

【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】	2021年9月15日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 佐谷戸 淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「世界の財産3分法ファンド」、「世界の財産3分法」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2021年9月16日から2022年3月15日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券および不動産投信に投資を行いません。

よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年12回(毎月)

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

- 国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

- 投資信託証券(マザーファンド)への投資を通じて、原則として国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。

3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。
- 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行なわない場合があります。



「財産3分法」とは？

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行います。

〔世界の財産3分法ファンド〕
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス
(円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2021年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

各資産の値動きの特徴

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

※価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

ご参考: 設定来のファンドと各資産の推移 (マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)～2021年6月、月末値)



※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

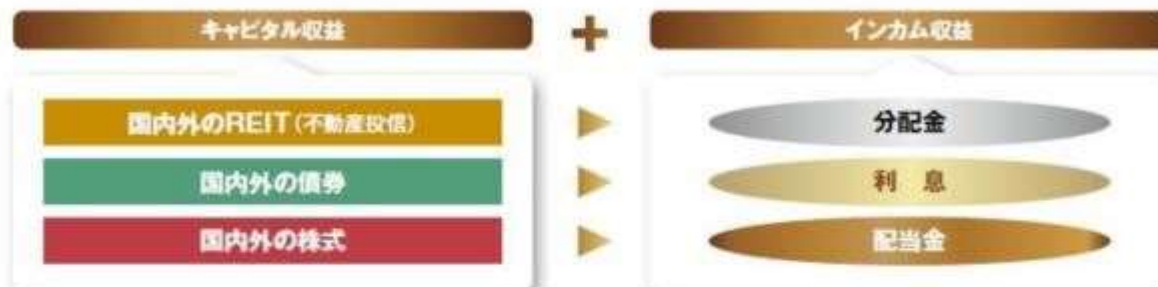
※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。

※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



インカム収益(投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など)に加え、キャピタル収益(投資した資産自体の値上がり益)を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行わない場合があります。



ご参考:各指数の利回り

(2021年6月末現在)



- ◆ REIT: 実績分配金利回り
国内: 東証REIT指数(配当込み)
海外: S&P先進国REIT指数(除く日本)
 - ◆ 債券: 最終利回りなど
国内: NOMURA-BPI総合
海外: FTSE世界国債インデックス(除く日本)
 - ◆ 株式: 実績配当利回りなど
国内: TOPIX(東証株価指数)
海外: MSCI-KOKUSAIインデックス
- ※利回りは切り捨てにて端数処理しています。

※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。

※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数(配当込み)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **NOMURA-BPI総合** 同指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- **FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)** 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- **TOPIX(東証株価指数)** TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス(円ヘッジなし・円ベース)** 同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

■ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

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

(分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

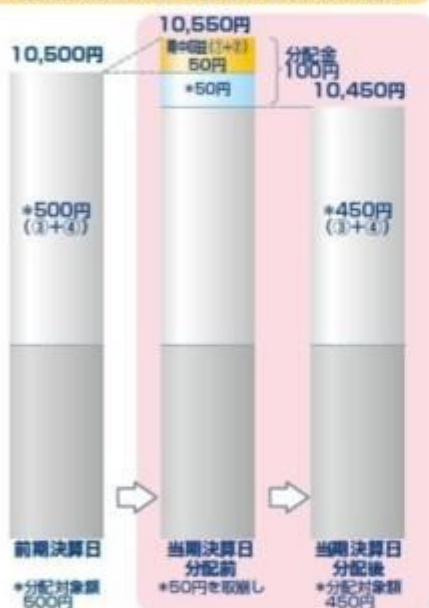
投資信託で分配金が支払われるイメージ



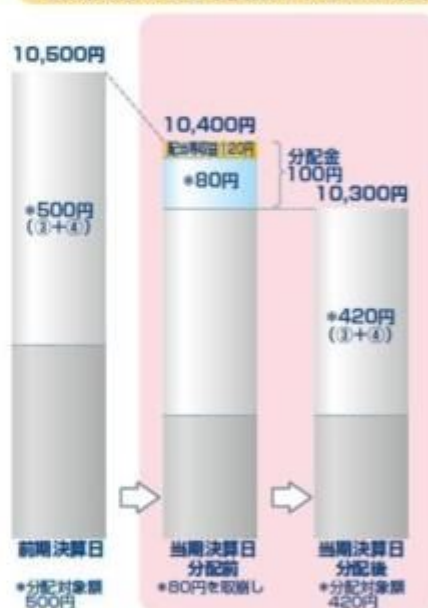
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

- ・普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
- ・元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、(特別分配金)元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

信託金限度額

- ・30兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2)【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

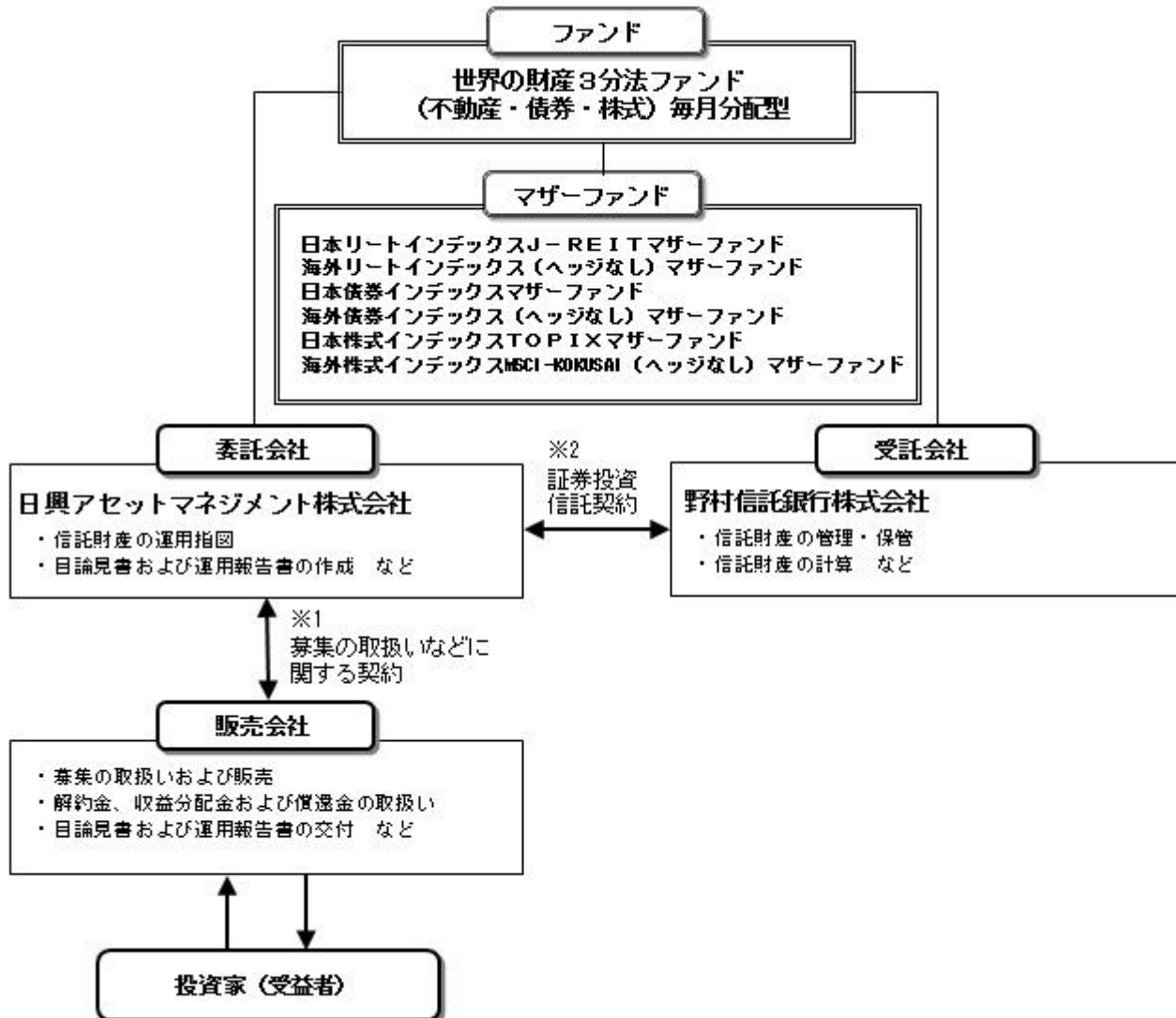
・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

（3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。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の。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（2021年6月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。
 - 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
- ・特に「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低い場合、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

- <世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>
- 投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
 - 2) 証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 6) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 7) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
 - 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
 - 10) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの

11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。

- 1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 3) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。

- 1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 4) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券

以外のもの

- 5) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引

- 3) 金利先渡取引
- 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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 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せん。）
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・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"> ・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・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（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

* 東証REIT指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄に投資した場合の投資成果(市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果)を表す指数です。東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社東京証券取引所に帰属します。また、株式会社東京証券取引所は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)の投資信託証券(以下「不動産投資信託証券」といいます。)に投資を行ない、S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S&P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動した投資成果をめざします。 不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。 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"> 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 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（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

* S & P先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エルエルシー（S & P社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 [*] 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。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 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、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行され

た円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限定されます。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] 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。 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。

< 日本株式インデックス T O P I X 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、T O P I X（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、T O P I X（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。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 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、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象

除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。)の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

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

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

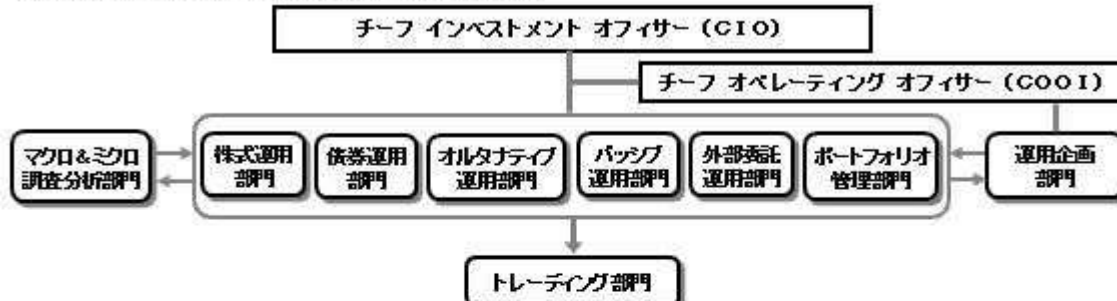
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーフンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有し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。

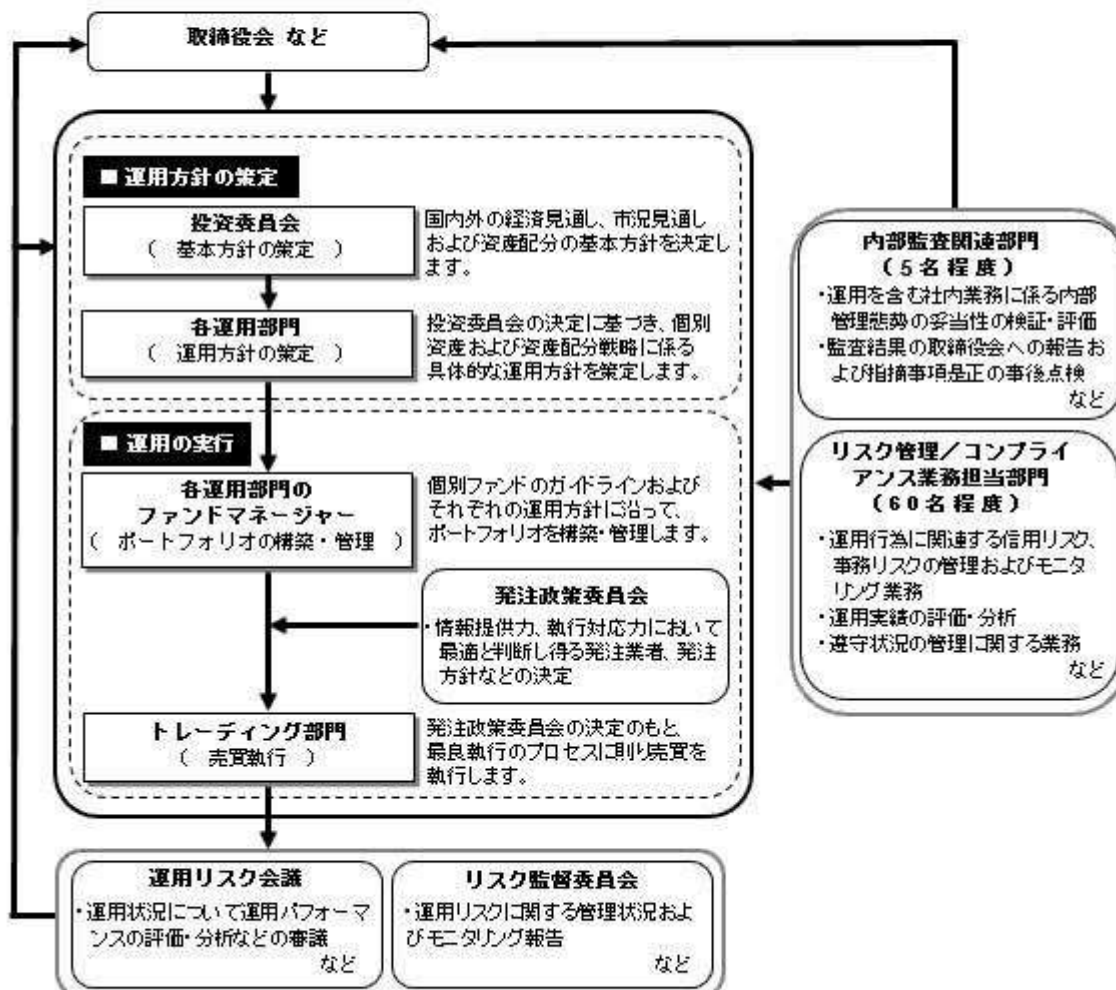
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、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2021年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<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) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないませ

ん。

- 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本リートインデックスJ - REITマザーファンド>

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

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

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

<日本株式インデックストップIXマザーファンド>

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

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

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

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

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

可能なものについてはこの限りではありません。

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・ 一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格に影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。
- ・ 一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・ 一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおい

ては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

諸事情により、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

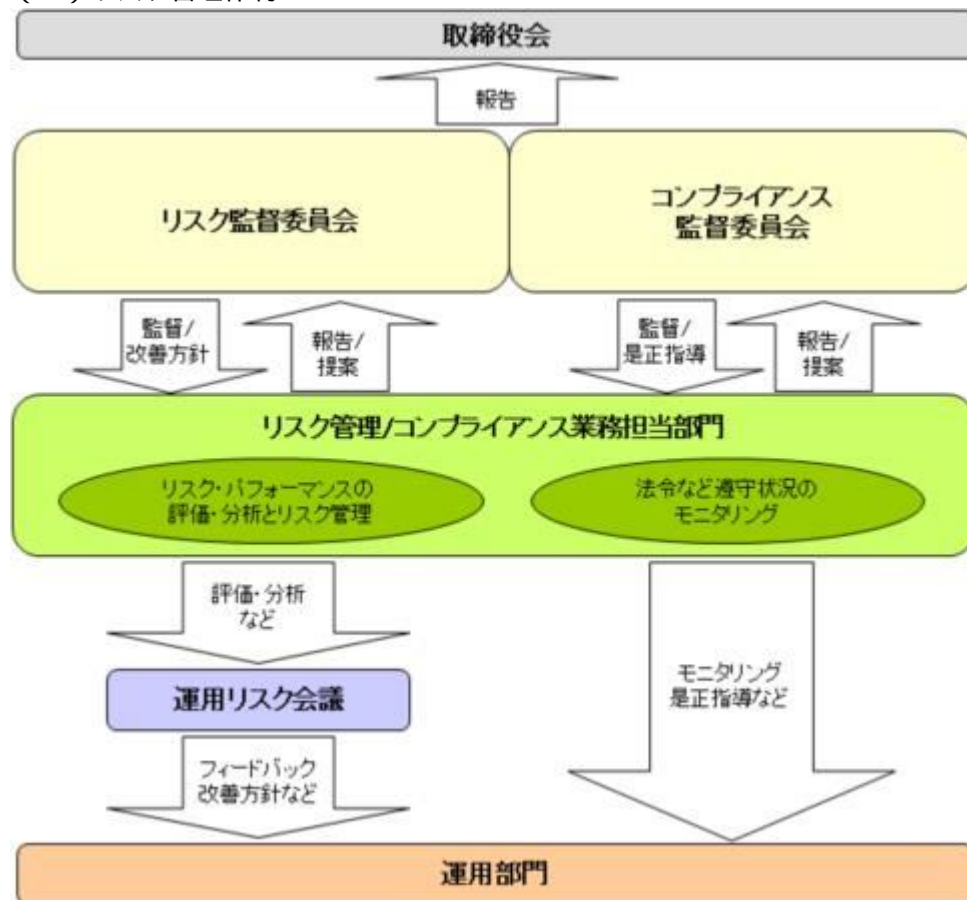
・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

基準価額が大きく変動する可能性があります。

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

(2) リスク管理体制



全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているなどのモニタリングを行なっています。

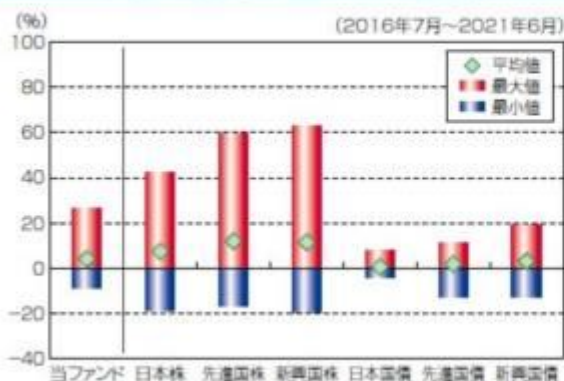
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2021年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	4.1%	7.5%	12.0%	11.5%	0.7%	2.0%	3.1%
最大値	26.2%	42.1%	59.8%	62.7%	8.0%	11.4%	19.3%
最小値	-8.7%	-18.6%	-16.9%	-19.4%	-4.0%	-12.3%	-12.9%

※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2016年7月から2021年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%(税抜3%)が上限となっております。
- ・申込手数料の額(1口当たり)は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・<分配金再投資コース>の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.045%(税抜0.95%)の率を乗じて得た額とします。

この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.95%	0.40%	0.50%	0.05%

委託会社	委託した資金の運用の対価
------	--------------

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかるとみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

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

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。

目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

ファンドの主要投資対象の1つである「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数（配当込み）」その他これに類する標章の使用料。

ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」

その他これに類する標章の使用料。

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができ

ないため、表示することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）^{*}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）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

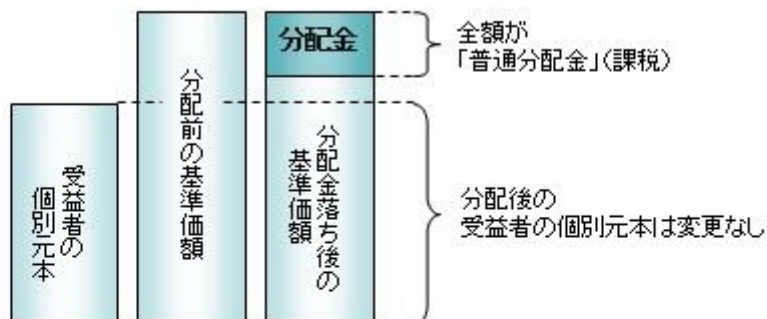
2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

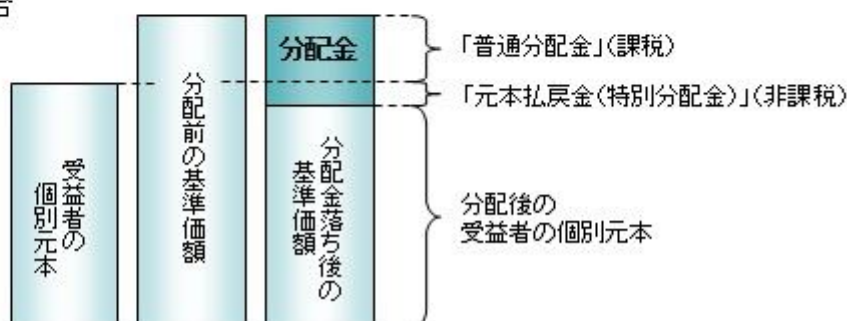
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2021年9月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2021年6月30日現在です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	34,225,874,291	97.98
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		705,498,415	2.02
合計(純資産総額)		34,931,372,706	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-K OKUSA I (ヘッジなし) マザー ファンド	1,522,381,851	3.7713	5,741,358,675	3.7981	5,782,158,508	16.55
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REIT Tマザーファンド	2,131,460,861	2.6870	5,727,362,344	2.6939	5,741,942,413	16.44
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファン ド	4,037,934,675	1.4138	5,709,210,168	1.4124	5,703,178,934	16.33
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジな し) マザーファンド	2,236,638,529	2.5617	5,729,690,277	2.5439	5,689,784,753	16.29
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマ ザーファンド	3,029,831,995	1.8995	5,755,336,405	1.8712	5,669,421,629	16.23
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジな し) マザーファンド	2,219,095,760	2.6108	5,793,831,560	2.5413	5,639,388,054	16.14

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.98
合計	97.98

【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13特定期間末 (2011年12月15日)	59,790	60,171	0.4709	0.4739
第14特定期間末 (2012年 6月15日)	55,918	56,146	0.4910	0.4930
第15特定期間末 (2012年12月17日)	55,668	55,874	0.5402	0.5422
第16特定期間末 (2013年 6月17日)	57,765	57,856	0.6378	0.6388
第17特定期間末 (2013年12月16日)	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18特定期間末 (2014年 6月16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19特定期間末 (2014年12月15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20特定期間末 (2015年 6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末 (2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末 (2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779

第23特定期間末	(2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末	(2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末	(2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末	(2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末	(2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末	(2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末	(2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末	(2020年 6月15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31特定期間末	(2020年12月15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32特定期間末	(2021年 6月15日)	34,941	34,975	1.0217	1.0227
	2020年 6月末日	29,760		0.8350	
	7月末日	29,866		0.8369	
	8月末日	30,880		0.8674	
	9月末日	30,442		0.8558	
	10月末日	29,515		0.8325	
	11月末日	30,927		0.8842	
	12月末日	31,348		0.9024	
	2021年 1月末日	31,364		0.9130	
	2月末日	31,708		0.9346	
	3月末日	32,524		0.9749	
	4月末日	33,152		0.9886	
	5月末日	33,962		0.9984	
	6月末日	34,931		1.0145	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	0.0180
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	0.0130
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	0.0120
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	0.0070
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060

第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	0.0060

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	9.91
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	7.03
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	12.46
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	19.36
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	8.10
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	7.91
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	15.38

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第13特定期間	2011年 6月16日～2011年12月15日	1,137,780,912	15,842,664,215
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	787,842,918	13,892,127,349
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	645,492,480	11,463,657,624

第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	755,347,566	13,250,917,932
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	2,277,192,099	2,890,774,812

（参考）

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2021年 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	79,819,740,630	98.73
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,026,624,440	1.27
合計（純資産総額）		80,846,365,070	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	7,739	731,000	5,657,209,000	693,000	5,363,127,000	6.63
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,876	695,000	4,778,820,000	683,000	4,696,308,000	5.81

日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	34,251	117,200	4,014,217,200	120,400	4,123,820,400	5.10
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	21,487	189,300	4,067,489,100	191,600	4,116,909,200	5.09
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	22,236	182,500	4,058,070,000	178,100	3,960,231,600	4.90
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,871	354,500	3,853,769,500	353,500	3,842,898,500	4.75
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	9,811	331,500	3,252,346,500	327,500	3,213,102,500	3.97
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	13,701	211,000	2,890,911,000	213,800	2,929,273,800	3.62
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	6,532	367,000	2,397,244,000	370,000	2,416,840,000	2.99
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	14,706	158,200	2,326,489,200	160,700	2,363,254,200	2.92
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	9,720	206,200	2,004,264,000	211,900	2,059,668,000	2.55
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,281	447,000	1,913,607,000	435,000	1,862,235,000	2.30
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	20,225	91,700	1,854,632,500	92,000	1,860,700,000	2.30
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,446	506,000	1,743,676,000	526,000	1,812,596,000	2.24
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,127	783,000	1,665,441,000	783,000	1,665,441,000	2.06
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	8,318	181,300	1,508,053,400	187,600	1,560,456,800	1.93
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,370	635,000	1,504,950,000	641,000	1,519,170,000	1.88
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	4,493	326,500	1,466,964,500	334,000	1,500,662,000	1.86
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	22,153	69,400	1,537,418,200	66,600	1,475,389,800	1.82
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,400	591,000	1,418,400,000	592,000	1,420,800,000	1.76
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	8,077	164,300	1,327,051,100	166,600	1,345,628,200	1.66
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	28,752	46,100	1,325,467,200	42,800	1,230,585,600	1.52
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,282	520,000	1,186,640,000	519,000	1,184,358,000	1.46
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	6,975	156,100	1,088,797,500	164,500	1,147,387,500	1.42
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,687	234,100	1,097,226,700	240,100	1,125,348,700	1.39
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,454	792,000	1,151,568,000	773,000	1,123,942,000	1.39
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	8,979	119,900	1,076,582,100	120,800	1,084,663,200	1.34
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	3,092	353,500	1,093,022,000	350,000	1,082,200,000	1.34
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,700	182,100	1,037,970,000	187,100	1,066,470,000	1.32
日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	2,234	452,000	1,009,768,000	456,500	1,019,821,000	1.26

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.73
合計	98.73

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。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2021年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	55,674,480,402	74.17
	カナダ	1,479,585,835	1.97
	ドイツ	204,550,656	0.27
	イタリア	13,310,321	0.02
	フランス	1,705,935,639	2.27
	オランダ	144,745,926	0.19
	スペイン	324,016,590	0.43
	ベルギー	1,012,150,923	1.35
	アイルランド	93,391,112	0.12
	イギリス	3,997,661,725	5.33
	オーストラリア	5,254,882,907	7.00
	ニュージーランド	173,771,801	0.23
	香港	1,180,848,582	1.57
	シンガポール	2,793,469,215	3.72
	韓国	142,081,094	0.19
	イスラエル	51,556,274	0.07
	ガーンジー	187,687,322	0.25
小計		74,434,126,324	99.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		633,390,505	0.84
合計（純資産総額）		75,067,516,829	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	332,373	13,950.77	4,636,860,208	13,429.94	4,463,749,780	5.95
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	40,261	91,116.81	3,668,454,057	88,721.65	3,572,022,407	4.76
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	68,464	32,580.18	2,230,569,813	33,558.81	2,297,570,943	3.06
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	147,649	14,738.10	2,176,066,082	14,484.87	2,138,677,191	2.85
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	126,586	17,950.45	2,272,275,841	16,853.49	2,133,416,873	2.84
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	187,604	8,980.20	1,684,721,778	9,223.47	1,730,361,329	2.31
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	62,759	23,687.34	1,486,593,884	23,256.07	1,459,528,312	1.94
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	756,563	1,713.93	1,296,699,351	1,767.13	1,336,946,082	1.78
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	154,718	8,947.02	1,384,266,247	8,576.58	1,326,952,047	1.77
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	167,907	7,806.94	1,310,841,218	7,513.91	1,261,638,254	1.68
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	61,664	21,382.72	1,318,544,131	20,238.35	1,247,977,713	1.66
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	60,156	17,686.16	1,063,928,954	18,204.78	1,095,127,071	1.46
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	168,482	6,519.79	1,098,468,404	6,399.26	1,078,160,898	1.44
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	254,856	4,181.02	1,065,560,531	4,148.96	1,057,387,758	1.41
香港	投資証券	LINK REIT	938,200	1,094.34	1,026,713,541	1,081.52	1,014,689,570	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,224	34,876.93	1,019,243,461	33,409.53	976,360,263	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	51,426	18,974.42	975,778,637	18,782.01	965,883,801	1.29
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	50,230	19,639.00	986,467,372	19,075.05	958,139,762	1.28
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	539,023	1,678.63	904,822,119	1,693.18	912,665,011	1.22
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	242,250	3,903.47	945,616,576	3,724.33	902,220,008	1.20
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	168,483	5,473.71	922,227,082	5,290.14	891,299,871	1.19
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	240,978	3,629.23	874,565,936	3,432.40	827,133,658	1.10
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	63,949	13,715.23	877,075,716	12,587.32	804,946,616	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	133,455	5,542.26	739,643,589	5,470.39	730,051,244	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	80,001	8,596.48	687,727,733	8,329.99	666,407,642	0.89
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	43,891	14,949.31	656,140,174	14,812.19	650,121,875	0.87
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,233	8,461.58	645,051,750	8,321.14	634,345,847	0.85
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	129,933	5,080.04	660,065,513	4,679.74	608,053,385	0.81
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	62,261	10,542.18	656,367,266	9,580.33	596,481,536	0.79
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	317,313	1,953.94	620,013,292	1,871.01	593,696,938	0.79

