86
退職給付債務の期末残高	1,429

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

退職給付債務	1,429
未積立退職給付債務	1,429
未認識数理計算上の差異	27
貸借対照表に計上された負債の額	1,456
退職給付引当金	1,456

貸借対照表に計上された負債の額	1,456
-----------------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	2
確定給付制度に係る退職給付費用	147

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.2%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)	
退職給付債務の期首残高	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	211
退職給付債務の期末残高	1,352

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

退職給付債務	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
貸借対照表に計上された負債の額	1,395
退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.3%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	1,184,700	1,346,000
付与	0	0
失効	752,300	330,000
権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	2,394,000	2,939,000
付与	0	0
失効	622,000	332,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,772,000	2,607,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,738百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	88,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,222百万円
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割
 又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日
 において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の 内訳 (単位:百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の 内訳 (単位:百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 929	賞与引当金 1,341
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 97
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 446	退職給付引当金 427
固定資産減価償却費 90	固定資産減価償却費 87
その他 978	繰延ヘッジ損益 322
繰延税金資産小計 3,972	訴訟損失引当金 2,403
評価性引当金 1,430	その他 1,039
繰延税金資産合計 2,541	繰延税金資産小計 5,772
繰延税金負債	評価性引当金(注) 52
繰延ヘッジ利益 51	繰延税金資産合計 5,719
その他有価証券評価差額金 645	繰延税金負債
繰延税金負債合計 696	その他有価証券評価差額金 1,092
繰延税金資産の純額 1,845	その他 948
	繰延税金負債合計 2,041
	繰延税金資産の純額 3,678

(注) 関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した
 評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円
 減少しております。

2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率 (調整)	30.6%	法定実効税率 (調整)	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	10.9%
その他	1.0%	評価性引当金の減少	10.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%	その他	0.1%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	9.4%

(関連当事者情報)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール	342,369 (SGD千)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	-	資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	-	配当の受取	1,783 (USD 17,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR千)	アセット マネジメント 業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- Nikko Asset Management Luxembourg S.A.の行った70,000株の新株発行増資を、1株につき25ユーロで当社が引き受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2020年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	30,151百万円
負債合計	5,919百万円
純資産合計	24,231百万円
営業収益	19,946百万円
税引前当期純利益	7,020百万円
当期純利益	5,194百万円

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	2,019 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86千)
							資金の返済(円貸建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(円貸建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	2,788 (SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	2,985 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	23 (SGD 266千)	未収収益	23 (SGD 266千)
減資(注2)	9,149 (SGD 110,000千)	-	-							
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注3)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	3,788 (USD 34,000千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った110,000千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,450百万円
------	-----------

負債合計	6,257百万円
純資産合計	28,192百万円
営業収益	18,176百万円
税引前当期純利益	5,587百万円
当期純利益	3,956百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

関連情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

項目	第62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	432円90銭	468円88銭
1株当たり当期純利益金額	48円45銭	62円50銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,424	12,136
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	9,424	12,136
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,509	194,152

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション (1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株	2016年度ストックオプション (1) 88,000株、2016年度ストックオプション(2) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000株
--	---	--

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	84,049	91,035
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	84,049	91,035
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	194,152	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第64期中間会計期間 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		33,164
有価証券		481
未収委託者報酬		16,607
未収収益		1,063
関係会社短期貸付金		3,335
その他	2	3,967
流動資産合計		58,620
固定資産		
有形固定資産	1	404
無形固定資産		353
投資その他の資産		
投資有価証券		23,904
関係会社株式		22,366
長期差入保証金		416
繰延税金資産		4,029
投資その他の資産合計		50,718
固定資産合計		51,476
資産合計		110,097

(単位：百万円)

第64期中間会計期間
(2022年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,815
未払費用	3,556
未払法人税等	3,271
未払消費税等	3
賞与引当金	1,924
役員賞与引当金	110
その他	1,258
流動負債合計	18,282
固定負債	
退職給付引当金	1,445
賞与引当金	321
役員賞与引当金	16
その他	119
固定負債合計	1,903
負債合計	20,186
純資産の部	
株主資本	
資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	68,572
利益剰余金合計	68,572
自己株式	2,067
株主資本合計	89,088
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,064
繰延ヘッジ損益	1,242
評価・換算差額等合計	822
純資産合計	89,911
負債純資産合計	110,097