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.16
合計	99.16

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2021年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	35,893,224,586	75.09
地方債証券	日本	4,777,334,404	9.99
特殊債券	日本	5,199,453,215	10.88
社債券	日本	1,822,104,000	3.81
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		105,595,001	0.22
合計（純資産総額）		47,797,711,206	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	820,000,000	100.96	827,872,000	100.93	827,642,400	0.100	2029/12/20	1.73
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	740,000,000	100.88	746,569,200	100.87	746,445,400	0.100	2030/3/20	1.56
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	102.09	714,672,000	101.86	713,055,000	0.300	2025/12/20	1.49
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	690,000,000	101.07	697,448,300	101.09	697,534,800	0.100	2027/3/20	1.46
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	680,000,000	101.14	687,795,400	101.18	688,030,800	0.100	2028/3/20	1.44
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	101.23	617,545,700	101.07	616,539,200	0.100	2026/12/20	1.29
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	590,000,000	101.08	596,409,100	101.19	597,062,300	0.100	2028/9/20	1.25
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	590,000,000	101.21	597,178,000	101.17	596,903,000	0.100	2027/12/20	1.25
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	550,000,000	100.91	555,009,000	100.76	554,185,500	0.100	2030/6/20	1.16
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	535,000,000	101.18	541,317,100	101.19	541,366,500	0.100	2028/6/20	1.13
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	490,000,000	102.44	501,995,200	102.03	499,986,200	0.500	2024/9/20	1.05
日本	国債証券	第144回利付国債（20年）	430,000,000	116.64	501,552,000	115.87	498,279,700	1.500	2033/3/20	1.04
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	420,000,000	102.46	430,336,200	102.22	429,357,600	0.400	2025/9/20	0.90
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	358,000,000	118.60	424,588,000	117.69	421,330,200	1.700	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第145回利付国債（20年）	355,000,000	119.31	423,554,050	118.50	420,689,200	1.700	2033/6/20	0.88

日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	360,000,000	115.24	414,864,000	114.79	413,254,800	1.300	2035/6/20	0.86
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	119.67	410,474,960	118.30	405,793,010	2.100	2030/3/20	0.85
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	102.31	399,044,100	101.98	397,722,000	0.400	2025/3/20	0.83
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	350,000,000	113.75	398,132,000	113.35	396,728,500	1.200	2035/3/20	0.83
日本	国債証券	第155回利付国債(20年)	350,000,000	111.09	388,821,500	110.78	387,740,500	1.000	2035/12/20	0.81
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	102.38	378,809,700	102.11	377,821,800	0.400	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	118.84	344,650,500	117.50	340,770,300	2.100	2029/9/20	0.71
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	113.62	340,884,000	111.98	335,961,000	2.300	2026/6/20	0.70
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	325,000,000	100.91	327,967,750	101.12	328,646,500	0.100	2029/3/20	0.69
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	300,000,000	101.05	303,172,000	101.16	303,486,000	0.100	2028/12/20	0.63
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	103.29	304,720,250	102.22	301,563,750	1.400	2022/12/20	0.63
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	285,000,000	102.71	292,729,200	102.77	292,905,900	0.500	2038/3/20	0.61
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	114.24	285,600,000	112.56	281,420,000	2.300	2026/9/20	0.59
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	117.20	269,562,300	116.33	267,579,700	1.600	2032/6/20	0.56
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	134.70	269,406,000	133.14	266,280,000	2.200	2041/3/20	0.56

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.09
地方債証券	9.99
特殊債券	10.88
社債券	3.81
合計	99.78

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2021年6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	70,058,937,379	44.48
	カナダ	3,202,233,818	2.03
	メキシコ	1,268,230,146	0.81
	ドイツ	11,901,427,083	7.56
	イタリア	14,832,576,600	9.42
	フランス	15,859,362,003	10.07
	オランダ	3,041,347,218	1.93
	スペイン	9,286,447,985	5.90
	ベルギー	3,732,626,713	2.37
	オーストリア	2,336,951,466	1.48
	フィンランド	976,807,113	0.62
	アイルランド	1,302,387,781	0.83
	イギリス	10,268,936,873	6.52
	スウェーデン	568,317,143	0.36
	ノルウェー	394,365,316	0.25
	デンマーク	787,036,989	0.50
	ポーランド	983,004,399	0.62
	オーストラリア	3,336,583,683	2.12
	シンガポール	675,156,993	0.43
	マレーシア	757,349,237	0.48
イスラエル	726,842,284	0.46	
	小計	156,296,928,222	99.23
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,208,799,933	0.77
合計（純資産総額）		157,505,728,155	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		396,977,479	0.25

(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	8,000,000	11,053.43	884,274,484	11,054.76	884,380,827	0.125	2022/10/31	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,079.05	886,324,478	11,039.85	883,188,642	0.250	2023/11/15	0.56

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	12,017.39	733,061,159	11,854.52	723,125,781	2.375	2026/4/30	0.46
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	24,896.14	755,598,047	22,685.57	688,507,238	4.500	2041/4/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,590,000	10,862.75	715,855,697	10,317.20	679,903,503	0.625	2030/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,393.19	649,412,151	11,271.16	642,456,598	1.875	2022/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,773.74	624,008,519	11,580.23	613,752,224	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,871.33	635,844,116	12,273.08	606,290,349	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	12,091.44	621,500,402	11,765.53	604,748,673	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,750,000	10,980.60	631,384,776	10,494.73	603,447,154	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	12,756.43	633,995,024	12,111.10	601,921,714	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,040,000	12,046.74	607,155,696	11,664.46	587,888,865	2.000	2026/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,920.61	598,414,634	11,638.11	584,233,253	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,970,000	11,853.22	589,105,283	11,612.84	577,158,291	2.000	2025/2/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,930,000	15,142.62	595,105,011	14,662.96	576,254,459	4.250	2023/10/25	0.37
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2,855,000	22,047.54	629,457,404	20,043.52	572,242,746	2.500	2044/7/4	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,480.63	586,589,946	12,106.34	568,998,416	3.000	2025/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	13,162.04	593,608,150	12,495.54	563,548,854	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,952.14	573,702,822	11,678.28	560,557,638	2.125	2025/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,773.45	569,835,106	11,460.14	554,671,133	1.625	2026/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,026.89	551,344,947	11,013.50	550,675,440	0.250	2024/3/15	0.35
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2,692,000	22,634.39	609,317,822	20,430.68	549,993,991	2.500	2046/8/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,540,000	22,790.97	578,890,683	21,420.64	544,084,384	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,849.55	542,477,835	10,835.54	541,777,206	0.375	2026/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,940.91	551,670,117	11,710.68	541,033,450	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	14,548.18	596,475,431	13,133.96	538,492,601	3.000	2048/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,756.22	537,811,359	10,756.49	537,824,839	0.750	2028/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,978.25	548,912,895	10,623.67	531,183,559	0.500	2027/10/31	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,595,000	15,642.23	562,338,182	14,675.78	527,594,594	1.250	2034/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	12,175.03	535,701,342	11,878.71	522,663,257	2.625	2025/3/31	0.33

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.23
合計	99.23

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	2,550,000.00	281,877,000	281,975,685	0.18
	ユーロ	買建	874,000.00	115,158,240	115,001,794	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2021年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	39,207,164,390	98.75
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		497,295,459	1.25
合計(純資産総額)		39,704,459,849	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	524,610,000	1.32

(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	148,900	7,067.48	1,052,348,934	9,710.00	1,445,819,000	3.64
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	92,100	8,160.86	751,615,828	10,815.00	996,061,500	2.51
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	114,500	6,978.76	799,068,688	7,775.00	890,237,500	2.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	14,400	49,324.86	710,278,091	56,070.00	807,408,000	2.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	992,000	431.35	427,903,102	600.10	595,299,200	1.50
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	100,600	4,200.71	422,591,941	5,470.00	550,282,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	8,400	55,393.57	465,306,000	64,620.00	542,808,000	1.37
日本	株式	信越化学工業	化学	26,600	15,122.46	402,257,621	18,580.00	494,228,000	1.24
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	168,800	2,256.07	380,824,636	2,894.50	488,591,600	1.23
日本	株式	日本電産	電気機器	35,400	10,788.28	381,905,189	12,875.00	455,775,000	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	122,300	3,508.05	429,035,640	3,719.00	454,833,700	1.15
日本	株式	日立製作所	電気機器	70,700	3,754.60	265,450,740	6,361.00	449,722,700	1.13
日本	株式	HOYA	精密機器	28,700	11,874.60	340,801,020	14,730.00	422,751,000	1.06
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,600	29,351.32	252,421,410	48,080.00	413,488,000	1.04
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	115,800	2,621.37	303,554,947	3,550.00	411,090,000	1.04

日本	株式	KDDI	情報・通信業	115,700	2,867.31	331,748,144	3,465.00	400,900,500	1.01
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,700	19,573.46	366,023,790	20,690.00	386,903,000	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	100,400	3,021.35	303,343,976	3,830.00	384,532,000	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	43,200	7,469.16	322,667,840	8,482.00	366,422,400	0.92
日本	株式	ファナック	電気機器	12,900	21,783.90	281,012,364	26,795.00	345,655,500	0.87
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	99,300	2,584.32	256,623,916	3,200.00	317,760,000	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	197,100	1,324.79	261,117,581	1,587.50	312,896,250	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	56,700	3,464.30	196,426,342	5,297.00	300,339,900	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	115,600	1,815.98	209,927,835	2,500.50	289,057,800	0.73
日本	株式	S M C	機械	4,300	56,770.89	244,114,866	65,650.00	282,295,000	0.71
日本	株式	第一三共	医薬品	115,600	2,692.64	311,269,822	2,394.50	276,804,200	0.70
日本	株式	富士通	電気機器	13,200	13,685.18	180,644,440	20,800.00	274,560,000	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	88,200	2,466.15	217,515,050	3,028.00	267,069,600	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	127,500	1,485.04	189,342,781	1,934.50	246,648,750	0.62
日本	株式	デンソー	輸送用機器	32,400	5,051.00	163,652,700	7,579.00	245,559,600	0.62

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	0.18
		建設業	2.27
		食料品	3.35
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.28
		医薬品	5.22
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.62
		機械	5.31
		電気機器	17.94
		輸送用機器	7.79
		精密機器	2.69
		その他製品	2.42
		電気・ガス業	1.19
陸運業	3.34		
海運業	0.34		
空運業	0.45		

	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	8.66
	卸売業	4.69
	小売業	4.57
	銀行業	4.88
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.79
	その他金融業	1.08
	不動産業	1.99
	サービス業	5.60
合 計		98.75

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 2021年09月	買建	27	日本円	527,514,850	524,610,000	1.32

(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2021年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	160,066,552,051	66.55
	カナダ	8,557,076,303	3.56
	ドイツ	7,096,037,955	2.95
	イタリア	1,408,882,711	0.59
	フランス	7,894,899,850	3.28
	オランダ	4,410,225,117	1.83
	スペイン	1,839,847,740	0.76
	ベルギー	652,536,107	0.27
	オーストリア	157,338,830	0.07
	ルクセンブルク	229,433,098	0.10
	フィンランド	945,473,384	0.39
	アイルランド	4,459,153,637	1.85

	ポルトガル	117,981,274	0.05
	イギリス	10,065,780,070	4.19
	スイス	8,043,915,854	3.34
	スウェーデン	2,635,724,620	1.10
	ノルウェー	459,993,942	0.19
	デンマーク	1,929,631,277	0.80
	ケイマン	441,138,296	0.18
	オーストラリア	4,834,596,152	2.01
	バミューダ	339,807,298	0.14
	ニュージーランド	227,793,887	0.09
	パプアニューギニア	24,382,052	0.01
	香港	1,874,729,871	0.78
	シンガポール	669,923,035	0.28
	イスラエル	510,558,132	0.21
	ジャージー	816,130,699	0.34
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	58,341,707	0.02
	小計	230,767,884,949	95.95
投資証券	アメリカ	4,571,137,902	1.90
	カナダ	14,555,342	0.01
	フランス	121,859,330	0.05
	イギリス	139,358,651	0.06
	オーストラリア	341,302,896	0.14
	香港	94,633,700	0.04
	シンガポール	96,954,699	0.04
	小計	5,379,802,520	2.24
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,359,059,261	1.81
合計（純資産総額）		240,506,746,730	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	3,551,276,700	1.48
	買建	ドイツ	695,729,250	0.29

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		2,481,047,210	1.03
	売建		12,467,895	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	663,068	12,723.33	8,436,436,159	15,075.37	9,995,996,363	4.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	283,004	23,918.45	6,769,018,156	30,011.41	8,493,349,642	3.53
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	16,925	354,281.73	5,996,218,331	381,295.32	6,453,423,311	2.68
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	95,040	31,494.28	2,993,217,303	38,911.99	3,698,196,119	1.54
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,647	181,703.95	2,116,305,908	278,702.51	3,246,048,188	1.35
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,885	180,739.69	2,148,091,247	270,417.86	3,213,916,278	1.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	30,500	47,191.81	1,439,350,234	75,278.44	2,295,992,444	0.95
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	24,365	60,101.33	1,464,369,046	88,582.32	2,158,308,241	0.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	120,290	11,502.53	1,383,639,526	17,044.80	2,050,319,136	0.85
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	104,051	16,068.37	1,671,930,987	18,138.43	1,887,322,550	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	66,622	21,904.79	1,459,341,066	26,091.35	1,738,257,986	0.72
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	54,170	23,540.27	1,275,176,448	30,543.30	1,654,530,659	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,490	36,576.54	1,371,254,732	44,021.89	1,650,380,956	0.69
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	113,833	12,791.32	1,456,075,183	13,961.81	1,589,315,287	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	42,540	31,306.30	1,331,770,164	35,190.97	1,497,024,255	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	97,969	15,742.16	1,542,244,535	14,861.95	1,456,010,575	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	35,145	36,461.54	1,281,440,943	40,693.44	1,430,170,949	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	43,957	22,465.43	987,513,030	32,373.40	1,423,037,579	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	307,469	2,757.86	847,958,055	4,521.61	1,390,256,811	0.58
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	71,452	14,241.59	1,017,590,674	19,233.17	1,374,249,134	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,782	41,897.70	703,127,262	77,619.04	1,302,602,763	0.54
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,934	54,018.32	1,022,783,060	65,325.13	1,236,866,106	0.51
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	27,733	35,702.87	990,147,694	41,873.44	1,161,276,112	0.48

アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	166,921	3,788.47	632,375,334	6,924.51	1,155,847,736	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	180,314	4,992.68	900,251,364	6,252.19	1,127,357,965	0.47
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	17,430	54,011.69	941,423,847	58,994.43	1,028,272,915	0.43
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	161,782	5,335.48	863,185,435	6,275.41	1,015,249,190	0.42
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	163,387	6,409.21	1,047,182,705	6,174.78	1,008,879,956	0.42
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	35,915	27,702.50	994,935,345	27,181.66	976,229,671	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	166,800	4,292.71	716,024,962	5,850.78	975,911,405	0.41

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	3.26
		素材	4.28
		資本財	6.34
		商業・専門サービス	1.21
		運輸	2.02
		自動車・自動車部品	1.99
		耐久消費財・アパレル	2.01
		消費者サービス	1.80
		メディア・娯楽	7.29
		小売	5.54
		食品・生活必需品小売り	1.34
		食品・飲料・タバコ	3.85
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	5.10
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.43
		銀行	6.00
		各種金融	4.60
		保険	2.96
		不動産	0.41
		ソフトウェア・サービス	11.98
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.68		
電気通信サービス	1.68		
公益事業	2.84		
半導体・半導体製造装置	4.62		
投資証券			2.24
合計			98.19

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2109	買建	150	米ドル	31,826,862.5	3,519,414,455	32,115,000	3,551,276,700	1.48
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2109	買建	150	ユーロ	5,288,890	695,912,146	5,287,500	695,729,250	0.29

(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	17,800,000.00	1,956,391,640	1,967,681,210	0.82
	ユーロ	買建	3,900,000.00	516,679,830	513,366,000	0.21
	豪ドル	売建	150,000.00	12,456,000	12,467,895	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。

参考情報

運用実績

2021年6月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,145円

純資産総額…………… 349.31億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2011年6月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2021年2月	2021年3月	2021年4月	2021年5月	2021年6月	直近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,120円

主要な資産の状況

額入資産	投資対象	比率*	額入上位の銘柄名	国名	比率**
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.4%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.6%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.8%
			日本都市ファンド投資法人 投資証券	日本	5.1%
			GLP投資法人 投資証券	日本	5.1%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	4.9%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	5.9%
			EQUINIX INC	アメリカ	4.8%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.1%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	2.8%
			DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.8%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.3%	第357回利付国債(10年)	日本	1.7%
			第358回利付国債(10年)	日本	1.6%
			第341回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第346回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第350回利付国債(10年)	日本	1.4%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.3%	US TREASURY N/B(0.125%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(0.25%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(2.375%)	アメリカ	0.5%
			FRANCE (GOVT OF)(4.5%)	フランス	0.4%
			US TREASURY N/B(0.625%)	アメリカ	0.4%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.2%	トヨタ自動車	日本	3.6%
			ソニーグループ	日本	2.5%
			ソフトバンクグループ	日本	2.2%
			キーエンス	日本	2.0%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	1.5%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.6%	APPLE INC	アメリカ	4.2%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	3.5%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.7%
			FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.5%
			ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
現金その他		2.0%			

*1:当ファンドの対純資産総額比です。また、合計の比率が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2021年は、2021年6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (5) 取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消
委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。
- (10) 償還乗換
・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、投資対象とする投資信託証券(マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。)からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

< 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。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 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(2005年9月29日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

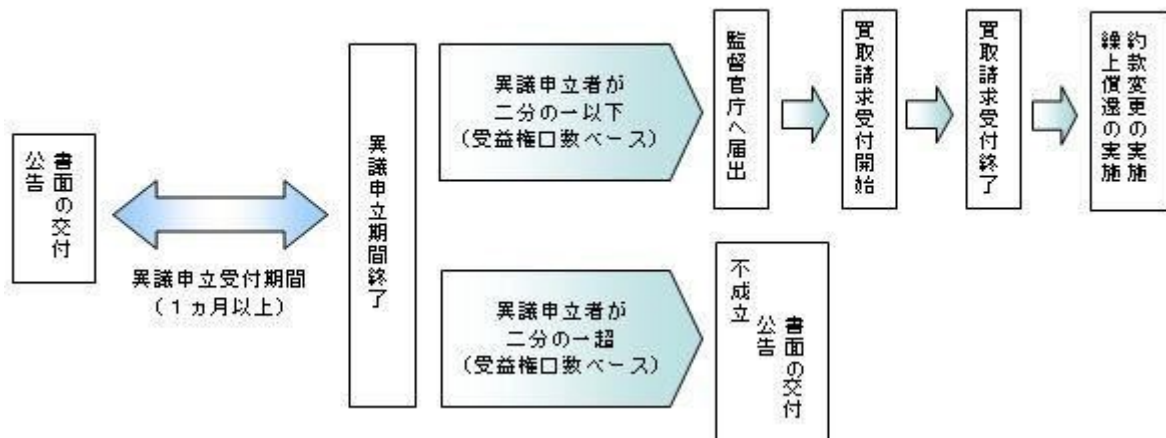
異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 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、年2回(6月、12月)および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2020年12月16日から2021年6月15日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2020年12月15日現在	当期 2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	643,947,177	765,193,906
親投資信託受益証券	30,429,472,077	34,273,521,752
未収入金	16,841,486	765,592
流動資産合計	31,090,260,740	35,039,481,250
資産合計	31,090,260,740	35,039,481,250
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	34,811,559	34,197,976
未払解約金	19,823,469	28,769,565
未払受託者報酬	1,350,478	1,487,759
未払委託者報酬	24,308,797	26,779,839
未払利息	334	76
その他未払費用	3,187,878	6,792,271
流動負債合計	83,482,515	98,027,486
負債合計	83,482,515	98,027,486
純資産の部		
元本等		
元本	34,811,559,623	34,197,976,910
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,804,781,398	743,476,854
（分配準備積立金）	3,190,152,896	5,819,919,676
元本等合計	31,006,778,225	34,941,453,764
純資産合計	31,006,778,225	34,941,453,764
負債純資産合計	31,090,260,740	35,039,481,250

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 至	2020年 6月16日 2020年12月15日	自 至	2020年12月16日 2021年 6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,481,808,237		4,837,080,908
営業収益合計		2,481,808,237		4,837,080,908
営業費用				
支払利息		77,829		25,604
受託者報酬		8,373,385		8,877,903
委託者報酬		150,722,059		159,803,335
その他費用		3,749,662		4,303,588
営業費用合計		162,922,935		173,010,430
営業利益又は営業損失()		2,318,885,302		4,664,070,478
経常利益又は経常損失()		2,318,885,302		4,664,070,478
当期純利益又は当期純損失()		2,318,885,302		4,664,070,478
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()		1,457,241		22,652,940
期首剰余金又は期首欠損金()		6,013,336,456		3,804,781,398
剰余金増加額又は欠損金減少額		271,896,897		168,202,827
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		271,896,897		168,202,827
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		168,379,854		57,455,782
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		168,379,854		57,455,782
分配金		212,390,046		203,906,331
期末剰余金又は期末欠損金()		3,804,781,398		743,476,854

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		前期 2020年12月15日現在	当期 2021年 6月15日現在
1.	期首元本額	35,584,769,481円	34,811,559,623円
	期中追加設定元本額	1,154,110,398円	2,277,192,099円
	期中一部解約元本額	1,927,320,256円	2,890,774,812円
2.	受益権の総数	34,811,559,623口	34,197,976,910口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,804,781,398円	- 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日		当期 自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日	
分配金の計算過程 自 2020年 6月16日 至 2020年 7月15日		分配金の計算過程 自 2020年12月16日 至 2021年 1月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	60,345,416円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 58,350,948円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	682,287,758円	C 信託約款に定める収益調整金 756,335,709円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	3,245,966,494円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 3,157,999,492円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,988,599,668円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 3,972,686,149円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,118円	F 分配対象収益(1万口当たり) 1,147円
G	分配金額	35,650,697円	G 分配金額 34,606,352円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2020年 7月16日 至 2020年 8月17日		自 2021年 1月16日 至 2021年 2月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	46,731,995円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 42,494,444円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 287,974,371円
C	信託約款に定める収益調整金	701,909,383円	C 信託約款に定める収益調整金 759,979,784円

D	信託約款に定める分配準備積立金	3,251,232,727円	D	信託約款に定める分配準備積立金	3,129,925,575円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,999,874,105円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,220,374,174円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,122円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,234円
G	分配金額	35,648,476円	G	分配金額	34,174,506円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2020年 8月18日			自 2021年 2月16日	
	至 2020年 9月15日			至 2021年 3月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	55,994,637円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	66,496,842円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	615,348,371円
C	信託約款に定める収益調整金	721,950,879円	C	信託約款に定める収益調整金	766,159,513円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,235,169,640円	D	信託約款に定める分配準備積立金	3,371,501,073円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,013,115,156円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,819,505,799円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,127円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,427円
G	分配金額	35,579,020円	G	分配金額	33,769,576円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2020年 9月16日			自 2021年 3月16日	
	至 2020年10月15日			至 2021年 4月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	63,924,621円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	96,748,488円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	519,213,144円
C	信託約款に定める収益調整金	739,352,370円	C	信託約款に定める収益調整金	798,845,637円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,234,359,259円	D	信託約款に定める分配準備積立金	3,939,477,302円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,037,636,250円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,354,284,571円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,136円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,601円
G	分配金額	35,539,439円	G	分配金額	33,424,461円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2020年10月16日			自 2021年 4月16日	
	至 2020年11月16日			至 2021年 5月17日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	44,224,497円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	36,905,684円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	44,632,458円
C	信託約款に定める収益調整金	743,970,095円	C	信託約款に定める収益調整金	897,893,322円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,216,357,530円	D	信託約款に定める分配準備積立金	4,473,223,433円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,004,552,122円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,452,654,897円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,138円	F	分配対象収益(1万口当たり)	1,616円
G	分配金額	35,160,855円	G	分配金額	33,733,460円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2020年11月17日			自 2021年 5月18日	
	至 2020年12月15日			至 2021年 6月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	40,949,238円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	42,422,744円

B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	1,336,097,738円
C	信託約款に定める収益調整金	746,718,123円	C	信託約款に定める収益調整金	1,018,903,084円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,184,015,217円	D	信託約款に定める分配準備積立金	4,475,597,170円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,971,682,578円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	6,873,020,736円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,140円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,009円
G	分配金額	34,811,559円	G	分配金額	34,197,976円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2020年 6月16日 至 2020年12月15日	当期 自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 2020年12月15日現在	当期 2021年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

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

(有価証券に関する注記)

前期（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	444,468,392
合計	444,468,392

当期（2021年 6月15日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,360,614,161
合計	1,360,614,161

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 2020年12月15日現在	当期 2021年 6月15日現在
1口当たり純資産額	0.8907円
	1口当たり純資産額
	1.0217円

(1万口当たり純資産額)	(8,907円)	(1万口当たり純資産額)	(10,217円)
--------------	----------	--------------	-----------

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	1,523,655,093	5,746,160,452	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,014,077,724	5,675,504,493	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,225,911,412	5,702,339,855	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,013,674,301	5,725,077,069	
	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	2,110,212,429	5,670,984,881	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,203,291,465	5,753,455,002	
	合計	15,090,822,424	34,273,521,752	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本リートインデックスJ - REITマザーファンド」「海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド」「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI - K

OKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）		
	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	446,421,652	453,582,248
投資証券	101,608,094,820	80,908,878,600
未収配当金	662,018,382	372,560,049
流動資産合計	102,716,534,854	81,735,020,897
資産合計	102,716,534,854	81,735,020,897
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,554,198	6,444,466
未払利息	232	45
流動負債合計	7,554,430	6,444,511
負債合計	7,554,430	6,444,511
純資産の部		
元本等		
元本	48,854,624,863	30,411,438,906
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	53,854,355,561	51,317,137,480
元本等合計	102,708,980,424	81,728,576,386
純資産合計	102,708,980,424	81,728,576,386
負債純資産合計	102,716,534,854	81,735,020,897

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 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>
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
1.	期首	2020年 6月16日	2020年12月16日
	期首元本額	61,422,081,732円	48,854,624,863円
	期首からの追加設定元本額	2,370,535,283円	1,251,580円
	期首からの一部解約元本額	14,937,992,152円	18,444,437,537円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,399,087,650円	2,110,212,429円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,971,602,859円	1,479,739,014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）	184,860,163円	163,838,222円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	44,299,074,191円	26,656,397,661円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	- 円	1,251,580円
	計	48,854,624,863円	30,411,438,906円
2.	受益権の総数	48,854,624,863口	30,411,438,906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 6月16日 至 2020年12月15日	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在

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

（有価証券に関する注記）

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,447,126,248
合計	4,447,126,248

（2021年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	19,168,975,075
合計	19,168,975,075

(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）

2020年12月15日現在		2021年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2,1023円	1口当たり純資産額	2,6874円
(1万口当たり純資産額)	(21,023円)	(1万口当たり純資産額)	(26,874円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,139	158,662,700	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,705	220,115,500	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	1,832	276,265,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,402	1,525,270,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	8,186	1,344,959,800	
	産業ファンド投資法人 投資証券	9,850	2,031,070,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	6,619	2,429,173,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,749	1,111,740,900	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,492	1,766,952,000	
	G L P 投資法人 投資証券	21,775	4,122,007,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	3,133	1,107,515,500	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	11,017	3,905,526,500	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,060	717,620,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	1,086	345,891,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	7,068	1,103,314,800	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,777	1,051,991,700	
	日本リート投資法人 投資証券	2,263	1,022,876,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	44,283	1,000,795,800	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	20,496	1,879,483,200	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,542	213,412,800	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,772	818,294,400		
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,486	217,104,600		

サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,341	166,552,200	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	22,534	4,112,455,000	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	1,219	123,972,300	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	8,429	1,528,177,700	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	7,160	435,328,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	653	89,265,100	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,432	1,437,312,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	1,125	95,175,000	
投資法人みらい 投資証券	7,526	386,083,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	1,509	212,316,300	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,753	838,810,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,229	416,377,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	1,068	130,296,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,094	257,562,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,703	405,720,300	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	7,843	5,733,233,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,968	4,842,760,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	34,709	4,067,894,800	
オリックス不動産投資法人 投資証券	13,884	2,929,524,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,339	1,939,533,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	6,294	1,031,586,600	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	4,672	944,211,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,839	610,681,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	14,903	2,357,654,600	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	4,980	791,322,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	29,137	1,343,215,700	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,313	1,202,760,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,503	780,820,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	4,553	1,486,554,500	
福岡リート投資法人 投資証券	3,604	657,730,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,156	1,688,148,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	5,710	571,000,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,485	1,176,120,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	3,148	493,921,200	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,085	261,919,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	9,942	3,295,773,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	22,449	1,557,960,600	
大和証券リビング投資法人 投資証券	9,099	1,090,970,100	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	6,466	1,048,138,600	
合計	436,588	80,908,878,600	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	768,729,851	278,917,322
コール・ローン	26,082,001	31,397,751
投資証券	95,979,398,255	80,875,661,501
未収入金	4,983,194	52,677,105
未収配当金	195,037,921	116,331,888
流動資産合計	96,974,231,222	81,354,985,567
資産合計	96,974,231,222	81,354,985,567
負債の部		
流動負債		
未払解約金	558,113	2,789,840
未払利息	13	3
流動負債合計	558,126	2,789,843
負債合計	558,126	2,789,843
純資産の部		
元本等		
元本	49,314,995,417	31,154,221,388
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	47,658,677,679	50,197,974,336
元本等合計	96,973,673,096	81,352,195,724
純資産合計	96,973,673,096	81,352,195,724
負債純資産合計	96,974,231,222	81,354,985,567

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
1.	期首	2020年 6月16日	2020年12月16日
	期首元本額	66,801,185,885円	49,314,995,417円
	期首からの追加設定元本額	3,003,043,624円	7,023,988円
	期首からの一部解約元本額	20,489,234,092円	18,167,798,017円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,562,673,885円	2,203,291,465円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	32,470,785円	17,914,137円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	46,393,446,488円	28,616,313,831円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	326,404,259円	316,701,955円
	計	49,314,995,417円	31,154,221,388円
2.	受益権の総数	49,314,995,417口	31,154,221,388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 6月16日 至 2020年12月15日	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

投資証券	5,696,550,667
合計	5,696,550,667

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	18,982,328,665
合計	18,982,328,665

(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)

2020年12月15日現在		2021年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.9664円	1口当たり純資産額	2.6113円
(1万口当たり純資産額)	(19,664円)	(1万口当たり純資産額)	(26,113円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	42,495	953,162.85	
		AGREE REALTY CORPORATION	30,465	2,198,659.05	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,412	662,559.96	
		ALEXANDER'S INC	1,028	288,477.36	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	60,790	11,764,688.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,742	921,901.86	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	66,224	3,236,366.88	

AMERICAN FINANCE TRUST INC	49,955	449,595.00
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	128,513	5,044,135.25
AMERICOLD REALTY TRUST	120,650	4,737,925.50
APARTMENT INCOME REIT CO	71,211	3,552,716.79
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	70,230	540,068.70
APPLE HOSPITALITY REIT INC	98,097	1,595,057.22
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	29,013	402,410.31
AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,763	14,301,302.23
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	11,645	118,779.00
BOSTON PROPERTIES INC	67,979	8,431,435.37
BRANDYWINE REALTY TRUST	82,974	1,238,801.82
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	141,450	3,379,240.50
BROADSTONE NET LEASE INC-A	17,945	463,878.25
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	17,964	332,334.00
BRT APARTMENTS CORP	5,682	104,776.08
CAMDEN PROPERTY TRUST	46,694	6,312,561.86
CARETRUST REIT INC	46,246	1,108,516.62
CENTERSPACE	6,086	460,040.74
CHATHAM LODGING TRUST	21,803	300,881.40
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,061	57,640.11
CIM COMMERCIAL TRUST-RTS(N)	6,061	1,575.86
CITY OFFICE REIT INC	19,658	250,442.92
CLIPPER REALTY INC	6,567	50,959.92
COLONY CAPITAL INC-A	234,278	1,850,796.20
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	54,526	1,018,000.42
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	10,397	535,341.53
COREPOINT LODGING INC	16,407	166,695.12
CORESITE REALTY CORP	20,412	2,750,721.12
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	53,213	1,590,536.57
COUSINS PROPERTIES INC	71,442	2,856,251.16
CTO REALTY GROWTH INC	2,674	149,342.90
CUBESMART	95,627	4,466,737.17
CYRUSONE INC	57,576	4,550,231.28
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	100,277	1,038,869.72
DIGITAL REALTY TRUST INC	134,464	21,827,541.12
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	110,294	455,514.22
DOUGLAS EMMETT INC	79,661	2,922,762.09
DUKE REALTY CORPORATION	178,719	8,846,590.50
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	39,388	862,597.20
EASTGROUP PROPERTIES INC	18,881	3,219,399.31
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	68,336	867,183.84

EPR PROPERTIES	35,594	1,910,685.92
EQUINIX INC	42,698	35,182,725.02
EQUITY COMMONWEALTH	58,275	1,638,693.00
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	81,119	6,207,225.88
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	164,069	13,274,822.79
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	53,841	1,554,928.08
ESSEX PROPERTY TRUST INC	31,105	9,810,517.00
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,234	10,113,645.96
FARMLAND PARTNERS INC	11,817	150,903.09
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	33,425	4,124,979.25
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	62,134	3,349,643.94
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	36,249	1,049,771.04
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,082	248,852.64
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	104,439	4,995,317.37
GEO GROUP INC/THE	59,201	404,342.83
GETTY REALTY CORPORATION	16,801	572,578.08
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	16,267	375,930.37
GLADSTONE LAND CORP	10,935	270,313.20
GLOBAL MEDICAL REIT INC	20,492	325,822.80
GLOBAL NET LEASE INC	43,914	877,401.72
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	67,470	2,177,931.60
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	105,683	3,119,762.16
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	257,830	9,101,399.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,671	197,884.77
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49,902	2,426,235.24
HOST HOTELS & RESORTS INC	337,435	5,962,476.45
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	72,401	2,192,302.28
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	47,642	892,811.08
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	30,235	800,320.45
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	11,412	2,188,136.88
INVITATION HOMES INC	271,171	10,252,975.51
IRON MOUNTAIN INC	138,218	6,349,734.92
JBG SMITH PROPERTIES	52,861	1,839,562.80
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	330,200	252,603.00
KILROY REALTY CORPORATION	51,040	3,763,689.60
KIMCO REALTY CORPORATION	206,630	4,488,003.60
KITE REALTY GROUP TRUST	40,832	941,994.24
LEXINGTON REALTY TRUST	133,875	1,740,375.00
LIFE STORAGE INC	36,041	3,888,463.49
LTC PROPERTIES INC	19,020	752,811.60
MACERICH CO/THE	56,736	988,908.48
MACK-CALI REALTY CORPORATION	42,462	757,522.08
MANULIFE US REAL ESTATE INV	684,747	516,983.98

MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	277,245	6,091,072.65	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	54,722	9,389,747.98	
MONMOUTH RE INVST CORP	46,607	915,827.55	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	83,701	4,180,027.94	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	30,535	1,518,200.20	
NATL HEALTH INVESTORS INC	21,294	1,430,956.80	
NETSTREIT CORP	10,222	244,510.24	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	34,622	252,048.16	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,656	603,342.72	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	23,397	722,733.33	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	110,425	4,172,960.75	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,592	194,398.08	
PARAMOUNT GROUP INC	81,695	924,787.40	
PARK HOTELS & RESORTS INC	113,744	2,450,045.76	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,164	1,515,558.32	
PHYSICIANS REALTY TRUST	100,817	1,969,964.18	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	59,926	1,215,898.54	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,084	261,418.32	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,164	251,329.40	
PRIME US REIT	209,700	180,342.00	
PROLOGIS INC	353,536	44,602,101.76	
PS BUSINESS PARKS INC	9,760	1,551,742.40	
PUBLIC STORAGE	72,782	21,443,760.66	
QTS REALTY TRUST INC-CL-A	31,044	2,422,984.20	
REALTY INCOME CORP	178,651	12,612,760.60	
REGENCY CENTERS CORP	75,632	5,055,242.88	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	56,308	1,047,328.80	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	102,013	1,273,122.24	
RETAIL VALUE INC	7,900	170,482.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	62,587	3,707,653.88	
RLJ LODGING TRUST	78,334	1,257,260.70	
RPT REALTY	37,950	520,674.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,329	2,129,489.52	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	100,128	1,827,336.00	
SAFEHOLD INC	6,714	526,176.18	
SAUL CENTERS INC	5,810	273,418.60	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	17,192	324,413.04	
SERVICE PROPERTIES TRUST	78,391	1,079,444.07	
SIMON PROPERTY GROUP INC	157,145	20,944,285.60	
SITE CENTERS CORP	79,073	1,238,283.18	
SL GREEN REALTY CORP	33,473	2,788,970.36	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	55,173	2,780,719.20	

		STAG INDUSTRIAL INC	75,361	2,963,948.13
		STORE CAPITAL CORP	114,487	4,146,719.14
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	48,337	490,137.18
		SUN COMMUNITIES INC	53,360	9,476,736.00
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	102,989	1,358,424.91
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	45,380	876,287.80
		TERRENO REALTY CORP	32,854	2,212,716.90
		UDR INC	142,100	7,122,052.00
		UMH PROPERTIES INC	18,762	421,769.76
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	6,315	447,670.35
		URBAN EDGE PROPERTIES	52,514	1,054,481.12
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	14,109	276,113.13
		VENTAS INC	179,171	10,563,922.16
		VEREIT INC	109,568	5,363,353.60
		VICI PROPERTIES INC	256,466	8,417,214.12
		VORNADO REALTY TRUST	74,969	3,753,697.83
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	13,640	46,103.20
		WASHINGTON REIT	40,325	1,081,919.75
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	57,300	1,904,652.00
		WELLTOWER INC	199,616	16,210,815.36
		WHITESTONE REIT	17,051	147,832.17
		WP CAREY INC	83,952	6,526,428.48
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,826	1,115,160.84
米ドル小計			12,089,569	549,377,563.79 (60,491,963,548)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	30,194	1,383,187.14
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,117	349,755.08
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	10,362	126,727.26
		BOARDWALK EQUITIES INC	11,128	445,342.56
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	40,721	2,323,947.47
		CHOICE PROPERTIES REIT	77,195	1,142,486.00
		COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44,259	455,425.11
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,369	405,997.35
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	25,566	430,787.10
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	41,409	607,055.94
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	11,124	259,411.68
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	51,424	920,489.60
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	14,387	1,186,639.76
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	66,976	1,112,471.36
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,434	538,956.08
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,889	520,886.68
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	7,400	166,278.00

		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	9,832	167,242.32
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	44,182	572,156.90
		PLAZA RETAIL REIT	30,936	141,996.24
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	74,685	1,626,639.30
		SLATE GROCERY REIT	12,940	166,020.20
		SLATE OFFICE REIT	10,000	53,500.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	34,642	1,030,945.92
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	37,645	625,283.45
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	22,614	169,831.14
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	20,073	453,649.80
加ドル小計			842,503	17,383,109.44 (1,576,300,364)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	15,765	1,753,068.00
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	84,911	1,318,667.83
		ALTAREA	1,713	312,108.60
		BEFIMMO S.C.A.	12,505	447,053.75
		CARE PROPERTY INVEST	12,980	353,705.00
		CARMILA	23,091	308,033.94
		COFINIMMO	13,779	1,803,671.10
		COVIVIO	23,148	1,879,154.64
		CROMWELL REIT EUR	147,160	344,354.40
		EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	16,672	380,455.04
		EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV(N)	926	21,131.32
		GECINA SA	25,922	3,517,615.40
		HAMBORNER REIT AG	37,472	345,566.78
		HIBERNIA REIT PLC	329,649	414,039.14
		ICADE	14,863	1,134,790.05
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	25,696	119,486.40
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	122,778	1,167,004.89
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,730	261,812.00
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	220,268	343,177.54
		KLEPIERRE	95,299	2,378,663.04
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,490	181,762.30
		MERCIALYS	18,263	196,327.25
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	160,978	1,540,881.41
		MONTEA	4,728	493,603.20
		NSI NV	8,496	293,961.60
		RETAIL ESTATES	5,306	381,501.40
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	66,276	5,310,033.12
		VASTNED RETAIL	8,903	231,032.85
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	65,579	2,124,759.60
		WERELDHAVE NV	19,854	315,480.06

		XIOR STUDENT HOUSING NV	8,133	406,650.00	
ユーロ小計			1,636,333	30,079,551.65 (4,014,116,167)	
英ポンド	投資証券	AEW UK REIT PLC	68,758	65,320.10	
		ASSURA PLC	1,286,507	992,540.15	
		BIG YELLOW GROUP PLC	78,612	1,017,239.28	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	372,174	341,655.73	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	447,107	2,301,706.83	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	410,692	721,585.84	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	314,381	370,969.58	
		CUSTODIAN REIT PLC	208,264	206,389.62	
		DERWENT LONDON PLC	53,898	1,911,762.06	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	296,035	255,774.24	
		GCP STUDENT LIVING PLC	208,336	361,671.29	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	121,023	907,672.50	
		HAMMERSON PLC	1,933,979	855,785.70	
		HOME REIT PLC	120,454	136,113.02	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	148,645	165,590.53	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	358,670	2,577,402.62	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	431,821	1,028,597.62	
		LXI REIT PLC	263,278	389,651.44	
		NEWRIVER REIT PLC	137,155	123,028.03	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	262,235	234,700.32	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	640,647	1,012,222.26	
		REGIONAL REIT LTD	226,223	199,076.24	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	99,946	965,478.36	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	251,903	117,638.70	
		SEGRE PLC	570,964	6,257,765.44	
		SHAFTESBURY PLC	144,544	886,777.44	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	208,531	150,559.38	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	388,423	458,339.14	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	172,860	181,848.72	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	827,209	1,695,778.45	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	365,072	296,438.46	
		UNITE GROUP PLC	189,351	2,177,536.50	
		WORKSPACE GROUP PLC	61,340	539,792.00	
英ポンド小計			12,427,783	29,904,407.59 (4,646,845,895)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	190,002	602,306.34	
		APN INDUSTRIA REIT	69,986	224,655.06	
		ARENA REIT	169,592	590,180.16	

		AVENTUS GROUP	192,569	589,261.14	
		BWP TRUST	249,013	1,078,226.29	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	231,438	634,140.12	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	232,618	863,012.78	
		CENTURIA OFFICE REIT	195,829	460,198.15	
		CHARTER HALL GROUP	224,603	3,398,243.39	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	279,905	1,371,534.50	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	258,116	996,327.76	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	166,705	600,138.00	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	941,736	861,688.44	
		DEXUS	523,771	5,620,062.83	
		GDI PROPERTY GROUP	265,064	303,498.28	
		GOODMAN GROUP	804,961	16,598,295.82	
		GPT GROUP	932,932	4,580,696.12	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	142,657	572,054.57	
		HOME CONSORTIUM	89,480	442,031.20	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	160,569	234,430.74	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	80,892	266,943.60	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	140,901	827,088.87	
		IRONGATE GROUP	273,372	418,259.16	
		MIRVAC GROUP	1,886,119	5,601,773.43	
		NATIONAL STORAGE REI - RTS	74,654	5,225.78	
		NATIONAL STORAGE REIT	468,086	968,938.02	
		RURAL FUNDS GROUP	170,778	433,776.12	
		SCENTRE GROUP	2,485,706	7,208,547.40	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	537,661	1,376,412.16	
		STOCKLAND	1,140,104	5,461,098.16	
		VICINITY CENTRES	1,870,113	3,132,439.27	
		WAYPOINT REIT LTD	401,828	1,064,844.20	
		豪ドル小計	15,851,760	67,386,327.86 (5,721,773,098)	
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	641,985	1,482,985.35	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	265,071	820,394.74	
		ニュージーランドドル小計	907,056	2,303,380.09 (181,137,810)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	949,000	4,384,380.00	
		FORTUNE REIT	707,000	5,974,150.00	
		LINK REIT	998,200	76,711,670.00	
		PROSPERITY REIT	601,000	1,796,990.00	
		RREEF CHINA COMMERCIAL TRUST	201,000	874,350.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	495,000	2,277,000.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	779,000	3,256,220.00	

香港ドル小計			4,730,200	95,274,760.00 (1,351,948,844)
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	216,325	311,508.00
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	539,794	442,631.08
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,532,132	4,550,432.04
		ASCOTT TRUST	908,592	944,935.68
		CAPITALAND CHINA TRUST	463,485	639,609.30
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,189,292	4,706,977.80
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	378,900	477,414.00
		EC WORLD REIT	171,700	138,218.50
		ESR REIT	1,192,859	489,072.19
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	466,400	277,508.00
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	600,240	165,066.00
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	639,805	1,561,124.20
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	349,300	188,622.00
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,277,160	1,800,795.60
		IREIT GLOBAL	231,054	151,340.37
		KEPPEL DC REIT	608,477	1,563,785.89
		KEPPEL REIT	941,500	1,120,385.00
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	399,200	321,356.00
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	3,096,260	198,160.64
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,047,131	2,251,331.65
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	892,460	2,472,114.20
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST (N)	41,148	113,979.96
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,403,014	2,834,088.28
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	1,040,000	1,112,800.00
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,168,535	467,414.00
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	187,300	822,247.00
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	379,600	163,228.00		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	223,900	204,868.50		
SPH REIT	507,200	443,800.00		
STARHILL GLOBAL REIT	667,500	373,800.00		
SUNTEC REIT	1,068,500	1,570,695.00		
シンガポールドル小計			24,828,763	32,879,308.88 (2,728,653,843)
韓国ウォン	投資証券	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,383	63,630,970.00
		JR REIT XXVII	50,551	263,876,220.00
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17,547	105,808,410.00
		LOTTE REIT CO LTD	61,671	376,809,810.00
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,250	80,600,000.00
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	28,125	230,625,000.00
			185,527	1,121,350,410.00

韓国ウォン小計				(110,565,150)	
イスラエル シュケル	投資証券	REIT 1 LTD	87,544	1,543,400.72	
イスラエルシュケル小計			87,544	1,543,400.72	(52,356,782)
合計				80,875,661,501	(80,875,661,501)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 157銘柄	100.0%	74.8%
加ドル	投資証券 27銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	5.0%
英ポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.7%
豪ドル	投資証券 32銘柄	100.0%	7.1%
ニュージーランドドル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	投資証券 31銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券 6銘柄	100.0%	0.1%
イスラエルシュケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	364,051,411	246,245,378
国債証券	33,682,537,342	35,720,287,750
地方債証券	3,455,327,000	4,675,703,282

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
特殊債券	4,606,199,495	4,996,105,850
社債券	2,432,361,168	1,822,777,000
未収利息	134,378,394	132,944,059
前払費用	1,191,642	3,553,722
流動資産合計	44,676,046,452	47,597,617,041
資産合計	44,676,046,452	47,597,617,041
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,031,000
未払解約金	7,752,454	13,925,868
未払利息	189	24
流動負債合計	7,752,643	113,956,892
負債合計	7,752,643	113,956,892
純資産の部		
元本等		
元本	31,533,513,015	33,583,669,363
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	13,134,780,794	13,899,990,786
元本等合計	44,668,293,809	47,483,660,149
純資産合計	44,668,293,809	47,483,660,149
負債純資産合計	44,676,046,452	47,597,617,041

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
1. 期首	2020年 6月16日	2020年12月16日
期首元本額	30,001,805,725円	31,533,513,015円
期首からの追加設定元本額	2,149,286,949円	2,826,979,509円
期首からの一部解約元本額	617,579,659円	776,823,161円

元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	3,426,701,467円	3,882,149,311円
DCインデックスバランス(株式40)	3,099,877,835円	3,519,934,207円
DCインデックスバランス(株式60)	2,201,571,809円	2,565,886,843円
DCインデックスバランス(株式80)	342,649,068円	415,102,120円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,144,545,590円	2,157,077,210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	3,488,595,537円	4,014,077,724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)	1,618,062,790円	1,674,097,610円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,501,988円	4,828,914円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	23,837,975円	25,501,500円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	96,758,298円	98,168,303円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	252,243,751円	250,623,214円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,090,395,680円	4,101,720,877円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,397,407,574円	1,451,622,339円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,362,727,703円	1,430,645,642円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	748,864,620円	796,392,418円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	104,739,933円	115,009,682円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,812,939,462円	6,751,351,150円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	317,091,935円	329,480,299円
計	31,533,513,015円	33,583,669,363円
2. 受益権の総数	31,533,513,015口	33,583,669,363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 6月16日 至 2020年12月15日	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

国債証券	67,884,600
地方債証券	1,726,000
特殊債証券	3,891,505
社債証券	1,453,270
合計	60,813,825

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	164,402,220
地方債証券	15,031,718
特殊債証券	20,797,806
社債証券	5,189,000
合計	205,420,744

(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)

2020年12月15日現在		2021年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.4165円	1口当たり純資産額	1.4139円
(1万口当たり純資産額)	(14,165円)	(1万口当たり純資産額)	(14,139円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	70,000,000	101,269,700	
	第2回利付国債(40年)	95,000,000	133,068,400	
	第3回利付国債(40年)	70,000,000	98,557,200	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	134,057,350	
	第5回利付国債(40年)	75,000,000	102,397,500	
	第6回利付国債(40年)	70,000,000	94,149,300	
	第7回利付国債(40年)	80,000,000	103,524,800	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	115,043,100	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	118,106,300	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	132,910,000	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	144,303,600	
	第12回利付国債(40年)	175,000,000	163,086,000	
	第13回利付国債(40年)	180,000,000	167,239,800	
	第323回利付国債(10年)	45,000,000	45,462,150	
	第325回利付国債(10年)	210,000,000	212,442,300	
	第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,372,600	
	第327回利付国債(10年)	65,000,000	65,905,450	
	第328回利付国債(10年)	115,000,000	116,469,700	
	第329回利付国債(10年)	230,000,000	234,312,500	
	第330回利付国債(10年)	210,000,000	214,456,200	
	第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,334,400	
	第333回利付国債(10年)	210,000,000	214,302,900	
	第334回利付国債(10年)	120,000,000	122,684,400	
	第335回利付国債(10年)	490,000,000	500,196,900	
	第336回利付国債(10年)	80,000,000	81,792,000	
	第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,460,500	
	第338回利付国債(10年)	390,000,000	397,881,900	
	第339回利付国債(10年)	370,000,000	377,980,900	
	第340回利付国債(10年)	420,000,000	429,538,200	
	第341回利付国債(10年)	700,000,000	713,335,000	
	第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,336,400	
	第343回利付国債(10年)	245,000,000	247,592,100	
	第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,542,000	
	第345回利付国債(10年)	610,000,000	616,929,600	
	第346回利付国債(10年)	690,000,000	697,990,200	
	第347回利付国債(10年)	160,000,000	161,934,400	
	第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,105,200	
	第349回利付国債(10年)	590,000,000	597,339,600	
	第350回利付国債(10年)	680,000,000	688,547,600	
	第351回利付国債(10年)	535,000,000	541,789,150	
第352回利付国債(10年)	590,000,000	597,534,300		

第353回利付国債(10年)	300,000,000	303,735,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	328,922,750	
第355回利付国債(10年)	250,000,000	252,912,500	
第356回利付国債(10年)	200,000,000	202,152,000	
第357回利付国債(10年)	820,000,000	828,388,600	
第358回利付国債(10年)	740,000,000	747,133,600	
第359回利付国債(10年)	550,000,000	554,702,500	
第360回利付国債(10年)	200,000,000	201,572,000	
第362回利付国債(10年)	250,000,000	251,335,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	61,670,000	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	138,421,440	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	190,841,280	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	45,606,750	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	141,214,700	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	90,666,800	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	92,880,200	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	73,168,700	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	90,760,960	
第25回利付国債(30年)	20,000,000	26,161,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	225,414,900	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	39,105,340	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	195,016,320	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	236,468,320	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	195,743,730	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	158,242,800	
第32回利付国債(30年)	80,000,000	107,366,400	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	174,410,550	
第34回利付国債(30年)	200,000,000	266,898,000	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	218,383,200	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	176,062,950	
第37回利付国債(30年)	161,000,000	207,511,290	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	120,775,400	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	97,071,000	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	114,702,300	
第41回利付国債(30年)	90,000,000	112,995,900	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	169,662,600	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	194,993,100	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	188,887,500	
第45回利付国債(30年)	160,000,000	194,480,000	
第46回利付国債(30年)	160,000,000	194,596,800	
第47回利付国債(30年)	165,000,000	204,565,350	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	101,662,550	

第49回利付国債(30年)	140,000,000	167,512,800	
第50回利付国債(30年)	95,000,000	100,503,350	
第51回利付国債(30年)	90,000,000	84,680,100	
第52回利付国債(30年)	90,000,000	88,804,800	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	105,936,600	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	116,073,100	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	115,992,800	
第56回利付国債(30年)	90,000,000	94,727,700	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	105,176,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	105,096,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	174,153,100	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	128,736,000	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	102,120,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	116,176,800	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	84,667,500	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	93,918,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	103,136,000	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	168,483,600	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	108,392,900	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	137,769,800	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	111,086,800	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	110,818,400	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	138,449,250	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	33,909,810	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	301,790,900	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	27,535,410	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	32,202,800	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	56,487,780	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	105,116,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	35,653,760	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	35,910,800	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	83,031,780	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	111,952,880	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	120,183,840	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	121,491,950	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	127,284,240	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,842,300	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	22,610,280	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	43,218,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	173,740,800	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	65,721,600	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	144,365,000	

第88回利付国債(20年)	300,000,000	336,429,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,951,680	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	281,817,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	67,335,000	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	67,297,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	56,371,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	93,900,660	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	111,037,920	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	51,506,550	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	106,999,260	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	133,784,820	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	34,659,900	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	77,148,720	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	95,162,850	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,845,800	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	38,072,100	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	89,229,910	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,332,260	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	151,245,900	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	153,877,560	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	31,112,910	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	114,456,160	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,512,250	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	93,796,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	341,164,700	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	61,399,520	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	148,661,250	
第116回利付国債(20年)	55,000,000	65,655,700	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	406,444,710	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,796,800	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	34,850,100	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	194,422,200	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,835,920	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	19,806,870	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	233,397,450	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	106,867,800	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	60,498,500	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	125,005,650	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	76,978,200	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	99,816,350	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	176,622,000	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	14,007,360	

第132回利付国債(20年)	75,000,000	87,756,750
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,415,900
第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,173,500
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,184,000
第136回利付国債(20年)	220,000,000	255,668,600
第137回利付国債(20年)	200,000,000	235,106,000
第138回利付国債(20年)	120,000,000	138,447,600
第139回利付国債(20年)	230,000,000	267,864,900
第140回利付国債(20年)	358,000,000	422,028,300
第141回利付国債(20年)	195,000,000	230,376,900
第142回利付国債(20年)	125,000,000	149,100,000
第143回利付国債(20年)	94,000,000	110,194,320
第144回利付国債(20年)	430,000,000	499,092,400
第145回利付国債(20年)	355,000,000	421,161,350
第146回利付国債(20年)	135,000,000	160,486,650
第147回利付国債(20年)	98,000,000	115,523,380
第148回利付国債(20年)	90,000,000	105,144,300
第149回利付国債(20年)	115,000,000	134,554,600
第150回利付国債(20年)	140,000,000	162,229,200
第151回利付国債(20年)	140,000,000	158,732,000
第152回利付国債(20年)	350,000,000	397,131,000
第153回利付国債(20年)	360,000,000	413,967,600
第154回利付国債(20年)	160,000,000	181,934,400
第155回利付国債(20年)	350,000,000	388,391,500
第156回利付国債(20年)	160,000,000	163,648,000
第157回利付国債(20年)	150,000,000	148,806,000
第158回利付国債(20年)	170,000,000	175,989,100
第159回利付国債(20年)	150,000,000	157,486,500
第160回利付国債(20年)	140,000,000	148,986,600
第161回利付国債(20年)	120,000,000	125,787,600
第162回利付国債(20年)	150,000,000	157,099,500
第163回利付国債(20年)	165,000,000	172,651,050
第164回利付国債(20年)	285,000,000	293,159,550
第165回利付国債(20年)	110,000,000	113,011,800
第166回利付国債(20年)	100,000,000	105,956,000
第167回利付国債(20年)	160,000,000	163,960,000
第168回利付国債(20年)	100,000,000	100,583,000
第169回利付国債(20年)	160,000,000	157,841,600
第170回利付国債(20年)	140,000,000	137,851,000
第171回利付国債(20年)	170,000,000	167,069,200
第172回利付国債(20年)	230,000,000	229,797,600
第173回利付国債(20年)	150,000,000	149,602,500

	第174回利付国債(20年)	200,000,000	199,286,000	
	第175回利付国債(20年)	140,000,000	141,891,400	
	第176回利付国債(20年)	160,000,000	162,038,400	
国債証券 合計		32,729,000,000	35,720,287,750	
地方債証券	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,483,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	100,892,000	
	第709回東京都公募公債	100,000,000	100,780,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	201,920,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	101,804,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	101,724,000	
	第736回東京都公募公債	100,000,000	101,619,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,983,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	102,254,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	201,826,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	203,660,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	203,800,000	
	平成26年度第12回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,398,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	100,895,950	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,389,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	200,000,000	203,864,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,337,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	101,071,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,554,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,612,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,832,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,793,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,941,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,210,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,738,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,145,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	101,041,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	100,369,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	102,052,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	102,015,000	
	第486回名古屋市中区公募公債(10年)	200,000,000	203,774,000	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,938,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,011,000	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,040,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,971,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	100,021,000	
	平成25年度第2回福井県公募公債	200,000,000	203,164,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	100,782,332	