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第64期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	38,118
その他営業収益	1,728
営業収益合計	39,846

営業費用及び一般管理費	1	34,563
営業利益		5,283
営業外収益	2	1,046
営業外費用	3	516
経常利益		5,813
特別利益	4	4,602
特別損失	5	137
税引前中間純利益		10,277
法人税等	6	3,185
中間純利益		7,091

(3) 中間株主資本等変動計算書

第64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417
当中間期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
中間純利益				7,091	7,091		7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	328	328	-	328
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	68,572	68,572	2,067	89,088

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,350	731	1,618	91,035
当中間期変動額				
剰余金の配当				7,420
中間純利益				7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	285	510	795	795
当中間期変動額合計	285	510	795	1,124
当中間期末残高	2,064	1,242	822	89,911

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
----	---

1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(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(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行業務の内容及び当該履行業務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p>

5 ヘッジ会計の方法	<p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 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>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(会計方針の変更)

<p>第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用) 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過措置に従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、当中間財務諸表に与える影響は軽微であります。</p>

(表示方法の変更)

<p>第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)</p>
<p>(損益計算書) その他有価証券の為替リスクヘッジに係るヘッジ損益について、ヘッジ対象の損益認識時に繰延ヘッジ損益を純損益に計上するに当たり、前中間会計期間において、「営業外費用」に含めていましたが、金額的重要性が高まったことから、ヘッジの効果をより明瞭に表示するため当中間会計期間よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である特別利益あるいは特別損失として表示することとしております。</p>

(中間貸借対照表関係)

<p>第64期中間会計期間 (2022年9月30日)</p>	
1 有形固定資産の減価償却累計額	2,264百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

3 消費税等の取扱い

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。

4 保証債務

ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大470百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

（中間損益計算書関係）

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	50百万円
無形固定資産	37百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	40百万円
受取配当金	131百万円
デリバティブ収益	685百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	156百万円
為替差損	351百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	120百万円
訴訟損失引当金戻入額	4,481百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	137百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	

2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	88,000	-	88,000	-	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	816,000	-	599,000	217,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	-	667,000	869,000	-
合計		2,440,000	-	1,354,000	1,086,000	-

(注) 1 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)869,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年5月27日 取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	910百万円
1年超	3,870百万円
合計	4,780百万円

(金融商品関係)

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

有価証券 その他有価証券 投資信託	4,796	19,572	-	24,369
資産計	4,796	19,572	-	24,369
デリバティブ取引(1、2)				
株式関連	666	-	-	666
通貨関連	-	626	-	626
デリバティブ取引計	666	626	-	39

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、
で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち666百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち626百万円は、流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資 産

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(有価証券関係)

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(注)子会社株式及び関連会社株式は市場価格がない株式等であり、(金融商品関係)金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項(注2)に記載のとおりであります。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	17,633	13,768	3,865
	小計	17,633	13,768	3,865
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	6,735	7,625	889
	小計	6,735	7,625	889
合計		24,369	21,393	2,976

(注) 1 減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額16百万円)については、市場価格がない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	7,428	-	666	666
合計		7,428	-	666	666

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

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 シンガポール ドル	3,222	-	98	98
合計		3,222	-	98	98

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,241	-	357
	豪ドル		193	-	0
	ユーロ		319	-	8
	香港ドル		976	-	68
	人民元		6,254	-	94
合計			13,984	-	528

（持分法損益等）

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,327百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,684百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,341百万円

（収益認識関係）

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

- 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針 4. 収益の計上基準」に記載のとおりです。
- 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

〔関連情報〕

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

- 製品及びサービスごとの情報
当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。
- 地域ごとの情報
 - 営業収益
国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。
 - 有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。
- 主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
1株当たり純資産額	463円09銭
1株当たり中間純利益金額	36円52銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益(百万円)	7,091
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,091
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(2)217,000株、 2017年度ストックオプション(1)869,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期中間会計期間 (2022年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	89,911
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	89,911
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

- (3) 通常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(4)、(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,450,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
富国生命保険相互会社	128,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	

信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
--------	-----------------------	--------------------------

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

(3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

(4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

(5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

(6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

(7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、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、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

2022年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月25日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式80）の2021年11月9日から2022年11月7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。

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、DCインデックスバランス（株式80）の2022年11月7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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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。

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、日興アセットマネジメント株式会社の2022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（2022年4月1日から2022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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる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。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、

継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。