地方債証券 合計		4,600,000,000	4,675,703,282
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,982,000
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,782,000
	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,722,000
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,958,000
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,200,000
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,694,516
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,054,000
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,726,000
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,974,000
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,894,000
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,893,000
	第17回道路債券	100,000,000	102,317,000
	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	112,986,000
	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	114,513,000
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,792,200
	第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,700,720
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,242,000
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,847,000
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,517,000
	第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,468,901
	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	101,924,000
	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	100,024,000
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,878,000
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,808,000
	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,882,000
	第13回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,561,000
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,664,000
	F63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,231,000
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,066,000
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,658,000
	F101回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,532,000
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,332,000
F223回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,490,457	
F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,761,000	
第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	101,156,000	

	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,707,000	
	第38回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,566,056	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	101,954,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,707,000	
	第357回信金中金債(5年)	100,000,000	99,938,000	
	第363回信金中金債(5年)	100,000,000	99,873,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	100,130,000	
特殊債券 合計		4,900,000,000	4,996,105,850	
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	101,847,000	
	第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,303,000	
	第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,512,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,262,000	
	第28回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,886,000	
	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	101,344,000	
	第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,137,000	
	第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,495,000	
	第87回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	202,178,000	
	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	101,881,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	202,270,000	
	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	101,710,000	
	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	100,011,000	
	第19回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,559,000	
	第299回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,382,000	
社債券 合計		1,800,000,000	1,822,777,000	
合計		44,029,000,000	47,214,873,882	

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）

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	117,032,026	85,726,636
コール・ローン	24,996,412	93,723,484
国債証券	153,910,236,897	157,224,720,729
派生商品評価勘定	204,135	-
未収入金	221,277,609	-
未収利息	897,265,978	894,291,366
前払費用	20,320,086	15,198,463
流動資産合計	155,191,333,143	158,313,660,678
資産合計	155,191,333,143	158,313,660,678
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	382,680	-
未払解約金	212,848,694	86,760,800
未払利息	12	9
流動負債合計	213,231,386	86,760,809
負債合計	213,231,386	86,760,809
純資産の部		
元本等		
元本	62,161,310,314	61,765,152,571
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	92,816,791,443	96,461,747,298
元本等合計	154,978,101,757	158,226,899,869
純資産合計	154,978,101,757	158,226,899,869
負債純資産合計	155,191,333,143	158,313,660,678

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
1.	期首	2020年 6月16日	2020年12月16日
	期首元本額	62,363,102,520円	62,161,310,314円
	期首からの追加設定元本額	2,063,425,421円	1,654,984,705円
	期首からの一部解約元本額	2,265,217,627円	2,051,142,448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）	13,775,382,228円	14,223,403,295円
	DCインデックスバランス（株式20）	301,866,652円	330,974,579円
	DCインデックスバランス（株式40）	392,753,635円	433,736,361円
	DCインデックスバランス（株式60）	503,149,574円	568,664,896円
	DCインデックスバランス（株式80）	391,697,366円	459,978,672円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	21,929,960,980円	21,607,122,055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	2,007,884,611円	2,225,911,412円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	15,667,140,877円	14,933,451,248円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	995,434,380円	909,513,094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）	154,726,575円	158,364,070円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	- 円	768,180円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,598,118円	2,703,044円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2,725,686円	2,862,916円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,186,086円	6,050,990円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	11,064,903円	10,684,961円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	785,291,324円	781,105,925円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	782,118,041円	762,476,464円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,569,735円	61,901,981円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	86,758,487円	88,119,511円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	85,636,516円	88,562,550円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	60,036,248円	63,794,369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	3,878,012,214円	3,772,615,369円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,316,078円	272,386,629円

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
	計	62,161,310,314円	61,765,152,571円
2.	受益権の総数	62,161,310,314口	61,765,152,571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 6月16日 至 2020年12月15日	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	513,345,863
合計	513,345,863

（2021年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,091,508,790
合計	6,091,508,790

（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）

（2020年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	317,011,907	-	317,190,452	178,545
	米ドル	135,265,510	-	135,343,000	77,490
	加ドル	6,201,600	-	6,203,880	2,280
	メキシコペソ	34,051,035	-	33,846,900	204,135
	ユーロ	102,598,485	-	102,799,200	200,715

	英ポンド	31,027,431	-	31,118,080	90,649
	豪ドル	7,867,846	-	7,879,392	11,546
	合計	317,011,907	-	317,190,452	178,545

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2021年 6月15日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年12月15日現在		2021年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.4932円	1口当たり純資産額	2.5618円
(1万口当たり純資産額)	(24,932円)	(1万口当たり純資産額)	(25,618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-1.875%-22/05/31	3,420,000.00	3,479,481.66	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/06/15	3,000,000.00	3,050,190.60	

US TREASURY N/B-2.125%-22/06/30	2,500,000.00	2,553,550.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/06/30	2,500,000.00	2,543,784.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/07/15	4,000,000.00	4,072,500.00	
US TREASURY N/B-2.0%-22/07/31	3,930,000.00	4,015,200.82	
US TREASURY N/B-1.875%-22/07/31	5,700,000.00	5,815,447.23	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	4,500,000.00	4,581,562.50	
US TREASURY N/B-1.5%-22/08/15	2,600,000.00	2,643,163.90	
US TREASURY N/B-1.875%-22/08/31	1,900,000.00	1,941,005.80	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/31	2,750,000.00	2,800,971.52	
US TREASURY N/B-1.5%-22/09/15	1,950,000.00	1,984,125.00	
US TREASURY N/B-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,625,783.98	
US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,410,000.00	2,465,307.57	
US TREASURY N/B-0.125%-22/09/30	1,100,000.00	1,100,386.65	
US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	3,050,917.80	
US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,072,890.40	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,462,437.44	
US TREASURY N/B-0.125%-22/10/31	8,000,000.00	8,002,187.20	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,042,812.40	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,503,775.00	
US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,086,138.88	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	4,020,351.27	
US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,065,390.40	
US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,052,773.40	
US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,637,706.97	
US TREASURY N/B-0.125%-23/01/31	3,000,000.00	2,999,824.23	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,371,335.88	
US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,531,083.90	
US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,172,232.17	
US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	917,468.72	
US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,012,812.40	
US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,048,750.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,219,859.37	
US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,506,904.10	
US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,192,035.83	
US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,775,359.24	

US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,730,949.02	
US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,968,549.80	
US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,542,949.20	
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,365,939.38	
US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,504,541.00	
US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,536,972.60	
US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	1,000,000.00	1,050,195.30	
US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,677,382.81	
US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,068,671.80	
US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,164,296.80	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,565,620.63	
US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	860,000.00	858,975.38	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	1,850,000.00	1,898,490.16	
US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,995,253.91	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,567,285.00	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	700,425.00	
US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,397,292.97	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,756,777.28	
US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	956,742.12	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,244,062.40	
US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	8,000,000.00	8,006,718.40	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,804,996.80	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,927,579.22	
US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,992,207.02	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,101,953.00	
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	3,000,000.00	3,181,406.10	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,104,843.60	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,668,640.43	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,519,527.22	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,575,585.90	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,722,642.51	
US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,996,484.40	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	4,057,825.00	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,097,343.60	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,167,226.30	

US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,596,266.93	
US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,600,000.00	2,594,921.88	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,061,534.42	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,416,078.01	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,774,192.73	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,627,436.29	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	2,640,000.00	2,755,087.36	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,915,066.00	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,487,838.22	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,364,417.94	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	2,129,130.80	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,279,921.82	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,157,145.63	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,927,642.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,750,000.00	3,982,763.62	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,481,429.60	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,596,871.87	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	2,020,234.28	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,358,956.95	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,609,511.70	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,770,000.00	3,890,905.03	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,970,000.00	5,243,543.83	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,230,674.09	
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,575,131.25	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,749,077.96	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,568,834.76	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,398,171.82	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,136,226.56	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,093,812.32	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,254,892.53	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	1,995,026.17	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,489,339.74	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,573,987.39	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,956,406.25	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,309,434.12	

US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,266,718.60	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,172,019.12	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	320,000.00	314,662.49	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,542,078.02	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	3,800,000.00	3,732,238.28	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,496,587.50	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,448,467.94	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,374,244.12	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,173,320.20	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	2,011,513.51	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	5,000,000.00	4,921,191.40	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,237,765.58	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,447,313.02	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,937,185.43	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,610,149.40	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,216,961.72	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	400,000.00	399,968.75	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	6,100,000.00	6,571,439.11	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	5,038,326.26	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,919,277.10	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,105,898.40	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	2,960,000.00	3,117,423.16	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,135,000.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,684,515.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,546,564.30	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	5,040,000.00	5,338,659.31	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,982,725.85	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,092,148.40	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,063,906.20	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	4,360,000.00	4,677,036.52	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	1,010,332.00	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,187,407.02	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	972,871.09	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,812,882.55	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,553,406.25	

US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,500,000.00	3,393,701.18	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,921,367.18	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	3,175,235.80	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	1,200,000.00	1,159,781.25	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,590,000.00	4,394,835.35	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	5,000,000.00	4,816,894.55	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,761,234.90	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,239,362.83	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	760,000.00	736,042.17	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	5,000,000.00	4,875,781.25	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,418,359.20	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	1,200,000.00	1,198,218.74	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	1,670,000.00	1,678,871.87	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,000,000.00	3,014,062.50	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,499,319.64	
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	648,691.40	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,678,816.38	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,376,538.20	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,108,191.51	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,970,000.00	5,454,283.75	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,188,050.66	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,640,000.00	3,721,331.06	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	2,890,000.00	2,980,312.50	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,375,431.76	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,495,800.76	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	6,590,000.00	6,143,373.03	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	4,090,000.00	3,799,066.79	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,750,000.00	5,449,023.43	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	895,782.36	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,000,000.00	3,869,375.00	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	3,000,000.00	3,034,921.80	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	1,085,906.24	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,081,347.60	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	911,029.82	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	220,000.00	303,462.50	

US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	986,968.72	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,956,820.24	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,974,742.88	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,028,818.35	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	962,332.80	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,190,069.65	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,131,052.73	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,864,968.62	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	1,700,000.00	1,433,677.72	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,372,219.12	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,730,664.07	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,167,617.15	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,203,522.59	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,227,487.48	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	586,904.25	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	886,312.48	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,214,375.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	2,072,875.12	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,316,820.21	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	2,020,000.00	2,558,929.53	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	2,698,385.83	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	2,480,000.00	3,151,246.72	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	2,940,374.88	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,534,648.33	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,658,117.13	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,502,125.00	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	3,200,000.00	3,704,000.00	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,400,000.00	3,856,210.64	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	3,300,000.00	3,828,386.43	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	2,973,250.00	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,655,078.00	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,177,210.83	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,274,453.00	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,258,991.96	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,122,042.95	

		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,227,382.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,163,660.03	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,208,583.95	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,866,452.96	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	4,790,513.39	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,687,615.05	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	3,863,900.37	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,433,535.10	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	2,982,092.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,220,548.77	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	3,542,822.26	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,944,735.34	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	2,107,098.82	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	2,621,718.75	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	4,414,160.18	
米ドル小計			600,200,000.00	631,768,302.65 (69,564,007,804)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	980,000.00	1,004,026.66	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/08/01	810,000.00	810,348.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-22/09/01	1,691,000.00	1,707,098.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/11/01	1,440,000.00	1,439,917.92	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/02/01	770,000.00	769,719.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,265,004.69	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/05/01	740,000.00	738,967.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,043,431.44	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,522,562.79	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	828,249.43	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	880,000.00	873,852.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,186,085.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	819,143.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	860,000.00	879,513.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	1,009,221.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,142,626.89	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	967,635.51	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,070,000.00	1,103,385.07	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	860,000.00	860,670.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	917,000.00	972,999.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	820,000.00	1,102,275.16	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	674,000.00	728,119.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	2,183,537.16	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	850,000.00	782,878.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,142,902.69	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	700,000.00	1,025,721.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	820,000.00	1,122,688.24	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	990,000.00	1,301,668.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	995,000.00	1,168,774.76	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	1,938,000.00	1,955,224.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	405,950.65	
			33,638,000.00	35,864,202.39	
				(3,252,165,872)	
	加ドル小計				
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	20,200,000.00	20,559,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	16,000,000.00	16,490,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	17,900,000.00	19,041,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	15,900,000.00	17,008,031.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	18,100,000.00	20,554,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	22,250,000.00	22,013,593.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,800,000.00	22,113,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	19,570,000.00	22,028,481.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	13,900,000.00	15,016,343.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,800,000.00	7,288,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	5,600,000.00	7,131,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,650,000.00	14,168,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	13,700,000.00	14,290,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	12,170,000.00	12,999,081.25	
			215,540,000.00	230,703,093.75	
	メキシコペソ小計			(1,272,927,390)	

ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	250,000.00	207,084.90
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,050,000.00	1,117,179.00
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	910,000.00	964,279.86
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	550,000.00	561,148.11
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	975,000.00	1,071,388.98
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	890,000.00	923,965.33
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,145,000.00	1,208,639.10
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	770,000.00	957,628.98
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,032,000.00	1,109,522.80
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	860,000.00	921,748.00
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	335,000.00	342,165.30
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,375,000.00	1,928,330.25
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,038,767.49
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,055,000.00	1,145,152.91
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	880,000.00	893,547.51
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,100,000.00	1,209,395.00
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	939,860.46
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	910,000.00	1,026,852.19
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	673,000.00	909,474.09
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,445,000.00	2,368,659.89
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	489,981.43
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	945,000.00	1,160,830.91
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	317,046.18
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,187,000.00	1,991,464.32
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	665,000.00	1,103,341.32
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	907,249.42
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	450,000.00	542,122.51
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	379,000.00	526,610.44
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	386,000.00	538,245.73
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	445,000.00	396,871.02
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%-22/10/31	1,420,000.00	1,440,342.92
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,563,906.57
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-	1,313,000.00	1,326,785.84		

23/04/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%- 23/07/30	1,290,000.00	1,315,081.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,540,000.00	1,722,697.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,230,000.00	1,403,129.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,340,000.00	1,506,551.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 24/05/31	750,000.00	760,027.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	1,090,000.00	1,114,644.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,720,000.00	1,908,383.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 25/01/31	1,330,000.00	1,350,105.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,450,000.00	1,563,933.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,630,000.00	1,971,837.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,745,000.00	1,938,454.19	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 26/01/31	440,000.00	445,980.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,535,000.00	1,704,001.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,490,000.00	1,964,370.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,820,000.00	1,971,600.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,620,234.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,445,000.00	1,525,139.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,600,000.00	1,756,288.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	200,000.00	200,191.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,670,000.00	1,831,683.22	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-	1,475,000.00	1,620,619.37	

28/07/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,155,000.00	1,589,836.71	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,855,000.00	2,693,678.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,495,000.00	1,651,037.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,470,000.00	1,521,001.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,520,000.00	1,553,484.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,660,000.00	1,912,157.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,660,000.00	1,803,673.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,305,000.00	1,268,798.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,700,000.00	2,676,387.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,370,000.00	1,653,774.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,415,000.00	1,622,831.22	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,400,000.00	2,096,897.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%- 37/07/30	130,000.00	128,419.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,360,000.00	2,288,814.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%- 40/10/31	1,000,000.00	1,019,732.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,510,000.00	2,507,413.73	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	940,000.00	1,706,207.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,170,000.00	1,587,373.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	985,000.00	1,297,622.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 50/10/31	1,170,000.00	1,061,645.13	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-	848,000.00	1,316,485.72	

66/07/30		
BUNDESobligation-0.0%-22/10/07	1,000,000.00	1,009,108.00
BUNDESobligation-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,772,608.25
BUNDESobligation-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,123,772.84
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,325,879.75
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,391,851.20
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	2,350,000.00	2,411,429.00
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	450,000.00	462,946.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,070,000.00	2,123,221.77
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	1,600,000.00	1,643,180.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	1,970,385.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,793,152.11
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	1,959,875.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	932,710.34
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,311,924.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,875,000.00	1,997,733.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,930,606.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,848,927.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,540,000.00	2,719,750.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,685,000.00	2,831,064.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,320,000.00	2,393,864.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,525,000.00	2,645,177.37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,625,481.27
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,265,000.00	2,412,972.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-	1,150,000.00	1,187,549.80

27/11/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,627,093.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,845,000.00	1,971,014.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,170,000.00	1,614,024.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,757,204.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	2,085,000.00	2,194,479.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,450,000.00	1,495,486.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	2,026,393.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,410,000.00	1,452,546.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	985,000.00	1,012,554.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	420,000.00	433,895.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,744,700.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	640,000.00	655,980.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,265,000.00	2,085,334.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	1,201,942.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	992,223.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,915,451.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	2,175,335.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,730,000.00	3,274,995.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,580,894.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	2,855,000.00	4,372,929.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-	2,692,000.00	4,203,886.15	

46/08/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	2,566,040.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,180,000.00	1,080,293.09
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/09/16	2,630,000.00	2,652,473.35
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/12/15	650,000.00	656,652.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	300,363.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.0%- 22/07/15	940,000.00	954,889.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 22/08/01	1,270,000.00	1,289,429.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,700,000.00	1,822,259.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 22/09/15	1,310,000.00	1,340,802.03
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,163,378.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 23/01/15	600,000.00	604,635.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	931,153.13
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,228,335.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,365,000.00	1,491,234.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 23/06/15	1,000,000.00	1,019,900.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,886,235.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 23/08/15	720,000.00	730,127.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,310,000.00	1,394,369.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,160,000.00	1,187,102.93
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	1,051,304.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/15	700,000.00	705,302.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	1,650,000.00	1,864,196.40

24/03/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/04/15	260,000.00	261,841.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,141,338.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,360,000.00	1,442,076.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,450,000.00	1,634,981.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	950,000.00	1,003,172.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,480,000.00	1,616,956.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,511,792.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,834,448.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	1,175,000.00	1,246,737.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,400,000.00	1,489,317.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	1,077,766.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,445,927.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,480,000.00	1,614,360.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	940,000.00	961,514.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,730,000.00	2,097,039.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	200,000.00	199,665.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,324,243.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,345,544.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	1,220,000.00	1,687,572.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,565,000.00	1,661,247.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-	1,080,000.00	1,121,410.44	

27/01/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,296,693.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,395,000.00	1,547,901.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,145,000.00	1,193,371.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,060,000.00	2,868,809.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,885,000.00	2,092,809.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	80,000.00	79,525.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,740,459.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,735,000.00	2,037,016.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,380,000.00	1,653,238.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,050,000.00	2,843,388.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,800,000.00	2,244,911.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,700,000.00	1,808,485.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	1,197,895.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,352,000.00	1,470,175.61	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,100,000.00	1,118,095.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,230,000.00	3,353,407.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	295,000.00	290,235.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,685,000.00	1,826,592.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,690,000.00	2,593,804.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	1,332,893.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-	1,580,000.00	2,343,133.68	

34/08/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	1,150,000.00	1,477,295.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	933,876.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	900,000.00	1,032,344.19
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,205,000.00	3,063,892.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,498,520.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,850,000.00	2,933,110.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	610,000.00	778,309.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,720,000.00	2,752,319.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	874,883.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,345,000.00	2,172,176.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	260,000.00	255,589.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	1,486,637.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,541,153.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,265,000.00	1,740,985.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	1,025,000.00	1,511,149.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	1,180,000.00	1,367,747.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	600,000.00	590,031.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	823,232.68
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	365,000.00	375,576.24
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	330,000.00	343,241.25
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	250,000.00	253,824.17
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	440,000.00	473,727.76
	365,000.00	372,585.79

FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15			
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	505,440.17	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	339,865.92	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	561,932.70	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	422,808.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	463,615.20	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	285,667.56	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	486,029.56	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	475,000.00	512,599.10	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	409,910.51	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	495,000.00	483,760.03	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	115,000.00	111,547.93	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	355,000.00	515,385.45	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	316,600.44	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	218,274.74	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	394,948.86	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	2,750,000.00	2,860,038.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	2,980,000.00	3,014,549.52	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,124,713.92	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,308,216.64	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,930,000.00	4,387,968.79	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,430,798.49	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,994,000.00	3,248,961.55	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	3,458,000.00	3,738,633.99	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	1,665,000.00	1,699,182.45	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,717,642.40	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,550,000.00	3,287,452.35	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,070,000.00	3,276,994.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,838,912.40	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,670,415.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,075,000.00	2,174,108.22	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,700,000.00	2,796,282.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,590,000.00	2,800,366.53	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,230,000.00	3,871,316.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	2,870,000.00	3,070,722.06	

FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	2,760,000.00	2,956,180.80
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,745,000.00	3,980,519.01
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	2,520,000.00	2,647,464.12
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,700,000.00	2,717,415.00
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,175,000.00	3,903,157.67
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	2,689,000.00	2,683,608.55
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,295,000.00	3,769,367.97
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-31/11/25	365,000.00	360,355.37
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,540,000.00	4,155,107.26
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	3,595,000.00	4,029,053.11
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	2,435,000.00	3,910,965.51
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,825,000.00	3,167,028.40
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	2,320,000.00	3,685,867.52
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,710,000.00	3,288,070.10
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,265,439.71
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	300,000.00	286,311.60
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,630,000.00	2,536,263.70
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,660,000.00	2,128,790.64
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	2,090,000.00	2,417,824.86
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,490,000.00	1,414,857.81
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,300,000.00	2,451,304.18
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,140,000.00	2,243,897.34
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	1,033,132.65
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	135,000.00	136,112.40
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	540,000.00	582,993.23
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	590,000.00	654,880.05
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	840,000.00	1,027,140.24
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	775,000.00	829,470.87
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	504,647.08
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	615,000.00	662,166.81
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	700,000.00	765,616.60
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	696,000.00	846,122.32
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	110,000.00	111,485.99
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	770,000.00	867,103.93
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	140,000.00	137,874.98

IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	399,282.70
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	410,000.00	411,304.62
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	463,612.50
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	245,239.23
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	634,000.00	811,307.61
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	414,000.00	479,591.26
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	1,208,000.00	1,246,566.83
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	380,354.10
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	525,000.00	594,123.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,210,000.00	1,272,786.53
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	1,140,000.00	1,161,075.18
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,250,000.00	1,354,429.75
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,205,000.00	1,248,500.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,195,000.00	1,259,292.19
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	923,000.00	947,646.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,125,000.00	1,208,377.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	925,000.00	1,291,173.27
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	1,038,069.31
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	765,000.00	797,679.27
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	745,000.00	757,796.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	900,000.00	1,168,056.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,847,832.76
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	973,000.00	1,025,211.18
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,205,000.00	2,067,741.19
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,213,000.00	1,951,287.59
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	615,000.00	547,620.60
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	225,600.99
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	662,650.88
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	175,262.40
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-22/09/20	355,000.00	357,929.10
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	940,000.00	995,017.54
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	435,201.28
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	577,700.70
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	970,000.00	1,024,950.50
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	565,462.86

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	920,926.31	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	200,000.00	204,391.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	764,855.31	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	700,000.00	881,794.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	910,000.00	970,065.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	722,072.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	959,431.04	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	620,000.00	664,767.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	640,000.00	675,420.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	660,000.00	666,692.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	210,000.00	210,457.29	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	670,000.00	862,953.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,075,000.00	1,721,778.26	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	110,000.00	100,675.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	504,000.00	801,485.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	603,000.00	737,297.74	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	335,000.00	344,309.31	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	293,000.00	608,176.58	
		ユーロ小計	408,115,000.00	482,456,386.11 (64,383,804,726)	
英債券	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	575,000.00	687,918.50	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,670,000.00	1,705,113.42	
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,710,000.00	1,711,812.60	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,410,000.00	1,478,601.01	
		UK TREASURY-0.125%-24/01/31	570,000.00	569,806.20	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,130,000.00	1,158,329.10	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	948,234.17	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,420,634.75	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	1,393,000.00	1,416,635.03	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	1,110,000.00	1,100,953.50	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	1,150,000.00	1,217,670.60	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,370,000.00	1,436,623.10	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,129,319.10	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	775,000.00	754,423.75	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	1,190,000.00	1,281,868.00	

UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	990,877.77	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	1,266,000.00	1,286,213.20	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,220,000.00	1,176,385.00	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,469,684.96	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	145,000.00	136,495.75	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,855,554.85	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,361,930.58	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	697,000.00	653,897.52	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	1,965,636.81	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,563,271.78	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,210,000.00	1,904,007.60	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,170,000.00	1,762,991.33	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	1,135,000.00	1,738,220.03	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	525,000.00	525,667.80	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,281,755.06	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,665,000.00	2,319,811.20	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,770,000.00	2,581,724.82	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	375,000.00	342,585.00	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,275,000.00	2,103,252.75	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,520,000.00	1,596,997.12	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	620,000.00	689,477.38	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,045,000.00	1,793,442.79	
UK TREASURY-0.625%-50/10/22	390,000.00	328,469.70	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,107,000.00	1,817,190.31	
UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	697,858.65	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,322,000.00	2,439,076.78	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,237,120.75	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,036,000.00	1,930,099.08	
UK TREASURY-0.5%-61/10/22	420,000.00	327,520.20	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	980,000.00	1,810,403.00	
UNITED KINGDOM GILT-0.5%-22/07/22	1,735,000.00	1,744,077.52	
UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,648,790.00	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	951,224.55	
UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,177,000.00	1,709,253.52	
	53,387,000.00	66,758,907.99	

英ポンド小計				(10,373,666,712)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	7,550,000.00	7,828,987.60
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,460,000.00	6,743,828.49
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,220,000.00	5,779,521.36
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,200,000.00	5,506,280.00
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	4,135,255.00
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	4,100,000.00	4,289,235.50
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,548,656.05
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	2,157,039.00
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,385,000.00	4,954,186.14
スウェーデンクローナ小計			40,265,000.00	43,942,989.14 (580,926,316)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,670,000.00	5,830,496.72
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,600,235.08
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,090,000.00	3,180,367.05
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,803,064.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,840,000.00	2,928,324.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	2,870,066.70
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	2,855,925.40
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,350,000.00	3,343,048.75
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,190,000.00	2,150,142.00
ノルウェークローネ小計			29,740,000.00	30,561,669.70 (404,025,273)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.25%-22/11/15	4,400,000.00	4,449,296.72
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	5,020,000.00	5,271,411.64
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,960,000.00	6,547,200.65
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,510,000.00	4,736,379.45
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	1,750,000.00	1,839,958.75
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	150,000.00	148,954.06
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,780,000.00	20,698,402.40
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,000,000.00	922,980.00
デンマーククローネ小計			34,570,000.00	44,614,583.67 (800,831,776)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-22/07/25	2,200,000.00	2,199,340.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,720,000.00	1,843,152.00

		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,175,222.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-23/04/25	560,000.00	557,228.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,970,000.00	2,138,474.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,290,000.00	2,419,430.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,430,000.00	2,558,644.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,437,436.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,890,000.00	3,161,428.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,300,000.00	3,513,048.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	400,000.00	379,164.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,340,000.00	2,498,792.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,360,000.00	2,569,804.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	655,000.00	861,783.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	3,255,000.00	3,549,675.15	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,225,000.00	2,134,887.50	
		ポーランドズロチ小計	32,135,000.00	33,997,511.55 (1,001,362,705)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	1,650,000.00	1,752,865.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,360,000.00	1,403,555.36	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,480,000.00	1,630,170.27	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	805,000.00	867,232.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	2,015,000.00	2,015,001.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,510,000.00	1,676,591.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,230,000.00	1,215,921.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,500,000.00	1,762,670.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,560,000.00	1,543,780.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,570,000.00	1,925,575.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,460,000.00	1,627,216.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,180,000.00	1,278,256.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	1,090,000.00	1,220,034.92	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,500,000.00	1,737,664.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,560,000.00	1,749,697.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	2,390,000.00	2,629,515.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	2,220,000.00	2,140,278.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,778,000.00	1,787,888.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,770,000.00	1,686,911.24	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,536,324.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	310,000.00	315,866.03	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,364,934.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	594,261.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	850,000.00	1,063,336.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	780,340.11	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	890,000.00	972,632.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	970,000.00	1,097,684.49	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	883,427.98	
豪ドル小計			37,475,000.00	40,259,636.99	(3,418,445,776)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	525,000.00	543,164.42	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	630,000.00	644,606.55	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	571,650.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	190,000.00	197,790.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	582,768.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	410,000.00	438,495.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	74,000.00	73,437.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	400,000.00	426,034.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	560,000.00	638,512.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	365,000.00	401,682.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	560,250.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	485,000.00	546,956.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	445,000.00	529,995.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	535,373.61	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	190,000.00	207,613.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	317,000.00	368,671.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	457,000.00	540,631.00	
SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	469,000.00	477,653.05			
シンガポールドル小計			7,603,000.00	8,285,283.55	(687,595,681)
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	779,423.24	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	650,632.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	800,000.00	830,600.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	575,000.00	595,498.75	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	875,235.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	337,390.08	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,350,000.00	1,428,705.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	824,070.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	750,000.00	799,875.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,163,799.94	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,520,000.00	1,597,520.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	380,000.00	360,430.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	759,236.45	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,097,250.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	600,000.00	625,318.74	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,040,000.00	1,125,280.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	642,279.01	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,240,000.00	1,176,304.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	617,244.22	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	760,692.09	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	848,335.65	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	870,000.00	836,070.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	850,000.00	865,978.81	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,330,000.00	1,365,311.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	992,640.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,070,000.00	1,161,638.97	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	477,056.97	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	982,300.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	790,000.00	827,525.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	993,614.98	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,102,628.76	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	993,151.11	
		マレーシアリングット小計	27,320,000.00	28,493,036.07	(762,638,904)
イスラエル エルシュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.75%-22/07/31	1,080,000.00	1,088,634.81	
		ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,017,103.40	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,390,000.00	1,492,652.47	
		ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	930,000.00	929,199.27	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,200,000.00	1,239,604.92	

	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,558,438.35	
	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,260,000.00	1,263,742.07	
	ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,400,000.00	1,484,548.52	
	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,200,000.00	1,556,290.68	
	ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,500,000.00	1,608,503.40	
	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,361,994.87	
	ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,475,000.00	1,447,886.24	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,140,000.00	1,069,586.29	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,400,000.00	2,207,180.50	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,560,000.00	1,967,615.20	
イスラエルシュケル小計		19,205,000.00	21,292,980.99 (722,321,794)	
合計			157,224,720,729 (157,224,720,729)	

(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 227銘柄	100.0%	44.1%
加ドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 329銘柄	100.0%	41.0%
英ポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	150,832,372	113,099,844
株式	35,971,615,820	39,658,539,130
派生商品評価勘定	822,250	2,824,000
未収入金	50,423,950	-
未収配当金	9,670,870	241,649,762
流動資産合計	36,183,365,262	40,016,112,736
資産合計	36,183,365,262	40,016,112,736
負債の部		
流動負債		
前受金	1,275,000	355,000
未払金	22,719,400	-
未払解約金	92,295,954	3,468,252
未払利息	78	11
流動負債合計	116,290,432	3,823,263
負債合計	116,290,432	3,823,263
純資産の部		
元本等		
元本	21,288,735,361	21,062,249,461
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	14,778,339,469	18,950,040,012
元本等合計	36,067,074,830	40,012,289,473
純資産合計	36,067,074,830	40,012,289,473
負債純資産合計	36,183,365,262	40,016,112,736

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</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p>
--------------------	---

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

(貸借対照表に関する注記)

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
1.	期首	2020年 6月16日	2020年12月16日
	期首元本額	21,851,680,688円	21,288,735,361円
	期首からの追加設定元本額	864,828,821円	1,145,710,249円
	期首からの一部解約元本額	1,427,774,148円	1,372,196,149円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	687,295,762円	674,884,947円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,728,745,773円	1,768,086,641円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,334,160,799円	3,497,192,186円
	DCインデックスバランス（株式80）	3,448,560,834円	3,751,992,346円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,310,924,013円	1,340,664,541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	3,077,232,515円	3,013,674,301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）	683,484,810円	633,500,537円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	46,064,306円	43,611,526円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	36,161,329円	35,027,324円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	55,712,416円	49,066,520円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	48,733,955円	43,386,695円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,584,783,014円	3,102,985,720円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	274,696,183円	251,031,064円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	765,283,581円	719,456,282円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,131,042,939円	1,090,176,263円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,075,853,132円	1,047,512,568円
	計	21,288,735,361円	21,062,249,461円
2.	受益権の総数	21,288,735,361口	21,062,249,461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	411,530,000円	516,935,000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 6月16日 至 2020年12月15日	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2020年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,305,374,272
合計	3,305,374,272

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,865,238,896
合計	6,865,238,896

(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)

(2020年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	88,050,000	-	88,875,000	825,000
	合計	88,050,000	-	88,875,000	825,000

(2021年 6月15日現在)

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	391,665,000	-	394,500,000	2,835,000
合計		391,665,000	-	394,500,000	2,835,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年12月15日現在		2021年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.6942円	1口当たり純資産額	1.8997円
(1万口当たり純資産額)	(16,942円)	(1万口当たり純資産額)	(18,997円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	2,949.00	2,064,300	
日本水産	18,300	546.00	9,991,800	
マルハニチロ	3,100	2,457.00	7,616,700	
雪国まいたけ	1,600	1,729.00	2,766,400	
カネコ種苗	600	1,480.00	888,000	
サカタのタネ	2,400	3,850.00	9,240,000	
ホクト	1,600	1,936.00	3,097,600	
ホクリヨウ	400	770.00	308,000	

住石ホールディングス	3,700	128.00	473,600
日鉄鉱業	500	6,240.00	3,120,000
三井松島ホールディングス	800	988.00	790,400
I N P E X	73,000	810.00	59,130,000
石油資源開発	2,500	1,997.00	4,992,500
K & O エナジーグループ	900	1,349.00	1,214,100
ヒノキヤグループ	500	2,624.00	1,312,000
ショーボンドホールディングス	2,800	4,655.00	13,034,000
ミライト・ホールディングス	6,900	1,943.00	13,406,700
サンヨーホームズ	300	736.00	220,800
日本アクア	900	561.00	504,900
ファーストコーポレーション	700	757.00	529,900
ベステラ	400	1,630.00	652,000
キャンディル	500	566.00	283,000
スペースバリューホールディングス	2,500	668.00	1,670,000
ダイセキ環境ソリューション	500	922.00	461,000
第一カッター興業	600	1,417.00	850,200
安藤・間	12,800	814.00	10,419,200
東急建設	5,900	747.00	4,407,300
コムシスホールディングス	7,100	3,205.00	22,755,500
ピーアールホールディングス	2,800	505.00	1,414,000
高松コンストラクショングループ	1,300	2,040.00	2,652,000
東建コーポレーション	600	10,140.00	6,084,000
ソネック	300	970.00	291,000
ヤマウラ	900	897.00	807,300
オリエンタル白石	7,000	289.00	2,023,000
大成建設	14,300	3,620.00	51,766,000
大林組	45,900	929.00	42,641,100
清水建設	43,000	864.00	37,152,000
飛島建設	1,400	1,056.00	1,478,400
長谷工コーポレーション	15,100	1,511.00	22,816,100
松井建設	1,900	727.00	1,381,300
銭高組	200	4,250.00	850,000
鹿島建設	33,700	1,427.00	48,089,900
不動テトラ	1,200	1,835.00	2,202,000
大末建設	700	1,026.00	718,200
鉄建建設	1,000	1,875.00	1,875,000
西松建設	3,300	3,370.00	11,121,000
三井住友建設	11,200	483.00	5,409,600
大豊建設	1,000	3,980.00	3,980,000
前田建設工業	11,500	984.00	11,316,000
ナカノフドー建設	1,300	398.00	517,400

奥村組	2,500	2,905.00	7,262,500
東鉄工業	2,000	2,338.00	4,676,000
イチケン	400	1,844.00	737,600
富士ピー・エス	700	567.00	396,900
浅沼組	600	4,510.00	2,706,000
戸田建設	19,100	764.00	14,592,400
熊谷組	2,100	2,825.00	5,932,500
北野建設	300	2,370.00	711,000
植木組	500	1,504.00	752,000
矢作建設工業	2,100	707.00	1,484,700
ピーエス三菱	1,600	640.00	1,024,000
日本ハウスホールディングス	3,300	352.00	1,161,600
大東建託	5,000	12,160.00	60,800,000
新日本建設	2,000	854.00	1,708,000
N I P P O	3,800	3,165.00	12,027,000
東亜道路工業	300	4,565.00	1,369,500
前田道路	2,900	2,210.00	6,409,000
日本道路	400	8,010.00	3,204,000
東亜建設工業	1,200	2,472.00	2,966,400
日本国土開発	4,600	585.00	2,691,000
若築建設	900	1,417.00	1,275,300
東洋建設	5,300	577.00	3,058,100
五洋建設	19,500	798.00	15,561,000
福田組	500	4,900.00	2,450,000
住友林業	10,800	2,218.00	23,954,400
日本基礎技術	1,600	514.00	822,400
巴コーポレーション	2,200	380.00	836,000
大和ハウス工業	42,400	3,280.00	139,072,000
ライト工業	2,600	1,812.00	4,711,200
積水ハウス	49,800	2,217.50	110,431,500
日特建設	1,300	766.00	995,800
北陸電気工事	900	1,224.00	1,101,600
ユアテック	2,700	737.00	1,989,900
日本リーテック	1,000	1,700.00	1,700,000
四電工	300	3,290.00	987,000
中電工	2,100	2,310.00	4,851,000
関電工	7,500	886.00	6,645,000
きんでん	9,300	1,853.00	17,232,900
東京エネシス	1,600	984.00	1,574,400
トーエネック	500	3,680.00	1,840,000
住友電設	1,300	2,334.00	3,034,200
日本電設工業	2,500	1,842.00	4,605,000

協和エクシオ	7,000	2,755.00	19,285,000
新日本空調	1,300	2,055.00	2,671,500
九電工	3,200	3,465.00	11,088,000
三機工業	3,300	1,412.00	4,659,600
日揮ホールディングス	15,400	1,050.00	16,170,000
中外炉工業	500	1,985.00	992,500
ヤマト	1,600	783.00	1,252,800
太平電業	1,000	2,673.00	2,673,000
高砂熱学工業	4,200	1,898.00	7,971,600
三晃金属工業	200	2,401.00	480,200
朝日工業社	400	2,970.00	1,188,000
明星工業	3,100	746.00	2,312,600
大気社	2,200	3,435.00	7,557,000
ダイダン	1,000	2,636.00	2,636,000
日比谷総合設備	1,500	1,839.00	2,758,500
フィル・カンパニー	300	3,000.00	900,000
テスホールディングス	900	1,790.00	1,611,000
東洋エンジニアリング	2,000	715.00	1,430,000
レイズネクスト	2,500	1,147.00	2,867,500
ニッポン	4,300	1,581.00	6,798,300
日清製粉グループ本社	16,600	1,694.00	28,120,400
日東富士製粉	100	7,010.00	701,000
昭和産業	1,200	2,980.00	3,576,000
鳥越製粉	1,300	790.00	1,027,000
中部飼料	1,800	1,169.00	2,104,200
フィード・ワン	2,000	752.00	1,504,000
東洋精糖	200	1,205.00	241,000
日本甜菜製糖	800	1,640.00	1,312,000
D M三井製糖ホールディングス	1,200	1,874.00	2,248,800
塩水港精糖	1,800	226.00	406,800
日新製糖	700	1,732.00	1,212,400
森永製菓	3,400	3,430.00	11,662,000
中村屋	400	3,815.00	1,526,000
江崎グリコ	4,000	4,450.00	17,800,000
名糖産業	700	1,556.00	1,089,200
井村屋グループ	800	2,323.00	1,858,400
不二家	900	2,179.00	1,961,100
山崎製パン	11,000	1,587.00	17,457,000
第一屋製パン	300	952.00	285,600
モロゾフ	200	5,430.00	1,086,000
亀田製菓	800	4,480.00	3,584,000
寿スピリッツ	1,400	7,690.00	10,766,000

カルビー	6,700	2,599.00	17,413,300
森永乳業	2,700	5,910.00	15,957,000
六甲バター	1,000	1,632.00	1,632,000
ヤクルト本社	10,100	6,640.00	67,064,000
明治ホールディングス	9,700	7,010.00	67,997,000
雪印メグミルク	3,500	2,205.00	7,717,500
プリマハム	2,100	3,025.00	6,352,500
日本ハム	5,600	4,445.00	24,892,000
林兼産業	500	618.00	309,000
丸大食品	1,500	1,700.00	2,550,000
S Foods	1,300	3,485.00	4,530,500
柿安本店	500	2,562.00	1,281,000
伊藤ハム米久ホールディングス	9,400	703.00	6,608,200
サッポロホールディングス	5,000	2,330.00	11,650,000
アサヒグループホールディングス	32,100	5,505.00	176,710,500
キリンホールディングス	62,300	2,306.00	143,663,800
宝ホールディングス	10,900	1,509.00	16,448,100
オエノンホールディングス	4,200	374.00	1,570,800
養命酒製造	500	1,848.00	924,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,200	1,822.00	20,406,400
サントリー食品インターナショナル	9,800	4,275.00	41,895,000
ダイドーグループホールディングス	800	5,030.00	4,024,000
伊藤園	4,500	6,760.00	30,420,000
キーコーヒー	1,400	2,106.00	2,948,400
ユニカフェ	500	998.00	499,000
ジャパンフーズ	200	1,211.00	242,200
日清オイリオグループ	1,900	3,090.00	5,871,000
不二製油グループ本社	3,600	2,794.00	10,058,400
J - オイルミルズ	1,400	1,915.00	2,681,000
キッコーマン	10,600	7,440.00	78,864,000
味の素	34,900	2,692.50	93,968,250
ブルドックソース	700	2,293.00	1,605,100
キューピー	8,200	2,590.00	21,238,000
ハウス食品グループ本社	5,500	3,365.00	18,507,500
カゴメ	6,000	3,045.00	18,270,000
焼津水産化学工業	700	977.00	683,900
アリアケジャパン	1,300	6,930.00	9,009,000
ピエトロ	200	1,727.00	345,400
エバラ食品工業	300	2,590.00	777,000
やまみ	200	1,948.00	389,600
ニチレイ	7,000	2,948.00	20,636,000
東洋水産	7,500	4,425.00	33,187,500

イトアンドホールディングス	500	1,887.00	943,500
大冷	200	1,970.00	394,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	784.00	705,600
日清食品ホールディングス	5,800	8,100.00	46,980,000
永谷園ホールディングス	700	2,194.00	1,535,800
一正蒲鉾	600	970.00	582,000
フジッコ	1,600	1,919.00	3,070,400
ロック・フィールド	1,600	1,542.00	2,467,200
日本たばこ産業	78,700	2,202.00	173,297,400
ケンコーマヨネーズ	900	1,641.00	1,476,900
わらべや日洋ホールディングス	1,000	2,175.00	2,175,000
なとり	800	1,906.00	1,524,800
イフジ産業	200	926.00	185,200
ピクルスコーポレーション	400	3,225.00	1,290,000
ファーマフーズ	1,400	2,794.00	3,911,600
北の達人コーポレーション	5,200	497.00	2,584,400
ユーグレナ	7,500	902.00	6,765,000
紀文食品	900	1,482.00	1,333,800
ミヨシ油脂	500	1,253.00	626,500
理研ビタミン	1,400	1,529.00	2,140,600
片倉工業	1,900	1,534.00	2,914,600
ゲンゼ	1,000	4,675.00	4,675,000
東洋紡	5,600	1,364.00	7,638,400
ユニチカ	4,200	385.00	1,617,000
富士紡ホールディングス	700	4,105.00	2,873,500
倉敷紡績	1,300	1,955.00	2,541,500
シキボウ	800	940.00	752,000
日本毛織	4,700	1,003.00	4,714,100
ダイトウボウ	2,200	105.00	231,000
トーア紡コーポレーション	500	456.00	228,000
ダイドーリミテッド	1,800	177.00	318,600
帝国繊維	1,600	2,122.00	3,395,200
帝人	13,500	1,762.00	23,787,000
東レ	103,700	762.70	79,091,990
サカイオーベックス	400	2,980.00	1,192,000
住江織物	300	1,861.00	558,300
日本フェルト	800	455.00	364,000
イチカワ	200	1,359.00	271,800
日東製網	200	1,526.00	305,200
アツギ	1,100	621.00	683,100
ダイニック	600	764.00	458,400
セーレン	3,500	2,152.00	7,532,000

ソトー	600	798.00	478,800
東海染工	200	1,112.00	222,400
小松マテーレ	2,400	957.00	2,296,800
ワコールホールディングス	3,600	2,484.00	8,942,400
ホギメディカル	1,900	3,495.00	6,640,500
クラウドシアホールディングス	400	299.00	119,600
T S Iホールディングス	4,300	338.00	1,453,400
マツオカコーポレーション	500	1,717.00	858,500
ワールド	1,900	1,504.00	2,857,600
三陽商会	800	952.00	761,600
ナイガイ	500	385.00	192,500
オンワードホールディングス	8,600	360.00	3,096,000
ルックホールディングス	500	1,465.00	732,500
キムラタン	8,100	24.00	194,400
ゴールドウイン	2,400	6,640.00	15,936,000
デサント	2,400	2,500.00	6,000,000
キング	800	523.00	418,400
ヤマトインターナショナル	1,300	343.00	445,900
特種東海製紙	900	4,375.00	3,937,500
王子ホールディングス	64,500	647.00	41,731,500
日本製紙	6,300	1,262.00	7,950,600
三菱製紙	2,000	365.00	730,000
北越コーポレーション	10,200	581.00	5,926,200
中越パルプ工業	500	1,222.00	611,000
巴川製紙所	500	806.00	403,000
大王製紙	6,900	1,767.00	12,192,300
阿波製紙	400	422.00	168,800
レンゴー	14,800	941.00	13,926,800
トーモク	900	1,976.00	1,778,400
ザ・パック	1,100	2,786.00	3,064,600
クラレ	22,500	1,114.00	25,065,000
旭化成	95,000	1,250.50	118,797,500
共和レザー	800	717.00	573,600
昭和電工	10,900	3,590.00	39,131,000
住友化学	112,800	607.00	68,469,600
住友精化	700	3,585.00	2,509,500
日産化学	7,900	5,610.00	44,319,000
ラサ工業	500	1,913.00	956,500
クレハ	1,200	6,210.00	7,452,000
多木化学	600	5,310.00	3,186,000
テイカ	1,000	1,349.00	1,349,000
石原産業	2,600	1,068.00	2,776,800

片倉コープアグリ	400	1,213.00	485,200
日本曹達	2,000	3,445.00	6,890,000
東ソー	22,100	1,957.00	43,249,700
トクヤマ	4,300	2,307.00	9,920,100
セントラル硝子	2,700	2,108.00	5,691,600
東亜合成	8,700	1,183.00	10,292,100
大阪ソーダ	1,500	2,451.00	3,676,500
関東電化工業	3,400	1,012.00	3,440,800
デンカ	5,200	3,790.00	19,708,000
信越化学工業	26,500	19,175.00	508,137,500
日本カーバイド工業	500	1,298.00	649,000
堺化学工業	1,000	1,871.00	1,871,000
第一稀元素化学工業	1,500	1,785.00	2,677,500
エア・ウォーター	14,600	1,780.00	25,988,000
日本酸素ホールディングス	11,800	2,134.00	25,181,200
日本化学工業	400	2,930.00	1,172,000
東邦アセチレン	200	1,179.00	235,800
日本パーカライズン	7,200	1,094.00	7,876,800
高圧ガス工業	2,300	652.00	1,499,600
四国化成工業	1,900	1,278.00	2,428,200
戸田工業	300	2,270.00	681,000
ステラ ケミファ	800	3,105.00	2,484,000
保土谷化学工業	400	3,910.00	1,564,000
日本触媒	2,600	5,560.00	14,456,000
大日精化工業	1,200	2,354.00	2,824,800
カネカ	3,700	4,310.00	15,947,000
三菱瓦斯化学	14,400	2,491.00	35,870,400
三井化学	12,400	3,770.00	46,748,000
J S R	14,400	3,280.00	47,232,000
東京応化工業	2,500	7,180.00	17,950,000
大阪有機化学工業	1,300	4,465.00	5,804,500
三菱ケミカルホールディングス	95,800	889.10	85,175,780
K Hネオケム	2,400	2,655.00	6,372,000
ダイセル	19,200	895.00	17,184,000
住友ベークライト	2,200	4,970.00	10,934,000
積水化学工業	30,300	1,878.00	56,903,400
日本ゼオン	12,900	1,547.00	19,956,300
アイカ工業	4,000	3,985.00	15,940,000
宇部興産	7,200	2,323.00	16,725,600
積水樹脂	2,300	2,129.00	4,896,700
タキロンシーアイ	3,100	580.00	1,798,000
旭有機材	800	1,349.00	1,079,200

ニチバン	700	1,755.00	1,228,500
リケンテクノス	3,500	594.00	2,079,000
大倉工業	700	2,397.00	1,677,900
積水化成成品工業	1,900	611.00	1,160,900
群栄化学工業	300	2,440.00	732,000
タイガースポリマー	800	444.00	355,200
ミライアル	500	1,394.00	697,000
ダイキアクシス	600	870.00	522,000
ダイキョーニシカワ	3,100	688.00	2,132,800
竹本容器	500	979.00	489,500
森六ホールディングス	800	2,233.00	1,786,400
恵和	300	3,145.00	943,500
日本化薬	8,900	1,045.00	9,300,500
カーリットホールディングス	1,400	738.00	1,033,200
日本精化	1,000	1,475.00	1,475,000
扶桑化学工業	1,100	4,080.00	4,488,000
トリケミカル研究所	1,300	3,525.00	4,582,500
A D E K A	6,600	2,008.00	13,252,800
日油	5,400	5,780.00	31,212,000
新日本理化	2,500	275.00	687,500
ハリマ化成グループ	1,100	904.00	994,400
花王	35,000	6,885.00	240,975,000
第一工業製薬	500	3,350.00	1,675,000
石原ケミカル	400	2,151.00	860,400
日華化学	500	1,241.00	620,500
ニイタカ	300	2,464.00	739,200
三洋化成工業	900	5,490.00	4,941,000
有機合成薬品工業	1,100	341.00	375,100
大日本塗料	1,600	841.00	1,345,600
日本ペイントホールディングス	59,100	1,713.00	101,238,300
関西ペイント	16,100	2,941.00	47,350,100
神東塗料	1,200	197.00	236,400
中国塗料	3,500	922.00	3,227,000
日本特殊塗料	1,100	1,112.00	1,223,200
藤倉化成	2,000	525.00	1,050,000
太陽ホールディングス	1,000	5,330.00	5,330,000
D I C	6,000	2,908.00	17,448,000
サカタインクス	3,100	1,070.00	3,317,000
東洋インキ S C ホールディングス	3,000	2,083.00	6,249,000
T & K T O K A	1,000	807.00	807,000
富士フイルムホールディングス	25,700	7,880.00	202,516,000
資生堂	29,100	8,160.00	237,456,000

ライオン	19,000	1,981.00	37,639,000
高砂香料工業	900	2,677.00	2,409,300
マンダム	3,100	2,160.00	6,696,000
ミルボン	2,000	6,600.00	13,200,000
ファンケル	5,300	3,650.00	19,345,000
コーセー	2,800	18,240.00	51,072,000
コタ	900	1,413.00	1,271,700
ポーラ・オルビスホールディングス	6,200	3,045.00	18,879,000
ノエビアホールディングス	1,200	5,350.00	6,420,000
アジュバンコスメジャパン	300	1,031.00	309,300
新日本製薬	400	2,154.00	861,600
エステー	900	1,782.00	1,603,800
アグロ カネショウ	600	1,394.00	836,400
コニシ	2,400	1,538.00	3,691,200
長谷川香料	2,500	2,300.00	5,750,000
星光PMC	900	871.00	783,900
小林製薬	4,100	9,550.00	39,155,000
荒川化学工業	1,200	1,222.00	1,466,400
メック	1,000	2,880.00	2,880,000
日本高純度化学	400	2,777.00	1,110,800
タカラバイオ	3,800	2,979.00	11,320,200
JCU	1,600	3,575.00	5,720,000
新田ゼラチン	900	642.00	577,800
OATアグリオ	300	1,453.00	435,900
デクセリアルズ	4,100	2,200.00	9,020,000
アース製薬	1,100	6,710.00	7,381,000
北興化学工業	1,400	1,010.00	1,414,000
大成ラミック	400	2,740.00	1,096,000
クミアイ化学工業	6,000	946.00	5,676,000
日本農薬	2,600	526.00	1,367,600
アキレス	1,000	1,385.00	1,385,000
有沢製作所	2,100	912.00	1,915,200
日東電工	8,800	8,470.00	74,536,000
レック	1,800	1,178.00	2,120,400
三光合成	1,600	445.00	712,000
きもと	2,300	261.00	600,300
藤森工業	1,300	4,040.00	5,252,000
前澤化成工業	900	1,258.00	1,132,200
未来工業	500	1,734.00	867,000
ウェーブロックホールディングス	500	705.00	352,500
JSP	800	1,634.00	1,307,200
エフピコ	2,700	4,220.00	11,394,000

天馬	1,100	2,443.00	2,687,300	
信越ポリマー	2,300	1,068.00	2,456,400	
東リ	3,700	245.00	906,500	
ニフコ	5,400	3,990.00	21,546,000	
バルカー	1,200	2,095.00	2,514,000	
ユニ・チャーム	31,000	4,475.00	138,725,000	
ショーエイコーポレーション	300	972.00	291,600	
協和キリン	14,700	3,775.00	55,492,500	
武田薬品工業	121,700	3,800.00	462,460,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	126,800	1,944.50	246,562,600	
大日本住友製薬	10,800	2,282.00	24,645,600	
塩野義製薬	18,400	5,837.00	107,400,800	
わかもと製薬	1,700	322.00	547,400	
日本新薬	4,100	8,650.00	35,465,000	
バイオフェルミン製薬	300	3,105.00	931,500	
中外製薬	45,800	4,555.00	208,619,000	
科研製薬	2,500	4,755.00	11,887,500	
エーザイ	16,200	11,405.00	184,761,000	
ロート製薬	7,000	2,894.00	20,258,000	
小野薬品工業	33,600	2,523.00	84,772,800	
久光製薬	4,300	5,860.00	25,198,000	
持田製薬	2,000	3,740.00	7,480,000	
参天製薬	25,500	1,533.00	39,091,500	
扶桑薬品工業	500	2,322.00	1,161,000	
日本ケミファ	200	2,398.00	479,600	
ツムラ	4,900	3,595.00	17,615,500	
日医工	4,100	944.00	3,870,400	
キッセイ薬品工業	2,600	2,229.00	5,795,400	
生化学工業	2,600	1,118.00	2,906,800	
栄研化学	2,600	2,166.00	5,631,600	
日水製薬	500	976.00	488,000	
鳥居薬品	900	2,542.00	2,287,800	
JCRファーマ	4,100	3,560.00	14,596,000	
東和薬品	2,100	2,603.00	5,466,300	
富士製薬工業	900	1,182.00	1,063,800	
ゼリア新薬工業	2,600	2,106.00	5,475,600	
第一三共	114,900	2,620.00	301,038,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	1,743.00	5,577,600	
大幸薬品	1,800	1,057.00	1,902,600	
ダイト	900	3,345.00	3,010,500	
大塚ホールディングス	30,400	4,790.00	145,616,000	
大正製薬ホールディングス	3,500	6,270.00	21,945,000	

ペプチドリーム	7,500	5,260.00	39,450,000
あすか製薬ホールディングス	1,700	1,022.00	1,737,400
サワイグループホールディングス	3,200	5,000.00	16,000,000
日本コークス工業	12,600	105.00	1,323,000
ニチレキ	1,800	1,317.00	2,370,600
ユシロ化学工業	800	1,194.00	955,200
ビーピー・カストロール	500	1,397.00	698,500
富士石油	3,600	280.00	1,008,000
MORESCO	600	1,128.00	676,800
出光興産	16,200	2,729.00	44,209,800
ENEOSホールディングス	220,100	470.80	103,623,080
コスモエネルギーホールディングス	4,600	2,455.00	11,293,000
横浜ゴム	8,400	2,351.00	19,748,400
TOYO TIRE	7,700	2,330.00	17,941,000
ブリヂストン	38,900	4,997.00	194,383,300
住友ゴム工業	13,100	1,527.00	20,003,700
藤倉コンポジット	1,300	487.00	633,100
オカモト	900	4,265.00	3,838,500
フコク	600	964.00	578,400
ニッタ	1,500	2,742.00	4,113,000
住友理工	2,900	723.00	2,096,700
三ツ星ベルト	1,800	1,774.00	3,193,200
バンドー化学	2,600	883.00	2,295,800
日東紡績	2,200	3,615.00	7,953,000
AGC	13,400	4,825.00	64,655,000
日本板硝子	7,400	655.00	4,847,000
石塚硝子	200	1,936.00	387,200
日本山村硝子	600	938.00	562,800
日本電気硝子	5,400	2,664.00	14,385,600
オハラ	600	1,519.00	911,400
住友大阪セメント	2,600	3,040.00	7,904,000
太平洋セメント	8,700	2,455.00	21,358,500
日本ヒューム	1,300	722.00	938,600
日本コンクリート工業	3,200	338.00	1,081,600
三谷セキサン	700	4,105.00	2,873,500
アジアパイルホールディングス	2,300	490.00	1,127,000
東海カーボン	14,300	1,638.00	23,423,400
日本カーボン	800	4,395.00	3,516,000
東洋炭素	900	2,662.00	2,395,800
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,305.00	3,444,000
TOTO	10,500	6,140.00	64,470,000
日本碍子	16,100	1,978.00	31,845,800

日本特殊陶業	11,100	1,694.00	18,803,400
ダントーホールディングス	1,000	276.00	276,000
MARUWA	500	10,950.00	5,475,000
品川リフラクトリーズ	300	3,835.00	1,150,500
黒崎播磨	200	4,465.00	893,000
ヨータイ	1,100	1,144.00	1,258,400
イソライト工業	700	638.00	446,600
東京窯業	1,900	325.00	617,500
ニッカトー	700	704.00	492,800
フジインコーポレーテッド	1,200	5,160.00	6,192,000
クニミネ工業	500	1,140.00	570,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,024.00	307,200
ニチアス	3,700	2,815.00	10,415,500
ニチハ	2,000	2,935.00	5,870,000
日本製鉄	69,100	1,921.50	132,775,650
神戸製鋼所	26,500	737.00	19,530,500
合同製鐵	800	1,687.00	1,349,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	41,900	1,342.00	56,229,800
東京製鐵	5,600	1,146.00	6,417,600
共英製鋼	1,600	1,480.00	2,368,000
大和工業	3,100	3,790.00	11,749,000
東京鐵鋼	600	1,588.00	952,800
大阪製鐵	800	1,143.00	914,400
淀川製鋼所	1,900	2,280.00	4,332,000
丸一鋼管	4,700	2,767.00	13,004,900
モリ工業	400	2,493.00	997,200
大同特殊鋼	2,400	5,630.00	13,512,000
日本高周波鋼業	700	422.00	295,400
日本冶金工業	1,100	2,341.00	2,575,100
山陽特殊製鋼	1,700	1,603.00	2,725,100
愛知製鋼	800	3,165.00	2,532,000
日立金属	13,600	2,123.00	28,872,800
日本金属	400	986.00	394,400
大平洋金属	1,000	1,837.00	1,837,000
新日本電工	9,400	305.00	2,867,000
栗本鐵工所	700	1,675.00	1,172,500
虹技	200	1,171.00	234,200
日本鑄鐵管	200	1,315.00	263,000
三菱製鋼	1,100	897.00	986,700
日亜鋼業	2,300	297.00	683,100
日本精線	200	4,625.00	925,000
エンビプロ・ホールディングス	700	1,276.00	893,200

シンニッタン	2,000	256.00	512,000
新家工業	400	1,638.00	655,200
大紀アルミニウム工業所	2,200	1,182.00	2,600,400
日本軽金属ホールディングス	3,900	1,861.00	7,257,900
三井金属鉱業	3,900	3,140.00	12,246,000
東邦亜鉛	800	1,980.00	1,584,000
三菱マテリアル	9,500	2,243.00	21,308,500
住友金属鉱山	18,500	4,702.00	86,987,000
D O W Aホールディングス	3,700	4,420.00	16,354,000
古河機械金属	2,400	1,285.00	3,084,000
エス・サイエンス	6,700	40.00	268,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	835.00	1,252,500
東邦チタニウム	2,600	1,087.00	2,826,200
U A C J	2,200	2,779.00	6,113,800
C Kサンエツ	300	3,280.00	984,000
古河電気工業	4,500	2,854.00	12,843,000
住友電気工業	50,500	1,694.50	85,572,250
フジクラ	17,500	480.00	8,400,000
昭和電線ホールディングス	1,400	1,696.00	2,374,400
タツタ電線	2,500	565.00	1,412,500
カナレ電気	300	1,811.00	543,300
平河ヒューテック	800	1,189.00	951,200
リョービ	1,800	1,620.00	2,916,000
アーレスティ	1,800	524.00	943,200
アサヒホールディングス	5,400	2,290.00	12,366,000
稲葉製作所	800	1,503.00	1,202,400
宮地エンジニアリンググループ	500	2,306.00	1,153,000
トーカロ	3,700	1,442.00	5,335,400
アルファC o	500	1,131.00	565,500
S U M C O	18,500	2,664.00	49,284,000
川田テクノロジーズ	300	3,605.00	1,081,500
R S Technologies	500	6,050.00	3,025,000
ジェイテックコーポレーション	200	2,959.00	591,800
信和	800	720.00	576,000
東洋製罐グループホールディングス	9,200	1,655.00	15,226,000
ホッカンホールディングス	700	1,411.00	987,700
コロナ	800	930.00	744,000
横河ブリッジホールディングス	2,500	2,079.00	5,197,500
駒井ハルテック	300	1,795.00	538,500
高田機工	100	2,714.00	271,400
三和ホールディングス	13,600	1,382.00	18,795,200
文化シャッター	4,200	1,069.00	4,489,800

三協立山	1,900	805.00	1,529,500
アルインコ	900	976.00	878,400
東洋シャッター	300	680.00	204,000
LIXIL	19,900	2,925.00	58,207,500
日本フィルコン	1,000	498.00	498,000
ノーリツ	3,000	1,916.00	5,748,000
長府製作所	1,500	2,044.00	3,066,000
リンナイ	2,800	10,930.00	30,604,000
ダイニチ工業	700	795.00	556,500
日東精工	1,800	552.00	993,600
三洋工業	200	1,869.00	373,800
岡部	3,000	664.00	1,992,000
ジーテクト	1,800	1,577.00	2,838,600
東プレ	2,700	1,614.00	4,357,800
高周波熱錬	2,800	584.00	1,635,200
東京製網	1,000	1,176.00	1,176,000
サンコール	1,300	454.00	590,200
モリテック スチール	1,100	521.00	573,100
パイオラックス	2,100	1,514.00	3,179,400
エイチワン	1,400	805.00	1,127,000
日本発條	14,400	925.00	13,320,000
中央発條	700	1,227.00	858,900
アドバネクス	200	1,324.00	264,800
立川ブラインド工業	600	1,317.00	790,200
三益半導体工業	1,100	2,859.00	3,144,900
日本ドライケミカル	400	1,772.00	708,800
日本製鋼所	4,400	2,981.00	13,116,400
三浦工業	6,200	4,965.00	30,783,000
タクマ	4,900	1,770.00	8,673,000
ツガミ	3,000	1,678.00	5,034,000
オークマ	1,700	5,570.00	9,469,000
芝浦機械	1,500	2,539.00	3,808,500
アマダ	21,100	1,141.00	24,075,100
アイダエンジニアリング	3,800	870.00	3,306,000
滝澤鉄工所	400	1,130.00	452,000
F U J I	5,700	2,580.00	14,706,000
牧野フライス製作所	1,700	4,540.00	7,718,000
オーエスジー	7,100	1,895.00	13,454,500
ダイジェット工業	200	1,301.00	260,200
旭ダイヤモンド工業	3,900	524.00	2,043,600
D M G 森精機	9,100	1,957.00	17,808,700
ソディック	3,400	1,117.00	3,797,800

ディスコ	2,000	35,100.00	70,200,000
日東工器	700	1,827.00	1,278,900
日進工具	1,200	1,517.00	1,820,400
パンチ工業	1,300	643.00	835,900
富士ダイス	700	646.00	452,200
豊和工業	900	817.00	735,300
OKK	600	408.00	244,800
東洋機械金属	1,100	530.00	583,000
津田駒工業	300	899.00	269,700
島精機製作所	2,100	2,012.00	4,225,200
オプトラン	1,800	2,546.00	4,582,800
NCホールディングス	500	1,047.00	523,500
イワキポンプ	900	1,015.00	913,500
フリー	1,500	1,259.00	1,888,500
ヤマシンフィルタ	3,000	742.00	2,226,000
日阪製作所	1,800	816.00	1,468,800
やまびこ	2,800	1,235.00	3,458,000
平田機工	700	6,770.00	4,739,000
ペガサスミシン製造	1,600	489.00	782,400
マルマエ	600	2,365.00	1,419,000
タツモ	600	1,752.00	1,051,200
ナブテスコ	8,500	4,610.00	39,185,000
三井海洋開発	1,500	2,222.00	3,333,000
レオン自動機	1,400	1,424.00	1,993,600
S M C	4,300	64,690.00	278,167,000
ホソカワミクロン	500	6,000.00	3,000,000
ユニオンツール	500	3,980.00	1,990,000
オイレス工業	2,000	1,561.00	3,122,000
日精エー・エス・ビー機械	500	5,280.00	2,640,000
サトーホールディングス	1,900	2,627.00	4,991,300
技研製作所	1,300	4,610.00	5,993,000
日本エアテック	500	1,362.00	681,000
カワタ	400	889.00	355,600
日精樹脂工業	1,100	1,330.00	1,463,000
オカダアイヨン	500	1,286.00	643,000
ワイエイシイホールディングス	600	1,119.00	671,400
小松製作所	66,300	3,042.00	201,684,600
住友重機械工業	8,300	3,210.00	26,643,000
日立建機	6,800	3,425.00	23,290,000
日工	2,200	698.00	1,535,600
巴工業	600	2,289.00	1,373,400
井関農機	1,500	1,454.00	2,181,000

TOWA	1,400	2,260.00	3,164,000
丸山製作所	300	1,811.00	543,300
北川鉄工所	700	1,688.00	1,181,600
ローツェ	600	10,390.00	6,234,000
タカキタ	500	646.00	323,000
クボタ	76,800	2,281.50	175,219,200
荏原実業	400	6,250.00	2,500,000
三菱化工機	500	2,692.00	1,346,000
月島機械	2,700	1,189.00	3,210,300
帝国電機製作所	1,000	1,272.00	1,272,000
新東工業	3,500	776.00	2,716,000
澁谷工業	1,300	3,335.00	4,335,500
アイチ コーポレーション	2,500	854.00	2,135,000
小森コーポレーション	3,700	844.00	3,122,800
鶴見製作所	1,100	1,776.00	1,953,600
住友精密工業	200	2,501.00	500,200
酒井重工業	300	2,557.00	767,100
荏原製作所	6,100	5,350.00	32,635,000
石井鐵工所	200	3,070.00	614,000
西島製作所	1,500	884.00	1,326,000
北越工業	1,500	1,125.00	1,687,500
ダイキン工業	18,600	20,455.00	380,463,000
オルガノ	500	6,110.00	3,055,000
トーヨーカネツ	600	2,498.00	1,498,800
栗田工業	7,900	5,290.00	41,791,000
樁本チエイン	2,100	3,165.00	6,646,500
大同工業	700	1,074.00	751,800
木村化工機	1,200	883.00	1,059,600
アネスト岩田	2,500	1,047.00	2,617,500
ダイフク	8,000	9,680.00	77,440,000
サムコ	400	3,300.00	1,320,000
加藤製作所	800	1,000.00	800,000
油研工業	300	1,734.00	520,200
タダノ	7,000	1,132.00	7,924,000
フジテック	5,000	2,551.00	12,755,000
C K D	3,400	2,477.00	8,421,800
キトー	1,200	1,695.00	2,034,000
平和	4,000	1,933.00	7,732,000
理想科学工業	1,100	1,707.00	1,877,700
SANKYO	3,500	2,802.00	9,807,000
日本金銭機械	1,700	578.00	982,600
マースグループホールディングス	900	1,611.00	1,449,900

フクシマガリレイ	1,000	4,440.00	4,440,000
オーイズミ	700	382.00	267,400
ダイコク電機	700	907.00	634,900
竹内製作所	2,400	2,796.00	6,710,400
アマノ	3,800	2,927.00	11,122,600
J U K I	2,100	820.00	1,722,000
サンデンホールディングス	2,200	366.00	805,200
蛇の目ミシン工業	1,400	760.00	1,064,000
マックス	2,000	1,675.00	3,350,000
グローリー	3,700	2,315.00	8,565,500
新晃工業	1,400	1,920.00	2,688,000
大和冷機工業	2,400	1,069.00	2,565,600
セガサミーホールディングス	13,200	1,509.00	19,918,800
日本ピストンリング	600	1,327.00	796,200
リケン	700	2,592.00	1,814,400
T P R	2,000	1,505.00	3,010,000
ツバキ・ナカシマ	2,800	1,809.00	5,065,200
ホシザキ	4,600	9,950.00	45,770,000
大豊工業	1,200	1,024.00	1,228,800
日本精工	30,000	1,028.00	30,840,000
N T N	33,600	309.00	10,382,400
ジェイテクト	14,000	1,213.00	16,982,000
不二越	1,400	4,290.00	6,006,000
日本トムソン	4,100	613.00	2,513,300
T H K	9,100	3,280.00	29,848,000
ユーシン精機	1,000	820.00	820,000
前澤給装工業	1,000	1,053.00	1,053,000
イーグル工業	1,800	1,116.00	2,008,800
前澤工業	900	615.00	553,500
日本ピラー工業	1,500	2,296.00	3,444,000
キッツ	4,500	795.00	3,577,500
マキタ	19,100	5,080.00	97,028,000
日立造船	11,500	715.00	8,222,500
三菱重工業	23,000	3,383.00	77,809,000
I H I	9,800	2,751.00	26,959,800
スター精密	2,200	1,822.00	4,008,400
日清紡ホールディングス	8,900	920.00	8,188,000
イビデン	7,000	5,740.00	40,180,000
コニカミノルタ	29,700	642.00	19,067,400
ブラザー工業	17,800	2,392.00	42,577,600
ミネベアミツミ	25,200	2,916.00	73,483,200
日立製作所	70,300	6,100.00	428,830,000

東芝	28,900	4,700.00	135,830,000
三菱電機	146,200	1,739.00	254,241,800
富士電機	8,800	5,160.00	45,408,000
東洋電機製造	600	1,189.00	713,400
安川電機	15,700	5,250.00	82,425,000
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,311.00	2,490,900
明電舎	2,500	2,293.00	5,732,500
オリジン	400	1,320.00	528,000
山洋電気	700	7,970.00	5,579,000
デンヨー	1,300	2,034.00	2,644,200
東芝テック	1,600	4,570.00	7,312,000
芝浦メカトロニクス	300	7,840.00	2,352,000
マブチモーター	4,000	4,345.00	17,380,000
日本電産	35,200	12,535.00	441,232,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	748.00	598,400
トレックス・セミコンダクター	800	2,252.00	1,801,600
東光高岳	800	1,420.00	1,136,000
ダイヘン	1,600	4,875.00	7,800,000
ヤーマン	2,400	1,417.00	3,400,800
JVCケンウッド	13,000	236.00	3,068,000
ミマキエンジニアリング	1,300	739.00	960,700
I - P E X	700	2,519.00	1,763,300
日新電機	3,400	1,354.00	4,603,600
大崎電気工業	3,000	623.00	1,869,000
オムロン	12,200	8,550.00	104,310,000
日東工業	2,200	1,802.00	3,964,400
I D E C	2,000	2,172.00	4,344,000
正興電機製作所	500	1,612.00	806,000
不二電機工業	300	1,280.00	384,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,968.00	15,730,400
サクサホールディングス	400	1,390.00	556,000
メルコホールディングス	500	4,920.00	2,460,000
テクノメディカ	400	1,630.00	652,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	2,712.00	1,084,800
日本電気	18,600	5,550.00	103,230,000
富士通	13,200	19,445.00	256,674,000
沖電気工業	6,000	1,028.00	6,168,000
岩崎通信機	700	946.00	662,200
電気興業	700	2,256.00	1,579,200
サンケン電気	1,700	5,180.00	8,806,000
ナカヨ	300	1,499.00	449,700
アイホン	900	2,056.00	1,850,400

ルネサスエレクトロニクス	62,900	1,185.00	74,536,500
セイコーエプソン	18,100	2,077.00	37,593,700
ワコム	10,600	700.00	7,420,000
アルバック	2,700	5,540.00	14,958,000
アクセル	700	891.00	623,700
E I Z O	1,200	4,935.00	5,922,000
日本信号	3,400	938.00	3,189,200
京三製作所	3,200	434.00	1,388,800
能美防災	1,900	2,032.00	3,860,800
ホーチキ	1,100	1,184.00	1,302,400
星和電機	800	538.00	430,400
エレコム	3,400	2,042.00	6,942,800
パナソニック	155,900	1,266.50	197,447,350
シャープ	19,400	1,924.00	37,325,600
アンリツ	8,800	2,110.00	18,568,000
富士通ゼネラル	4,500	2,837.00	12,766,500
ソニーグループ	91,600	11,015.00	1,008,974,000
T D K	7,100	14,060.00	99,826,000
帝国通信工業	700	1,172.00	820,400
タムラ製作所	5,400	601.00	3,245,400
アルプスアルパイン	12,000	1,213.00	14,556,000
池上通信機	500	831.00	415,500
日本電波工業	1,400	1,090.00	1,526,000
鈴木	700	1,025.00	717,500
日本トリム	300	3,720.00	1,116,000
ローランド ディー . ジー .	900	2,574.00	2,316,600
フォスター電機	1,500	998.00	1,497,000
S M K	400	2,581.00	1,032,400
ヨコオ	1,200	2,345.00	2,814,000
ホシデン	4,000	1,015.00	4,060,000
ヒロセ電機	2,200	16,350.00	35,970,000
日本航空電子工業	3,400	1,932.00	6,568,800
T O A	1,800	891.00	1,603,800
マクセルホールディングス	2,900	1,262.00	3,659,800
古野電気	1,900	1,056.00	2,006,400
ユニデンホールディングス	400	2,663.00	1,065,200
スミダコーポレーション	1,200	1,189.00	1,426,800
アイコム	600	2,391.00	1,434,600
リオン	600	2,744.00	1,646,400
本多通信工業	1,200	495.00	594,000
船井電機	700	916.00	641,200
横河電機	14,600	1,732.00	25,287,200

新電元工業	600	4,775.00	2,865,000
アズビル	9,900	4,500.00	44,550,000
東亜ディーケーケー	800	827.00	661,600
日本光電工業	6,000	3,235.00	19,410,000
チノー	500	1,488.00	744,000
共和電業	1,700	382.00	649,400
日本電子材料	600	2,022.00	1,213,200
堀場製作所	2,900	7,530.00	21,837,000
アドバンテスト	10,900	10,300.00	112,270,000
小野測器	700	556.00	389,200
エスベック	1,300	2,158.00	2,805,400
キーエンス	14,400	56,820.00	818,208,000
日置電機	700	5,880.00	4,116,000
シスメックス	11,400	11,755.00	134,007,000
日本マイクロニクス	2,600	1,633.00	4,245,800
メガチップス	1,500	3,250.00	4,875,000
O B A R A G R O U P	700	3,850.00	2,695,000
澤藤電機	200	2,123.00	424,600
原田工業	600	923.00	553,800
コーセル	1,800	1,142.00	2,055,600
イリソ電子工業	1,200	5,170.00	6,204,000
オブテックスグループ	2,400	1,916.00	4,598,400
千代田インテグレ	600	1,802.00	1,081,200
アイ・オー・データ機器	600	1,062.00	637,200
レーザーテック	6,400	21,330.00	136,512,000
スタンレー電気	10,200	3,345.00	34,119,000
岩崎電気	600	1,879.00	1,127,400
ウシオ電機	7,500	1,758.00	13,185,000
岡谷電機産業	1,100	359.00	394,900
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	350.00	490,000
エノモト	400	1,748.00	699,200
日本セラミック	1,500	2,957.00	4,435,500
遠藤照明	800	783.00	626,400
古河電池	1,100	1,577.00	1,734,700
双信電機	700	580.00	406,000
山一電機	1,000	1,733.00	1,733,000
図研	1,000	3,050.00	3,050,000
日本電子	2,700	6,220.00	16,794,000
カシオ計算機	11,800	1,906.00	22,490,800
ファナック	12,800	27,165.00	347,712,000
日本シイエムケイ	3,200	447.00	1,430,400
エンプラス	700	4,050.00	2,835,000

大真空	500	4,320.00	2,160,000	
ローム	6,100	10,180.00	62,098,000	
浜松ホトニクス	10,500	6,810.00	71,505,000	
三井ハイテック	1,400	5,420.00	7,588,000	
新光電気工業	4,900	3,825.00	18,742,500	
京セラ	22,300	7,144.00	159,311,200	
太陽誘電	6,500	5,540.00	36,010,000	
村田製作所	43,000	8,563.00	368,209,000	
双葉電子工業	2,600	798.00	2,074,800	
北陸電気工業	600	1,024.00	614,400	
ニチコン	4,600	1,178.00	5,418,800	
日本ケミコン	1,500	2,522.00	3,783,000	
K O A	2,000	1,670.00	3,340,000	
市光工業	2,300	757.00	1,741,100	
小糸製作所	8,700	7,030.00	61,161,000	
ミツバ	2,800	875.00	2,450,000	
S C R E E Nホールディングス	2,500	10,910.00	27,275,000	
キャノン電子	1,400	1,742.00	2,438,800	
キャノン	72,600	2,623.00	190,429,800	代用有価証券 10,000株
リコー	37,100	1,350.00	50,085,000	
象印マホービン	4,000	1,708.00	6,832,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,585.00	317,000	
東京エレクトロン	8,600	49,500.00	425,700,000	
トヨタ紡織	4,300	2,260.00	9,718,000	
芦森工業	300	1,084.00	325,200	
ユニプレス	2,400	991.00	2,378,400	
豊田自動織機	11,800	9,800.00	115,640,000	
モリタホールディングス	2,300	1,619.00	3,723,700	
三櫻工業	2,100	1,244.00	2,612,400	
デンソー	32,200	7,805.00	251,321,000	
東海理化電機製作所	3,900	1,765.00	6,883,500	
三井E & Sホールディングス	5,700	520.00	2,964,000	
川崎重工業	11,400	2,481.00	28,283,400	
名村造船所	4,600	193.00	887,800	
サノヤスホールディングス	400	148.00	59,200	
日本車輛製造	500	2,215.00	1,107,500	
三菱ロジスネクスト	2,000	1,077.00	2,154,000	
近畿車輛	300	1,280.00	384,000	
日産自動車	172,500	563.00	97,117,500	
いすゞ自動車	38,800	1,561.00	60,566,800	
トヨタ自動車	148,200	10,075.00	1,493,115,000	代用有価証券 35,000株

日野自動車	18,300	998.00	18,263,400
三菱自動車工業	54,200	311.00	16,856,200
エフテック	1,100	929.00	1,021,900
レシップホールディングス	600	633.00	379,800
G M B	300	1,043.00	312,900
ファルテック	300	766.00	229,800
武蔵精密工業	3,300	2,468.00	8,144,400
日産車体	2,200	742.00	1,632,400
新明和工業	4,100	992.00	4,067,200
極東開発工業	2,500	1,694.00	4,235,000
トピー工業	1,200	1,363.00	1,635,600
ティラド	500	2,798.00	1,399,000
タチエス	2,200	1,420.00	3,124,000
N O K	7,100	1,348.00	9,570,800
フタバ産業	3,700	528.00	1,953,600
K Y B	1,600	3,920.00	6,272,000
大同メタル工業	3,100	634.00	1,965,400
プレス工業	7,300	347.00	2,533,100
ミクニ	1,900	305.00	579,500
太平洋工業	3,100	1,143.00	3,543,300
河西工業	2,000	409.00	818,000
アイシン	10,700	4,890.00	52,323,000
マツダ	45,900	1,003.00	46,037,700
今仙電機製作所	1,300	729.00	947,700
本田技研工業	115,200	3,626.00	417,715,200
スズキ	29,000	4,770.00	138,330,000
S U B A R U	41,900	2,292.50	96,055,750
安永	700	1,259.00	881,300
ヤマハ発動機	20,700	3,250.00	67,275,000
T B K	1,800	418.00	752,400
エクセディ	2,000	1,700.00	3,400,000
豊田合成	4,700	2,737.00	12,863,900
愛三工業	2,300	884.00	2,033,200
盟和産業	200	983.00	196,600
日本プラスト	1,300	724.00	941,200
ヨロズ	1,300	1,280.00	1,664,000
エフ・シー・シー	2,400	1,699.00	4,077,600
シマノ	5,500	24,595.00	135,272,500
テイ・エス テック	6,800	1,629.00	11,077,200
ジャムコ	900	1,166.00	1,049,400
テルモ	44,800	4,589.00	205,587,200
クリエートメディック	500	1,010.00	505,000

日機装	4,700	1,167.00	5,484,900
日本エム・ディ・エム	900	2,193.00	1,973,700
島津製作所	18,800	4,140.00	77,832,000
JMS	1,200	854.00	1,024,800
長野計器	1,100	1,162.00	1,278,200
ブイ・テクノロジー	700	5,870.00	4,109,000
東京計器	900	1,105.00	994,500
愛知時計電機	200	4,195.00	839,000
インターアクション	700	2,581.00	1,806,700
オーバル	1,300	285.00	370,500
東京精密	2,500	5,230.00	13,075,000
マニー	5,800	2,589.00	15,016,200
ニコン	22,300	1,200.00	26,760,000
トプコン	7,400	1,778.00	13,157,200
オリンパス	80,900	2,373.50	192,016,150
理研計器	1,300	2,810.00	3,653,000
タムロン	1,200	2,465.00	2,958,000
HOYA	28,800	14,180.00	408,384,000
シード	600	810.00	486,000
ノーリツ鋼機	1,300	2,265.00	2,944,500
エー・アンド・デイ	1,200	1,072.00	1,286,400
朝日インテック	15,400	2,717.00	41,841,800
シチズン時計	18,600	436.00	8,109,600
リズム	500	798.00	399,000
大研医器	1,200	561.00	673,200
メニコン	2,200	7,150.00	15,730,000
シンシア	200	641.00	128,200
松風	700	2,003.00	1,402,100
セイコーホールディングス	2,100	2,254.00	4,733,400
ニプロ	10,900	1,362.00	14,845,800
中本パックス	400	1,583.00	633,200
スノーピーク	900	3,190.00	2,871,000
パラマウントベッドホールディングス	2,800	1,991.00	5,574,800
トランザクション	800	1,389.00	1,111,200
粧美堂	600	423.00	253,800
ニホンフラッシュ	1,300	1,251.00	1,626,300
前田工織	1,600	3,325.00	5,320,000
永大産業	2,100	312.00	655,200
アートネイチャー	1,500	655.00	982,500
バンダイナムコホールディングス	12,100	8,140.00	98,494,000
アイフィスジャパン	400	710.00	284,000
共立印刷	2,800	142.00	397,600

SHOEI	1,400	3,950.00	5,530,000
フランスベッドホールディングス	2,000	910.00	1,820,000
パイロットコーポレーション	2,500	3,555.00	8,887,500
萩原工業	800	1,437.00	1,149,600
トッパン・フォームズ	2,700	1,093.00	2,951,100
フジシールインターナショナル	3,000	2,376.00	7,128,000
タカラトミー	6,600	984.00	6,494,400
廣濟堂	1,000	836.00	836,000
エステールホールディングス	500	648.00	324,000
タカノ	600	642.00	385,200
プロネクサス	1,200	1,038.00	1,245,600
ホクシン	1,300	169.00	219,700
ウッドワン	600	1,293.00	775,800
大建工業	1,000	2,066.00	2,066,000
凸版印刷	22,200	1,909.00	42,379,800
大日本印刷	17,600	2,442.00	42,979,200
共同印刷	400	2,686.00	1,074,400
NISSHA	3,000	1,689.00	5,067,000
光村印刷	200	1,690.00	338,000
TAKARA & COMPANY	700	1,726.00	1,208,200
アシックス	12,900	2,558.00	32,998,200
ツツミ	400	2,373.00	949,200
ローランド	1,100	6,390.00	7,029,000
小松ウオール工業	500	2,012.00	1,006,000
ヤマハ	8,700	6,540.00	56,898,000
河合楽器製作所	400	3,735.00	1,494,000
クリナップ	1,500	522.00	783,000
ピジョン	9,400	3,300.00	31,020,000
オリバー	300	2,705.00	811,500
兼松サステック	100	1,803.00	180,300
キングジム	1,200	944.00	1,132,800
リンテック	3,100	2,442.00	7,570,200
イトーキ	3,100	384.00	1,190,400
任天堂	8,400	65,070.00	546,588,000
三菱鉛筆	2,400	1,424.00	3,417,600
タカラスタANDARD	3,000	1,571.00	4,713,000
コクヨ	7,000	1,843.00	12,901,000
ナカバヤシ	1,500	598.00	897,000
グローブライド	700	4,070.00	2,849,000
オカムラ	5,000	1,489.00	7,445,000
美津濃	1,500	2,288.00	3,432,000
東京電力ホールディングス	124,100	349.00	43,310,900

中部電力	44,800	1,373.00	61,510,400
関西電力	55,400	1,092.00	60,496,800
中国電力	21,100	1,034.00	21,817,400
北陸電力	13,400	632.00	8,468,800
東北電力	34,300	894.00	30,664,200
四国電力	12,200	762.00	9,296,400
九州電力	32,300	874.00	28,230,200
北海道電力	13,700	526.00	7,206,200
沖縄電力	2,800	1,430.00	4,004,000
電源開発	11,600	1,626.00	18,861,600
エフオン	900	965.00	868,500
イーレックス	2,100	1,922.00	4,036,200
レノバ	2,500	3,730.00	9,325,000
東京瓦斯	28,100	2,192.50	61,609,250
大阪瓦斯	26,500	2,157.00	57,160,500
東邦瓦斯	7,200	5,880.00	42,336,000
北海道瓦斯	800	1,575.00	1,260,000
広島ガス	3,000	373.00	1,119,000
西部ガスホールディングス	1,600	2,516.00	4,025,600
静岡ガス	4,100	1,029.00	4,218,900
メタウォーター	1,700	2,097.00	3,564,900
SBSホールディングス	1,100	3,305.00	3,635,500
東武鉄道	15,200	3,100.00	47,120,000
相鉄ホールディングス	5,000	2,256.00	11,280,000
東急	36,900	1,610.00	59,409,000
京浜急行電鉄	18,800	1,494.00	28,087,200
小田急電鉄	23,400	3,030.00	70,902,000
京王電鉄	8,200	7,220.00	59,204,000
京成電鉄	11,000	3,645.00	40,095,000
富士急行	2,000	5,430.00	10,860,000
東日本旅客鉄道	25,700	8,360.00	214,852,000
西日本旅客鉄道	13,000	6,903.00	89,739,000
東海旅客鉄道	12,200	18,000.00	219,600,000
西武ホールディングス	17,600	1,389.00	24,446,400
鴻池運輸	2,400	1,175.00	2,820,000
西日本鉄道	4,100	2,830.00	11,603,000
ハマキョウレックス	1,100	3,115.00	3,426,500
サカイ引越センター	700	5,660.00	3,962,000
近鉄グループホールディングス	13,900	4,155.00	57,754,500
阪急阪神ホールディングス	18,500	3,705.00	68,542,500
南海電気鉄道	6,600	2,464.00	16,262,400
京阪ホールディングス	6,200	3,540.00	21,948,000

神戸電鉄	300	3,505.00	1,051,500
名古屋鉄道	11,400	2,222.00	25,330,800
山陽電気鉄道	1,000	1,940.00	1,940,000
アルプス物流	1,000	1,030.00	1,030,000
日本通運	4,800	8,700.00	41,760,000
ヤマトホールディングス	19,400	3,030.00	58,782,000
山九	3,600	4,810.00	17,316,000
丸運	900	280.00	252,000
丸全昭和運輸	1,100	3,330.00	3,663,000
センコーグループホールディングス	7,600	1,033.00	7,850,800
トナミホールディングス	300	5,000.00	1,500,000
ニッコンホールディングス	4,600	2,359.00	10,851,400
日本石油輸送	200	2,584.00	516,800
福山通運	1,800	3,925.00	7,065,000
セイノーホールディングス	10,400	1,459.00	15,173,600
エスライン	400	899.00	359,600
神奈川中央交通	300	3,640.00	1,092,000
日立物流	3,000	3,880.00	11,640,000
丸和運輸機関	2,900	1,571.00	4,555,900
C & F ロジホールディングス	1,400	1,620.00	2,268,000
九州旅客鉄道	10,700	2,645.00	28,301,500
S Gホールディングス	26,200	2,781.00	72,862,200
日本郵船	11,600	5,420.00	62,872,000
商船三井	8,200	5,010.00	41,082,000
川崎汽船	4,200	3,540.00	14,868,000
N S ユナイテッド海運	700	2,349.00	1,644,300
飯野海運	6,500	456.00	2,964,000
乾汽船	1,000	1,197.00	1,197,000
日本航空	33,800	2,612.00	88,285,600
A N Aホールディングス	37,400	2,814.00	105,243,600
パスコ	300	1,579.00	473,700
トランコム	400	8,280.00	3,312,000
日新	1,100	1,517.00	1,668,700
三菱倉庫	4,800	3,445.00	16,536,000
三井倉庫ホールディングス	1,500	2,375.00	3,562,500
住友倉庫	4,900	1,510.00	7,399,000
澁澤倉庫	800	2,143.00	1,714,400
東陽倉庫	2,300	323.00	742,900
日本トランスシティ	3,100	533.00	1,652,300
ケイヒン	300	1,375.00	412,500
中央倉庫	900	1,061.00	954,900
川西倉庫	200	1,152.00	230,400

安田倉庫	1,100	950.00	1,045,000
ファイブホールディングス	300	877.00	263,100
東洋埠頭	400	1,533.00	613,200
宇徳	1,000	510.00	510,000
上組	7,600	2,149.00	16,332,400
サンリツ	400	751.00	300,400
キムラユニティー	400	1,327.00	530,800
キューソー流通システム	300	1,708.00	512,400
近鉄エクスプレス	2,600	2,376.00	6,177,600
東海運	800	311.00	248,800
エーアイティー	900	996.00	896,400
内外トランスライン	500	1,930.00	965,000
日本コンセプト	400	1,642.00	656,800
NEC ネットエスアイ	4,800	1,770.00	8,496,000
クロスキャット	400	997.00	398,800
システナ	5,100	1,966.00	10,026,600
デジタルアーツ	800	8,960.00	7,168,000
日鉄ソリューションズ	2,100	3,520.00	7,392,000
キューブシステム	800	1,042.00	833,600
エイジア	200	2,114.00	422,800
コア	600	1,427.00	856,200
ラクーンホールディングス	1,000	2,375.00	2,375,000
ソリトンシステムズ	700	1,702.00	1,191,400
ソフトクリエイトホールディングス	600	2,290.00	1,374,000
T I S	14,400	2,830.00	40,752,000
J N S ホールディングス	800	602.00	481,600
電算システム	600	2,961.00	1,776,600
グリー	8,800	638.00	5,614,400
G M O ペパボ	100	5,070.00	507,000
コーエーテクモホールディングス	3,800	5,330.00	20,254,000
三菱総合研究所	600	3,870.00	2,322,000
ボルテージ	400	493.00	197,200
電算	200	2,393.00	478,600
A G S	800	851.00	680,800
ファインデックス	1,200	1,025.00	1,230,000
ブレインパッド	400	4,855.00	1,942,000
K L a b	2,700	736.00	1,987,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,900	1,147.00	2,179,300
イーブクイニシアティブジャパン	200	3,280.00	656,000
ネクソン	36,300	2,583.00	93,762,900
アイスタイル	4,400	523.00	2,301,200
エムアップホールディングス	400	3,405.00	1,362,000

エイチーム	1,000	1,517.00	1,517,000
エニグモ	1,400	1,332.00	1,864,800
テクノスジャパン	1,200	621.00	745,200
e n i s h	800	524.00	419,200
コロプラ	4,700	860.00	4,042,000
ブロードリーフ	7,100	523.00	3,713,300
クロス・マーケティンググループ	700	717.00	501,900
デジタルハーツホールディングス	700	1,580.00	1,106,000
システム情報	1,100	984.00	1,082,400
メディアドゥ	600	4,795.00	2,877,000
じげん	3,600	438.00	1,576,800
ブイキューブ	800	2,669.00	2,135,200
エンカレッジ・テクノロジー	300	694.00	208,200
サイバーリンクス	500	1,671.00	835,500
フィックスターズ	1,500	892.00	1,338,000
C A R T A H O L D I N G S	600	1,725.00	1,035,000
オブティム	1,000	2,374.00	2,374,000
セレス	500	3,685.00	1,842,500
S H I F T	700	16,590.00	11,613,000
ティーガイア	1,600	1,958.00	3,132,800
セック	200	2,650.00	530,000
日本アジアグループ	1,400	963.00	1,348,200
テクマトリックス	2,200	1,775.00	3,905,000
プロシップ	400	1,352.00	540,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,500	2,373.00	8,305,500
G M O ペイメントゲートウェイ	2,700	13,930.00	37,611,000
ザッパラス	600	588.00	352,800
システムリサーチ	400	2,062.00	824,800
インターネットイニシアティブ	3,800	3,260.00	12,388,000
さくらインターネット	1,600	641.00	1,025,600
ヴァンクス	400	1,017.00	406,800
G M O グローバルサイン・ホールディングス	300	5,150.00	1,545,000
S R A ホールディングス	800	2,741.00	2,192,800
システムインテグレータ	400	648.00	259,200
朝日ネット	1,200	726.00	871,200
e B A S E	1,700	876.00	1,489,200
アバント	1,600	1,635.00	2,616,000
アドソル日進	500	2,415.00	1,207,500
O D K ソリューションズ	300	829.00	248,700
フリービット	900	824.00	741,600
コムチュア	1,300	2,379.00	3,092,700
サイバーコム	300	1,545.00	463,500

アステリア	1,100	847.00	931,700
アイル	800	1,506.00	1,204,800
マークラインズ	600	3,085.00	1,851,000
メディカル・データ・ビジョン	1,600	2,177.00	3,483,200
g u m i	2,000	892.00	1,784,000
ショーケース	300	808.00	242,400
モバイルファクトリー	300	1,274.00	382,200
テラスカイ	500	2,742.00	1,371,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	2,112.00	1,267,200
P C Iホールディングス	700	1,233.00	863,100
パイプドHD	300	1,766.00	529,800
アイビーシー	300	1,004.00	301,200
ネオジャパン	300	1,596.00	478,800
P R T I M E S	300	3,355.00	1,006,500
ラクス	4,300	2,292.00	9,855,600
ランドコンピュータ	200	1,133.00	226,600
ダブルスタンダード	200	5,170.00	1,034,000
オープンドア	900	2,470.00	2,223,000
マイネット	500	788.00	394,000
アカツキ	600	3,750.00	2,250,000
ベネフィットジャパン	100	2,053.00	205,300
U b i c o mホールディングス	400	3,405.00	1,362,000
カナミックネットワーク	1,600	670.00	1,072,000
ノムラシステムコーポレーション	700	302.00	211,400
チェンジ	2,600	2,996.00	7,789,600
シンクロ・フード	900	399.00	359,100
オークネット	800	1,426.00	1,140,800
キャピタル・アセット・プランニング	300	1,077.00	323,100
エイトレッド	300	2,258.00	677,400
A O I T Y O H o l d i n g s	1,500	898.00	1,347,000
マクロミル	3,000	864.00	2,592,000
ビーグリー	300	1,478.00	443,400
オロ	500	3,720.00	1,860,000
ユーザーローカル	200	4,270.00	854,000
テモナ	300	1,117.00	335,100
サインポスト	400	924.00	369,600
ソルクシーズ	600	1,025.00	615,000
フェイス	500	805.00	402,500
プロトコーポレーション	1,700	1,201.00	2,041,700
ハイマックス	400	1,079.00	431,600
野村総合研究所	24,900	3,620.00	90,138,000
サイバネットシステム	1,100	825.00	907,500

C Eホールディングス	800	531.00	424,800
日本システム技術	300	1,608.00	482,400
インテージホールディングス	1,800	1,583.00	2,849,400
東邦システムサイエンス	400	921.00	368,400
ソースネクスト	6,900	319.00	2,201,100
インフォコム	1,300	3,120.00	4,056,000
HEROZ	400	2,351.00	940,400
ラクスル	1,600	5,210.00	8,336,000
I P S	300	2,729.00	818,700
F I G	1,700	290.00	493,000
システムサポート	400	1,417.00	566,800
イーソル	800	1,140.00	912,000
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,667.00	2,667,200
E d u L a b	100	5,480.00	548,000
東海ソフト	200	1,535.00	307,000
ウイングアーク1 s t	800	2,300.00	1,840,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	2,327.00	698,100
サーバーワークス	100	3,920.00	392,000
東名	200	1,091.00	218,200
ヴィッツ	100	2,079.00	207,900
トピラシステムズ	200	1,429.00	285,800
S a n s a n	1,300	9,400.00	12,220,000
L i n k - U	300	1,360.00	408,000
ギフトィ	900	3,285.00	2,956,500
ベース	200	5,420.00	1,084,000
フォーカスシステムズ	1,000	1,050.00	1,050,000
クレスコ	1,000	1,772.00	1,772,000
フジ・メディア・ホールディングス	14,900	1,276.00	19,012,400
オービック	4,500	21,270.00	95,715,000
ジャストシステム	2,000	6,320.00	12,640,000
T D Cソフト	1,300	1,005.00	1,306,500
Zホールディングス	197,200	524.80	103,490,560
トレンドマイクロ	7,700	5,790.00	44,583,000
I Dホールディングス	600	1,350.00	810,000
日本オラクル	2,900	10,040.00	29,116,000
アルファシステムズ	400	3,715.00	1,486,000
フューチャー	1,700	2,126.00	3,614,200
C A C H o l d i n g s	900	1,450.00	1,305,000
S Bテクノロジー	500	3,085.00	1,542,500
トーセ	400	814.00	325,600
オービックビジネスコンサルタント	1,400	6,410.00	8,974,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,500	3,385.00	22,002,500

アイティフォー	1,900	805.00	1,529,500
東計電算	200	4,845.00	969,000
エクスネット	300	1,021.00	306,300
大塚商会	7,800	5,910.00	46,098,000
サイボウズ	1,700	2,612.00	4,440,400
電通国際情報サービス	1,800	4,015.00	7,227,000
A C C E S S	1,800	884.00	1,591,200
デジタルガレージ	2,400	4,750.00	11,400,000
E Mシステムズ	2,400	902.00	2,164,800
ウェザーニューズ	400	5,850.00	2,340,000
C I J	1,000	846.00	846,000
ビジネスエンジニアリング	100	3,270.00	327,000
日本エンタープライズ	1,500	219.00	328,500
WOWOW	700	2,435.00	1,704,500
スカラ	1,300	820.00	1,066,000
インテリジェント ウェイブ	900	669.00	602,100
I M A G I C A G R O U P	1,300	480.00	624,000
ネットワンシステムズ	5,900	3,445.00	20,325,500
システムソフト	3,100	159.00	492,900
アルゴグラフィックス	1,100	3,215.00	3,536,500
マーベラス	2,300	797.00	1,833,100
エイベックス	2,500	1,534.00	3,835,000
日本ユニシス	5,000	3,215.00	16,075,000
兼松エレクトロニクス	800	3,670.00	2,936,000
都築電気	600	1,836.00	1,101,600
T B S ホールディングス	9,500	1,811.00	17,204,500
日本テレビホールディングス	12,000	1,336.00	16,032,000
朝日放送グループホールディングス	1,500	708.00	1,062,000
テレビ朝日ホールディングス	4,400	1,888.00	8,307,200
スカパー J S A T ホールディングス	9,400	422.00	3,966,800
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,167.00	2,167,000
日本 B S 放送	500	1,114.00	557,000
ビジョン	1,800	1,235.00	2,223,000
スマートバリュー	400	795.00	318,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,400	2,340.00	3,276,000
コネクシオ	800	1,477.00	1,181,600
日本通信	7,300	222.00	1,620,600
クロップス	300	876.00	262,800
日本電信電話	167,900	2,894.00	485,902,600
K D D I	115,100	3,603.00	414,705,300
ソフトバンク	130,400	1,423.50	185,624,400
光通信	1,700	20,840.00	35,428,000

エムティーアイ	1,400	673.00	942,200
GMOインターネット	5,100	3,170.00	16,167,000
アйдママーケティングコミュニケーション	400	439.00	175,600
KADOKAWA	3,700	4,665.00	17,260,500
学研ホールディングス	2,100	1,391.00	2,921,100
ゼンリン	2,600	1,183.00	3,075,800
昭文社ホールディングス	600	472.00	283,200
インプレスホールディングス	1,200	205.00	246,000
アイネット	800	1,441.00	1,152,800
松竹	900	13,040.00	11,736,000
東宝	8,500	4,645.00	39,482,500
東映	500	21,210.00	10,605,000
エヌ・ティ・ティ・データ	38,200	1,748.00	66,773,600
ピー・シー・エー	200	4,115.00	823,000
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,770.00	885,000
D T S	3,000	2,681.00	8,043,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,100	5,640.00	34,404,000
シーイーシー	1,600	1,617.00	2,587,200
カブコン	12,300	3,310.00	40,713,000
アイ・エス・ピー	700	1,480.00	1,036,000
ジャステック	900	1,282.00	1,153,800
S C S K	3,300	6,340.00	20,922,000
日本システムウエア	500	2,308.00	1,154,000
アイネス	1,400	1,346.00	1,884,400
T K C	2,400	3,355.00	8,052,000
富士ソフト	1,500	5,760.00	8,640,000
N S D	4,600	1,827.00	8,404,200
コナミホールディングス	5,200	7,240.00	37,648,000
福井コンピュータホールディングス	700	4,185.00	2,929,500
J B C Cホールディングス	1,000	1,390.00	1,390,000
ミロク情報サービス	1,400	1,602.00	2,242,800
ソフトバンクグループ	113,900	8,042.00	915,983,800
ハウスイ	200	951.00	190,200
高千穂交易	600	1,106.00	663,600
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,725.00	517,500
伊藤忠食品	400	5,270.00	2,108,000
エレマテック	1,200	1,286.00	1,543,200
J A L U X	400	1,878.00	751,200
あらた	1,200	4,240.00	5,088,000
トーメンデバイス	200	3,950.00	790,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,960.00	2,980,000
フィールズ	1,400	486.00	680,400

双日	79,600	349.00	27,780,400
アルフレッサ ホールディングス	15,000	1,704.00	25,560,000
横浜冷凍	4,100	901.00	3,694,100
神栄	200	1,383.00	276,600
ラサ商事	800	901.00	720,800
アルコニックス	1,600	1,480.00	2,368,000
神戸物産	9,900	3,080.00	30,492,000
ハイパー	400	558.00	223,200
あい ホールディングス	2,100	2,146.00	4,506,600
ディーブイエックス	500	1,000.00	500,000
ダイワボウホールディングス	6,600	1,840.00	12,144,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,400	2,598.00	8,833,200
ラクト・ジャパン	700	2,847.00	1,992,900
グリムス	400	1,757.00	702,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	692.00	1,799,200
八洲電機	1,200	977.00	1,172,400
メディアスホールディングス	900	1,066.00	959,400
レスターホールディングス	1,500	1,916.00	2,874,000
ジューテックホールディングス	400	1,018.00	407,200
大光	600	690.00	414,000
OCHIホールディングス	400	1,289.00	515,600
TOKAIホールディングス	7,000	886.00	6,202,000
黒谷	400	915.00	366,000
Cominix	300	747.00	224,100
三洋貿易	1,500	1,359.00	2,038,500
ビューティガレージ	200	4,530.00	906,000
ウイン・パートナーズ	1,100	999.00	1,098,900
ミタチ産業	400	657.00	262,800
シップヘルスケアホールディングス	5,100	2,537.00	12,938,700
明治電機工業	500	1,340.00	670,000
デリカフーズホールディングス	600	647.00	388,200
スターティアホールディングス	300	1,488.00	446,400
コメダホールディングス	3,200	2,052.00	6,566,400
ピーバンドットコム	300	825.00	247,500
アセンテック	400	1,399.00	559,600
富士興産	500	1,218.00	609,000
協栄産業	200	1,379.00	275,800
小野建	1,300	1,308.00	1,700,400
南陽	300	1,945.00	583,500
佐鳥電機	1,000	805.00	805,000
エコートレーディング	400	622.00	248,800
伯東	900	1,550.00	1,395,000

コンドーテック	1,100	1,001.00	1,101,100
中山福	900	472.00	424,800
ナガイレーベン	1,900	2,607.00	4,953,300
三菱食品	1,600	2,958.00	4,732,800
松田産業	1,100	2,182.00	2,400,200
第一興商	2,900	4,440.00	12,876,000
メディカルホールディングス	14,400	2,169.00	31,233,600
S P K	700	1,335.00	934,500
萩原電気ホールディングス	500	2,447.00	1,223,500
アズワン	1,000	13,500.00	13,500,000
スズデン	500	1,464.00	732,000
シモジマ	900	1,081.00	972,900
ドウシシャ	1,400	1,675.00	2,345,000
小津産業	300	1,916.00	574,800
高速	800	1,473.00	1,178,400
たけびし	500	1,552.00	776,000
リックス	400	1,537.00	614,800
丸文	1,400	626.00	876,400
ハピネット	1,200	1,459.00	1,750,800
橋本総業ホールディングス	300	3,035.00	910,500
日本ライフライン	4,700	1,390.00	6,533,000
タカショー	1,000	807.00	807,000
マルカ	500	2,466.00	1,233,000
I D O M	5,000	653.00	3,265,000
進和	900	2,128.00	1,915,200
エスケイジャパン	500	457.00	228,500
ダイトロン	600	2,020.00	1,212,000
シークス	1,900	1,637.00	3,110,300
田中商事	500	705.00	352,500
オーハシテクニカ	800	1,529.00	1,223,200
白銅	500	1,880.00	940,000
ダイコー通産	200	1,528.00	305,600
伊藤忠商事	98,800	3,302.00	326,237,600
丸紅	142,100	993.90	141,233,190
高島	300	1,820.00	546,000
長瀬産業	7,900	1,658.00	13,098,200
蝶理	900	1,696.00	1,526,400
豊田通商	14,500	5,430.00	78,735,000
三共生興	2,200	527.00	1,159,400
兼松	5,800	1,463.00	8,485,400
ツカモトコーポレーション	300	1,387.00	416,100
三井物産	114,900	2,604.00	299,199,600

日本紙パルプ商事	800	3,580.00	2,864,000
カメイ	1,900	1,153.00	2,190,700
東都水産	200	4,740.00	948,000
OUGホールディングス	200	2,834.00	566,800
スターゼン	1,100	2,142.00	2,356,200
山善	5,600	977.00	5,471,200
椿本興業	300	3,485.00	1,045,500
住友商事	90,900	1,534.00	139,440,600
内田洋行	600	4,965.00	2,979,000
三菱商事	87,700	3,052.00	267,660,400
第一実業	700	4,250.00	2,975,000
キャノンマーケティングジャパン	3,600	2,700.00	9,720,000
西華産業	800	1,835.00	1,468,000
佐藤商事	1,200	1,065.00	1,278,000
菱洋エレクトロ	1,100	2,603.00	2,863,300
東京産業	1,400	608.00	851,200
ユアサ商事	1,500	3,100.00	4,650,000
神鋼商事	300	2,439.00	731,700
トルク	1,000	249.00	249,000
阪和興業	2,900	3,300.00	9,570,000
正栄食品工業	900	3,920.00	3,528,000
カナデン	1,200	1,073.00	1,287,600
菱電商事	1,100	1,620.00	1,782,000
フルサト工業	700	1,910.00	1,337,000
岩谷産業	3,500	6,330.00	22,155,000
ナイス	600	2,075.00	1,245,000
昭光通商	300	793.00	237,900
ニチモウ	300	2,064.00	619,200
極東貿易	400	2,271.00	908,400
アステナホールディングス	2,100	664.00	1,394,400
三愛石油	3,600	1,218.00	4,384,800
稲畑産業	3,500	1,721.00	6,023,500
G S Iクレオス	800	1,022.00	817,600
明和産業	1,400	471.00	659,400
クワザワホールディングス	600	616.00	369,600
ヤマエ久野	1,100	1,141.00	1,255,100
ワキタ	2,900	1,119.00	3,245,100
東邦ホールディングス	4,600	1,704.00	7,838,400
サンゲツ	3,900	1,558.00	6,076,200
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,231.00	2,708,200
シナネンホールディングス	500	2,936.00	1,468,000
伊藤忠エネクス	3,200	1,011.00	3,235,200

サンリオ	4,100	1,950.00	7,995,000
サンワテクノス	1,000	1,178.00	1,178,000
リョーサン	1,600	2,047.00	3,275,200
新光商事	2,000	755.00	1,510,000
トーホー	700	1,706.00	1,194,200
三信電気	800	2,155.00	1,724,000
東陽テクニカ	1,400	1,110.00	1,554,000
モスフードサービス	2,000	3,065.00	6,130,000
加賀電子	1,300	3,075.00	3,997,500
ソーダニッカ	1,500	567.00	850,500
立花エレテック	1,100	1,481.00	1,629,100
フォーバル	600	837.00	502,200
PALTAC	2,300	5,940.00	13,662,000
三谷産業	2,000	387.00	774,000
太平洋興発	700	642.00	449,400
西本Wismettacホールディングス	300	2,811.00	843,300
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,895.00	189,500
コア商事ホールディングス	1,200	741.00	889,200
国際紙パルプ商事	3,300	252.00	831,600
ヤマタネ	600	1,513.00	907,800
丸紅建材リース	200	1,817.00	363,400
日鉄物産	1,000	4,435.00	4,435,000
泉州電業	400	3,575.00	1,430,000
トラスコ中山	3,300	2,881.00	9,507,300
オートバックスセブン	5,400	1,478.00	7,981,200
モリト	1,100	613.00	674,300
加藤産業	2,100	3,340.00	7,014,000
北恵	400	972.00	388,800
イノテック	800	1,359.00	1,087,200
イエローハット	2,700	1,911.00	5,159,700
JKホールディングス	1,400	792.00	1,108,800
日伝	1,200	2,183.00	2,619,600
北沢産業	1,100	256.00	281,600
杉本商事	800	2,191.00	1,752,800
因幡電機産業	3,900	2,575.00	10,042,500
東テク	500	2,702.00	1,351,000
ミスミグループ本社	18,100	3,730.00	67,513,000
アルテック	1,100	348.00	382,800
タキヒヨー	500	1,838.00	919,000
蔵王産業	300	1,471.00	441,300
スズケン	6,100	3,505.00	21,380,500
ジェコス	1,100	883.00	971,300

グローセル	1,700	425.00	722,500
ローソン	3,700	5,030.00	18,611,000
サンエー	1,100	4,300.00	4,730,000
カワチ薬品	1,000	2,277.00	2,277,000
エービーシー・マート	2,300	6,400.00	14,720,000
ハードオフコーポレーション	700	787.00	550,900
アスクル	2,300	1,832.00	4,213,600
ゲオホールディングス	2,000	1,200.00	2,400,000
アダストリア	2,000	1,994.00	3,988,000
ジーフット	1,000	414.00	414,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	423.00	126,900
くら寿司	1,700	4,185.00	7,114,500
キャンドゥ	700	1,961.00	1,372,700
アイケイ	400	805.00	322,000
パルグループホールディングス	1,300	1,670.00	2,171,000
エディオン	6,100	1,052.00	6,417,200
サーラコーポレーション	3,100	593.00	1,838,300
ワッツ	800	929.00	743,200
ハローズ	600	2,717.00	1,630,200
フジオフードグループ本社	1,300	1,336.00	1,736,800
あみやき亭	300	2,920.00	876,000
ひらまつ	2,900	227.00	658,300
大黒天物産	500	8,160.00	4,080,000
ハニーズホールディングス	1,200	1,023.00	1,227,600
ファーマライズホールディングス	400	778.00	311,200
アルペン	1,100	2,943.00	3,237,300
ハブ	500	810.00	405,000
クオールホールディングス	2,000	1,530.00	3,060,000
ジinzホールディングス	1,000	8,130.00	8,130,000
ビックカメラ	8,600	1,142.00	9,821,200
D C Mホールディングス	8,900	1,050.00	9,345,000
Monotaro	20,500	2,643.00	54,181,500
東京一番フーズ	400	592.00	236,800
アーランドサービスホールディングス	1,200	2,288.00	2,745,600
J.フロント リテイリング	17,200	1,116.00	19,195,200
ドトール・日レスホールディングス	2,300	1,712.00	3,937,600
マツモトキヨシホールディングス	6,000	4,945.00	29,670,000
ブロンコビリー	800	2,433.00	1,946,400
Z O Z O	8,500	3,710.00	31,535,000
トレジャー・ファクトリー	500	955.00	477,500
物語コーポレーション	800	7,180.00	5,744,000
ココカラファイン	1,300	8,300.00	10,790,000

三越伊勢丹ホールディングス	25,300	841.00	21,277,300
H a m e e	400	1,680.00	672,000
マーケットエンタープライズ	100	1,212.00	121,200
ウエルシアホールディングス	7,600	3,590.00	27,284,000
クリエイティブSDホールディングス	2,100	3,315.00	6,961,500
丸善CHIホールディングス	1,800	411.00	739,800
ミサワ	400	718.00	287,200
ティーライフ	200	1,505.00	301,000
シュッピン	1,000	1,075.00	1,075,000
オイシックス・ラ・大地	1,900	3,630.00	6,897,000
ネクステージ	2,600	1,707.00	4,438,200
ジョイフル本田	4,200	1,358.00	5,703,600
鳥貴族ホールディングス	600	1,924.00	1,154,400
ホットランド	1,100	1,416.00	1,557,600
すかいらーくホールディングス	18,400	1,577.00	29,016,800
SFPホールディングス	700	1,496.00	1,047,200
綿半ホールディングス	1,100	1,244.00	1,368,400
ヨシックス	300	2,416.00	724,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,200	1,110.00	4,662,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,507.00	1,205,600
B E E N O S	700	3,615.00	2,530,500
あさひ	1,100	1,404.00	1,544,400
日本調剤	900	1,600.00	1,440,000
コスモス薬品	1,500	16,260.00	24,390,000
トーエル	700	809.00	566,300
オンリー	300	470.00	141,000
セブン&アイ・ホールディングス	56,400	5,006.00	282,338,400
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	7,800	880.00	6,864,000
ツルハホールディングス	3,100	14,160.00	43,896,000
サンマルクホールディングス	1,200	1,632.00	1,958,400
フェリシモ	400	1,408.00	563,200
トリドールホールディングス	3,600	1,813.00	6,526,800
T O K Y O B A S E	1,300	722.00	938,600
ウイルプラスホールディングス	200	1,217.00	243,400
J Mホールディングス	1,000	2,111.00	2,111,000
サツドラホールディングス	200	2,069.00	413,800
アレンザホールディングス	1,100	1,256.00	1,381,600
串カツ田中ホールディングス	400	1,883.00	753,200
パロックジャパンリミテッド	1,100	795.00	874,500
クスリのアオキホールディングス	1,400	8,560.00	11,984,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E	8,400	4,880.00	40,992,000

メディカルシステムネットワーク	1,400	723.00	1,012,200
はるやまホールディングス	700	674.00	471,800
ノジマ	2,600	3,005.00	7,813,000
カップ・クリエイト	2,100	1,468.00	3,082,800
ライトオン	1,200	699.00	838,800
良品計画	16,600	2,108.00	34,992,800
三城ホールディングス	1,900	270.00	513,000
アドヴァン	1,500	962.00	1,443,000
アルビス	500	2,268.00	1,134,000
コナカ	1,800	365.00	657,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,636.00	327,200
G - 7ホールディングス	700	3,020.00	2,114,000
イオン北海道	2,000	1,053.00	2,106,000
コジマ	2,600	731.00	1,900,600
ヒマラヤ	500	1,004.00	502,000
コーナン商事	2,100	3,720.00	7,812,000
エコス	600	1,915.00	1,149,000
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	28,800	2,415.00	69,552,000
西松屋チェーン	3,200	1,502.00	4,806,400
ゼンショーホールディングス	7,800	2,779.00	21,676,200
幸楽苑ホールディングス	900	1,617.00	1,455,300
ハークスレイ	300	1,025.00	307,500
サイゼリヤ	2,200	2,645.00	5,819,000
V Tホールディングス	5,500	477.00	2,623,500
魚力	500	1,981.00	990,500
フジ・コーポレーション	800	1,298.00	1,038,400
ユナイテッドアローズ	1,700	2,242.00	3,811,400
ハイデイ日高	2,100	1,780.00	3,738,000
京都きもの友禅	1,000	284.00	284,000
コロワイド	4,800	2,000.00	9,600,000
ピーシーデポコーポレーション	1,800	459.00	826,200
壱番屋	1,000	4,840.00	4,840,000
P L A N T	400	722.00	288,800
スギホールディングス	2,900	8,950.00	25,955,000
薬王堂ホールディングス	600	2,423.00	1,453,800
スクロール	2,100	854.00	1,793,400
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,932.00	2,704,800
木曽路	1,900	2,389.00	4,539,100
S R Sホールディングス	1,900	822.00	1,561,800
千趣会	2,700	411.00	1,109,700
リテールパートナーズ	1,800	1,214.00	2,185,200
ケーヨー	2,700	758.00	2,046,600

上新電機	1,700	2,782.00	4,729,400
日本瓦斯	7,100	1,814.00	12,879,400
ロイヤルホールディングス	2,500	2,246.00	5,615,000
東天紅	200	1,109.00	221,800
いなげや	1,600	1,478.00	2,364,800
チヨダ	1,500	905.00	1,357,500
ライフコーポレーション	1,400	3,580.00	5,012,000
リンガーハット	1,800	2,318.00	4,172,400
MrMaxHD	2,100	645.00	1,354,500
AOKIホールディングス	3,000	706.00	2,118,000
オークワ	2,300	1,119.00	2,573,700
コメリ	2,200	2,642.00	5,812,400
青山商事	3,300	823.00	2,715,900
しまむら	1,700	9,700.00	16,490,000
はせがわ	900	299.00	269,100
高島屋	10,500	1,303.00	13,681,500
松屋	3,200	984.00	3,148,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,900	942.00	6,499,800
近鉄百貨店	600	3,200.00	1,920,000
丸井グループ	12,200	2,152.00	26,254,400
アクシアル リテイリング	1,200	3,895.00	4,674,000
イオン	55,500	3,002.00	166,611,000
イズミ	2,900	4,215.00	12,223,500
平和堂	2,700	2,307.00	6,228,900
フジ	1,800	1,983.00	3,569,400
ヤオコー	1,600	6,460.00	10,336,000
ゼビオホールディングス	1,800	996.00	1,792,800
ケーズホールディングス	12,300	1,295.00	15,928,500
Olympicグループ	800	791.00	632,800
日産東京販売ホールディングス	2,300	242.00	556,600
シルバーライフ	300	2,415.00	724,500
Genky DrugStores	600	3,610.00	2,166,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,160.00	348,000
ブックオフグループホールディングス	900	941.00	846,900
ギフト	200	2,611.00	522,200
アインホールディングス	2,100	7,060.00	14,826,000
元気寿司	400	2,651.00	1,060,400
ヤマダホールディングス	48,400	518.00	25,071,200
アーランドサカモト	2,300	1,462.00	3,362,600
ニトリホールディングス	5,700	18,925.00	107,872,500
愛眼	1,200	230.00	276,000
ケーユーホールディングス	800	960.00	768,000

吉野家ホールディングス	4,800	2,077.00	9,969,600	
松屋フーズホールディングス	700	3,545.00	2,481,500	
サガミホールディングス	2,100	1,033.00	2,169,300	
関西スーパーマーケット	1,100	1,014.00	1,115,400	
王将フードサービス	1,000	5,620.00	5,620,000	
プレナス	1,600	2,025.00	3,240,000	
ミニストップ	1,100	1,402.00	1,542,200	
アークス	2,800	2,448.00	6,854,400	
パローホールディングス	3,000	2,269.00	6,807,000	
藤久	400	826.00	330,400	
ベルク	700	5,650.00	3,955,000	
大庄	800	1,107.00	885,600	
ファーストリテイリング	1,900	84,060.00	159,714,000	
サンドラッグ	5,400	3,625.00	19,575,000	
サックスパー ホールディングス	1,300	635.00	825,500	
ヤマザワ	400	1,712.00	684,800	
やまや	300	2,289.00	686,700	
ベルーナ	3,100	1,066.00	3,304,600	
島根銀行	500	643.00	321,500	
じもとホールディングス	1,000	658.00	658,000	
めぶきフィナンシャルグループ	74,900	237.00	17,751,300	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	1,444.00	2,599,200	
九州フィナンシャルグループ	29,400	396.00	11,642,400	
ゆうちょ銀行	40,900	931.00	38,077,900	
富山第一銀行	3,500	279.00	976,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	87,900	415.00	36,478,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,400	657.00	6,175,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,332.00	1,731,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	2,393.00	5,503,900	
ひろぎんホールディングス	21,300	574.00	12,226,200	
新生銀行	11,800	1,573.00	18,561,400	
あおぞら銀行	8,600	2,482.00	21,345,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	986,900	608.80	600,824,720	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	166,500	448.10	74,608,650	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,200	3,662.00	99,606,400	
三井住友フィナンシャルグループ	99,800	3,920.00	391,216,000	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	48,100	694.00	33,381,400	
群馬銀行	29,700	357.00	10,602,900	
武蔵野銀行	2,100	1,668.00	3,502,800	
千葉興業銀行	3,700	263.00	973,100	
筑波銀行	6,000	170.00	1,020,000	

七十七銀行	4,500	1,259.00	5,665,500
青森銀行	1,100	2,084.00	2,292,400
秋田銀行	900	1,399.00	1,259,100
山形銀行	1,600	863.00	1,380,800
岩手銀行	1,000	1,749.00	1,749,000
東邦銀行	13,000	205.00	2,665,000
東北銀行	700	1,025.00	717,500
みちのく銀行	900	973.00	875,700
ふくおかフィナンシャルグループ	13,000	1,985.00	25,805,000
静岡銀行	35,100	897.00	31,484,700
十六銀行	1,800	1,939.00	3,490,200
スルガ銀行	12,600	335.00	4,221,000
八十二銀行	32,500	362.00	11,765,000
山梨中央銀行	1,700	828.00	1,407,600
大垣共立銀行	2,800	1,882.00	5,269,600
福井銀行	1,300	1,444.00	1,877,200
北國銀行	1,300	2,173.00	2,824,900
清水銀行	600	1,516.00	909,600
富山銀行	300	2,569.00	770,700
滋賀銀行	2,900	2,057.00	5,965,300
南都銀行	2,100	1,831.00	3,845,100
百五銀行	13,000	304.00	3,952,000
京都銀行	5,200	5,200.00	27,040,000
紀陽銀行	5,100	1,464.00	7,466,400
ほくほくフィナンシャルグループ	9,600	843.00	8,092,800
山陰合同銀行	9,100	539.00	4,904,900
中国銀行	12,400	853.00	10,577,200
鳥取銀行	500	1,120.00	560,000
伊予銀行	19,100	550.00	10,505,000
百十四銀行	1,500	1,464.00	2,196,000
四国銀行	2,000	700.00	1,400,000
阿波銀行	2,200	2,032.00	4,470,400
大分銀行	800	1,700.00	1,360,000
宮崎銀行	900	2,007.00	1,806,300
佐賀銀行	800	1,381.00	1,104,800
沖縄銀行	1,300	2,549.00	3,313,700
琉球銀行	3,200	729.00	2,332,800
セブン銀行	48,200	231.00	11,134,200
みずほフィナンシャルグループ	196,000	1,624.50	318,402,000
高知銀行	500	843.00	421,500
山口フィナンシャルグループ	18,000	644.00	11,592,000
長野銀行	500	1,106.00	553,000

名古屋銀行	1,200	2,584.00	3,100,800
北洋銀行	21,700	240.00	5,208,000
愛知銀行	500	2,803.00	1,401,500
中京銀行	500	1,463.00	731,500
大光銀行	500	1,399.00	699,500
愛媛銀行	2,000	806.00	1,612,000
トマト銀行	600	1,042.00	625,200
京葉銀行	6,200	411.00	2,548,200
栃木銀行	7,000	172.00	1,204,000
北日本銀行	500	1,721.00	860,500
東和銀行	2,500	529.00	1,322,500
福島銀行	1,700	230.00	391,000
大東銀行	700	606.00	424,200
トモニホールディングス	11,100	298.00	3,307,800
フィデアホールディングス	14,200	120.00	1,704,000
池田泉州ホールディングス	16,700	160.00	2,672,000
F P G	4,900	775.00	3,797,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,000	1,561.00	1,561,000
マーキュリアインベストメント	600	741.00	444,600
S B Iホールディングス	17,800	2,701.00	48,077,800
ジャフコ グループ	2,200	7,300.00	16,060,000
大和証券グループ本社	108,100	638.00	68,967,800
野村ホールディングス	220,300	585.40	128,963,620
岡三証券グループ	12,300	427.00	5,252,100
丸三証券	4,300	629.00	2,704,700
東洋証券	4,900	168.00	823,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,400	408.00	6,283,200
光世証券	400	634.00	253,600
水戸証券	3,900	302.00	1,177,800
いちよし証券	3,000	579.00	1,737,000
松井証券	7,100	824.00	5,850,400
マネックスグループ	12,900	810.00	10,449,000
極東証券	2,000	811.00	1,622,000
岩井コスモホールディングス	1,500	1,668.00	2,502,000
藍澤証券	2,600	1,064.00	2,766,400
マネーパートナーズグループ	1,600	248.00	396,800
スパークス・グループ	6,800	266.00	1,808,800
かんぽ生命保険	17,900	2,104.00	37,661,600
S O M P Oホールディングス	25,400	4,290.00	108,966,000
アニコム ホールディングス	4,100	939.00	3,849,900
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,100	3,334.00	117,023,400
第一生命ホールディングス	76,200	2,165.50	165,011,100

東京海上ホールディングス	47,500	5,165.00	245,337,500
T & Dホールディングス	43,200	1,451.00	62,683,200
アドバンスクリエイト	700	915.00	640,500
全国保証	3,800	4,820.00	18,316,000
ジェイリース	500	1,158.00	579,000
イントラスト	400	742.00	296,800
日本モーゲージサービス	800	1,000.00	800,000
C a s a	400	980.00	392,000
アルヒ	2,100	1,519.00	3,189,900
プレミアグループ	700	3,640.00	2,548,000
クレディセゾン	8,400	1,414.00	11,877,600
芙蓉総合リース	1,500	7,110.00	10,665,000
みずほリース	2,200	3,475.00	7,645,000
東京センチュリー	3,300	5,960.00	19,668,000
日本証券金融	6,100	863.00	5,264,300
アイフル	24,200	378.00	9,147,600
リコーリース	1,100	3,400.00	3,740,000
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,318.00	11,598,400
アコム	29,000	510.00	14,790,000
ジャックス	1,600	2,590.00	4,144,000
オリエントコーポレーション	38,900	155.00	6,029,500
オリックス	87,600	1,933.00	169,330,800
三菱HCキャピタル	49,900	602.00	30,039,800
九州リースサービス	700	672.00	470,400
日本取引所グループ	39,000	2,559.50	99,820,500
イー・ギャランティ	1,700	2,264.00	3,848,800
アサックス	800	696.00	556,800
NECキャピタルソリューション	600	2,152.00	1,291,200
いちご	16,100	373.00	6,005,300
日本駐車場開発	16,200	161.00	2,608,200
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,155.00	924,000
SREホールディングス	200	6,790.00	1,358,000
ADワークスグループ	3,200	166.00	531,200
ヒューリック	30,600	1,313.00	40,177,800
三栄建築設計	600	1,994.00	1,196,400
野村不動産ホールディングス	8,800	2,936.00	25,836,800
三重交通グループホールディングス	3,000	481.00	1,443,000
サムティ	2,100	2,017.00	4,235,700
ディア・ライフ	2,000	470.00	940,000
コーセーアールイー	500	639.00	319,500
日本商業開発	900	1,868.00	1,681,200
プレサンスコーポレーション	2,400	1,517.00	3,640,800

THE グローバル社	1,100	246.00	270,600
ハウスコム	300	1,285.00	385,500
日本管理センター	800	1,304.00	1,043,200
サンセイランディック	500	887.00	443,500
エストラスト	300	679.00	203,700
フージャースホールディングス	2,400	737.00	1,768,800
オープンハウス	4,600	5,200.00	23,920,000
東急不動産ホールディングス	39,300	729.00	28,649,700
飯田グループホールディングス	12,000	2,957.00	35,484,000
イーランド	300	1,031.00	309,300
ムゲンエステート	1,000	509.00	509,000
ビーロッド	700	617.00	431,900
ファーストブラザーズ	300	1,016.00	304,800
ハウストゥ	800	1,053.00	842,400
シーアールイー	400	1,539.00	615,600
プロパティエージェント	300	2,398.00	719,400
ケイアイスター不動産	500	5,020.00	2,510,000
アグレ都市デザイン	300	1,044.00	313,200
グッドコムアセット	700	1,440.00	1,008,000
ジェイ・エス・ビー	300	3,735.00	1,120,500
テンポイノベーション	500	905.00	452,500
グローバル・リンク・マネジメント	300	894.00	268,200
フェイスネットワーク	200	1,340.00	268,000
パーク24	7,800	2,181.00	17,011,800
パラカ	400	1,631.00	652,400
三井不動産	65,800	2,748.00	180,818,400
三菱地所	94,800	1,932.50	183,201,000
平和不動産	2,500	4,245.00	10,612,500
東京建物	14,300	1,717.00	24,553,100
ダイビル	3,700	1,400.00	5,180,000
京阪神ビルディング	2,500	1,413.00	3,532,500
住友不動産	32,400	4,175.00	135,270,000
テオーシー	2,900	703.00	2,038,700
東京楽天地	200	4,240.00	848,000
スターツコーポレーション	1,700	2,773.00	4,714,100
フジ住宅	1,800	636.00	1,144,800
空港施設	1,500	655.00	982,500
明和地所	800	620.00	496,000
ゴールドクレスト	1,300	1,793.00	2,330,900
エスリード	600	1,625.00	975,000
日神グループホールディングス	2,200	453.00	996,600
日本エスコン	2,700	788.00	2,127,600

タカラレーベン	6,200	345.00	2,139,000
A V A N T I A	800	893.00	714,400
イオンモール	7,300	1,808.00	13,198,400
毎日コムネット	600	715.00	429,000
ファースト住建	600	1,208.00	724,800
カチタス	3,600	3,155.00	11,358,000
トーセイ	2,100	1,106.00	2,322,600
サンフロンティア不動産	1,800	1,013.00	1,823,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	1,018.00	1,527,000
インテリックス	400	772.00	308,800
ランドビジネス	800	362.00	289,600
グランディハウス	1,100	423.00	465,300
日本空港ビルデング	5,000	5,560.00	27,800,000
明豊ファシリティワークス	600	868.00	520,800
日本工営	900	3,240.00	2,916,000
L I F U L L	4,300	361.00	1,552,300
ミクシィ	3,600	2,938.00	10,576,800
ジェイエシーリクルートメント	1,000	1,777.00	1,777,000
日本M&Aセンター	22,900	2,793.00	63,959,700
メンバーズ	400	3,310.00	1,324,000
中広	200	369.00	73,800
UTグループ	2,000	3,265.00	6,530,000
アイティメディア	500	1,855.00	927,500
タケエイ	1,600	1,344.00	2,150,400
E・Jホールディングス	700	1,139.00	797,300
夢真ビーネックスグループ	3,700	1,287.00	4,761,900
コシダカホールディングス	3,800	638.00	2,424,400
アルトナー	300	892.00	267,600
パソナグループ	1,500	2,199.00	3,298,500
C D S	300	1,523.00	456,900
リンクアンドモチベーション	2,600	664.00	1,726,400
G C A	1,800	1,030.00	1,854,000
エス・エム・エス	4,700	3,400.00	15,980,000
サニーサイドアップグループ	500	841.00	420,500
パーソルホールディングス	14,000	2,249.00	31,486,000
リニカル	800	806.00	644,800
クックパッド	4,400	256.00	1,126,400
エスクリ	400	489.00	195,600
アイ・ケイ・ケイ	700	675.00	472,500
学情	500	1,422.00	711,000
スタジオアリス	700	2,311.00	1,617,700
シミックホールディングス	800	1,583.00	1,266,400

エプコ	300	944.00	283,200
N J S	400	2,085.00	834,000
総合警備保障	5,600	5,220.00	29,232,000
カカクコム	10,300	3,390.00	34,917,000
アイロムグループ	500	2,109.00	1,054,500
セントケア・ホールディング	1,000	1,090.00	1,090,000
サイネックス	200	680.00	136,000
ルネサンス	900	1,301.00	1,170,900
ディップ	2,200	3,510.00	7,722,000
デジタルホールディングス	1,000	2,483.00	2,483,000
新日本科学	1,700	830.00	1,411,000
キャリアデザインセンター	400	1,085.00	434,000
ベネフィット・ワン	5,100	3,535.00	18,028,500
エムスリー	24,700	7,821.00	193,178,700
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	426.00	468,600
プラス	200	618.00	123,600
アウトソーシング	8,000	2,119.00	16,952,000
ウェルネット	1,400	523.00	732,200
ワールドホールディングス	500	3,005.00	1,502,500
ディー・エヌ・エー	5,900	2,313.00	13,646,700
博報堂D Yホールディングス	19,500	1,797.00	35,041,500
ぐるなび	2,400	586.00	1,406,400
タカミヤ	1,700	532.00	904,400
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	830.00	830,000
ファンコミュニケーションズ	3,800	385.00	1,463,000
ライク	400	2,097.00	838,800
ビジネス・ブレークスルー	600	434.00	260,400
エスプール	3,600	984.00	3,542,400
W D Bホールディングス	600	2,796.00	1,677,600
手間いらず	200	6,550.00	1,310,000
ティア	800	473.00	378,400
C D G	100	1,578.00	157,800
アドウェイズ	2,300	889.00	2,044,700
バリューコマース	900	3,400.00	3,060,000
インフォマート	14,100	1,014.00	14,297,400
J Pホールディングス	4,000	283.00	1,132,000
エコナックホールディングス	2,500	92.00	230,000
E P Sホールディングス	2,100	1,798.00	3,775,800
レッグス	300	2,930.00	879,000
プレステージ・インターナショナル	5,200	721.00	3,749,200
アミューズ	800	2,393.00	1,914,400
ドリームインキュベータ	400	960.00	384,000

クイック	900	1,230.00	1,107,000
T A C	800	238.00	190,400
電通グループ	15,700	3,870.00	60,759,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,046.00	732,200
ぴあ	400	3,445.00	1,378,000
イオンファンタジー	500	2,318.00	1,159,000
シーティーエス	1,600	880.00	1,408,000
ネクシィーズグループ	500	931.00	465,500
H . U . グループホールディングス	3,900	2,943.00	11,477,700
アルプス技研	1,200	1,997.00	2,396,400
ダイオーズ	300	1,028.00	308,400
日本空調サービス	1,500	722.00	1,083,000
オリエンタルランド	14,900	16,340.00	243,466,000
ダスキン	3,200	2,562.00	8,198,400
明光ネットワークジャパン	1,700	593.00	1,008,100
ファルコホールディングス	700	1,688.00	1,181,600
秀英予備校	300	402.00	120,600
ラウンドワン	4,800	1,438.00	6,902,400
リゾートトラスト	6,400	1,809.00	11,577,600
ビー・エム・エル	1,800	3,665.00	6,597,000
りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,327.00	2,786,700
リソー教育	7,100	317.00	2,250,700
早稲田アカデミー	600	915.00	549,000
ユー・エス・エス	15,600	1,867.00	29,125,200
東京個別指導学院	1,300	615.00	799,500
サイバーエージェント	34,400	2,233.00	76,815,200
楽天グループ	65,200	1,313.00	85,607,600
クリーク・アンド・リバー社	700	1,536.00	1,075,200
モーニングスター	2,100	446.00	936,600
テー・オー・ダブリュ	2,500	338.00	845,000
山田コンサルティンググループ	800	1,174.00	939,200
セントラルスポーツ	500	2,560.00	1,280,000
フルキャストホールディングス	1,200	2,188.00	2,625,600
エン・ジャパン	2,500	3,905.00	9,762,500
リソルホールディングス	200	4,000.00	800,000
テクノプロ・ホールディングス	2,800	7,850.00	21,980,000
アトラグループ	300	335.00	100,500
インターワークス	400	419.00	167,600
アイ・アールジャパンホールディングス	600	13,940.00	8,364,000
K e e P e r 技研	900	2,579.00	2,321,100
ファーストロジック	300	760.00	228,000
三機サービス	300	1,051.00	315,300

Gunosy	900	973.00	875,700
デザインワン・ジャパン	400	229.00	91,600
イー・ガーディアン	600	2,798.00	1,678,800
リブセンス	800	234.00	187,200
ジャパンマテリアル	4,300	1,349.00	5,800,700
ベクトル	1,800	959.00	1,726,200
ウチヤマホールディングス	600	403.00	241,800
チャーム・ケア・コーポレーション	1,000	1,191.00	1,191,000
キャリアリンク	500	2,349.00	1,174,500
I B J	1,100	1,175.00	1,292,500
アサンテ	500	1,770.00	885,000
バリューHR	600	1,747.00	1,048,200
M & Aキャピタルパートナーズ	1,100	4,750.00	5,225,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,514.00	757,000
E R Iホールディングス	400	610.00	244,000
アビスト	200	2,910.00	582,000
シグマクシス	800	2,298.00	1,838,400
ウィルグループ	1,000	1,015.00	1,015,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,100	249.00	522,900
メドピア	1,100	4,675.00	5,142,500
レアジョブ	300	1,886.00	565,800
リクルートホールディングス	100,100	5,739.00	574,473,900
エラン	1,900	1,298.00	2,466,200
土木管理総合試験所	600	381.00	228,600
ネットマーケティング	700	417.00	291,900
日本郵政	105,700	907.70	95,943,890
ベルシステム24ホールディングス	2,300	1,769.00	4,068,700
鎌倉新書	1,400	1,069.00	1,496,600
S M N	300	799.00	239,700
一蔵	200	448.00	89,600
グローバルキッズCOMPANY	200	1,005.00	201,000
エアトリ	900	2,953.00	2,657,700
アトラエ	1,000	2,114.00	2,114,000
ストライク	500	4,305.00	2,152,500
ソラスト	3,400	1,383.00	4,702,200
セラク	400	2,256.00	902,400
インソース	1,400	2,057.00	2,879,800
ベйкаレント・コンサルティング	900	37,450.00	33,705,000
Orchestra Holdings	300	2,992.00	897,600
アイモバイル	400	1,878.00	751,200
キャリアインデックス	500	862.00	431,000
MS - Japan	600	1,113.00	667,800

船場	300	821.00	246,300
グレイステクノロジー	1,400	1,714.00	2,399,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,000	2,565.00	10,260,000
フルテック	200	1,360.00	272,000
ツナググループ・ホールディングス	300	397.00	119,100
GameWith	400	621.00	248,400
ソウルドアウト	300	1,776.00	532,800
MS&Consulting	200	633.00	126,600
ウェルビー	500	1,412.00	706,000
エル・ティー・エス	100	3,700.00	370,000
ミダック	300	6,800.00	2,040,000
日総工産	1,100	831.00	914,100
キュービーネットホールディングス	600	1,795.00	1,077,000
RPAホールディングス	1,600	744.00	1,190,400
スプリックス	400	1,364.00	545,600
マネジメントソリューションズ	700	2,281.00	1,596,700
プロレド・パートナーズ	300	2,567.00	770,100
and factory	300	713.00	213,900
テノ・ホールディングス	100	1,200.00	120,000
フロンティア・マネジメント	300	1,271.00	381,300
ピアラ	100	1,110.00	111,000
コプロ・ホールディングス	200	1,292.00	258,400
ギークス	200	1,867.00	373,400
カーブスホールディングス	3,800	905.00	3,439,000
フォーラムエンジニアリング	1,000	977.00	977,000
ダイレクトマーケティングミックス	700	4,120.00	2,884,000
ポピンズホールディングス	400	4,865.00	1,946,000
LITALICO	600	5,360.00	3,216,000
アドバンテッジリスクマネジメント	700	1,033.00	723,100
リログループ	7,600	2,593.00	19,706,800
東祥	900	1,967.00	1,770,300
エイチ・アイ・エス	2,200	2,546.00	5,601,200
ラックランド	400	2,742.00	1,096,800
共立メンテナンス	2,300	4,015.00	9,234,500
イチネンホールディングス	1,500	1,236.00	1,854,000
建設技術研究所	900	2,496.00	2,246,400
スペース	900	918.00	826,200
長大	500	1,891.00	945,500
燦ホールディングス	600	1,200.00	720,000
スバル興業	100	8,040.00	804,000
東京テアトル	600	1,264.00	758,400
タナベ経営	300	1,457.00	437,100

ナガワ	400	8,170.00	3,268,000	
東京都競馬	900	4,675.00	4,207,500	
常磐興産	600	1,477.00	886,200	
カナモト	2,500	2,626.00	6,565,000	
西尾レントオール	1,300	3,295.00	4,283,500	
トランス・コスモス	1,300	2,987.00	3,883,100	
乃村工藝社	6,000	964.00	5,784,000	
藤田観光	600	2,322.00	1,393,200	
KNT-CTホールディングス	800	1,441.00	1,152,800	
日本管財	1,500	2,348.00	3,522,000	
トーカイ	1,300	2,448.00	3,182,400	
セコム	13,800	8,785.00	121,233,000	
セントラル警備保障	700	3,190.00	2,233,000	
丹青社	2,700	920.00	2,484,000	
メイテック	1,700	6,300.00	10,710,000	
応用地質	1,600	1,276.00	2,041,600	
船井総研ホールディングス	2,900	2,490.00	7,221,000	
進学会ホールディングス	500	423.00	211,500	
オオバ	1,000	752.00	752,000	
いであ	400	1,795.00	718,000	
学究社	400	1,350.00	540,000	
ベネッセホールディングス	5,100	2,685.00	13,693,500	
イオンディライト	1,700	3,420.00	5,814,000	
ナック	700	919.00	643,300	
ダイセキ	2,300	4,420.00	10,166,000	
ステップ	500	1,582.00	791,000	
合 計	15,357,900		39,658,539,130	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,575,608,964	1,184,685,265
コール・ローン	590,411,800	2,001,159,580
株式	218,512,410,943	229,115,883,421
投資証券	4,951,575,716	5,490,394,239
派生商品評価勘定	9,065,253	66,187,717
未収入金	1,076,421	1,538,527
未収配当金	218,140,492	237,129,382
差入委託証拠金	472,606,405	557,121,294
流動資産合計	226,330,895,994	238,654,099,425
資産合計	226,330,895,994	238,654,099,425
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,377,080	547,285
未払金	123,540	52,370,892
未払解約金	98,573,123	9,915,078
未払利息	307	201
流動負債合計	111,074,050	62,833,456
負債合計	111,074,050	62,833,456
純資産の部		
元本等		
元本	74,383,931,913	63,265,396,098
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	151,835,890,031	175,325,869,871
元本等合計	226,219,821,944	238,591,265,969
純資産合計	226,219,821,944	238,591,265,969
負債純資産合計	226,330,895,994	238,654,099,425

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
1.	期首	2020年 6月16日	2020年12月16日
	期首元本額	90,076,685,860円	74,383,931,913円
	期首からの追加設定元本額	2,414,346,180円	2,601,779,262円
	期首からの一部解約元本額	18,107,100,127円	13,720,315,077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)	21,495,448,352円	23,398,484,888円
	DCインデックスバランス(株式20)	127,112,999円	113,594,891円
	DCインデックスバランス(株式40)	321,179,996円	297,550,908円
	DCインデックスバランス(株式60)	618,527,054円	586,617,893円
	DCインデックスバランス(株式80)	638,142,048円	631,463,325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	1,705,092,519円	1,523,655,093円
	日興五大陸株式ファンド	4,530,819,848円	4,162,772,320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)	57,589,856円	30,655,328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)	128,451,692円	118,772,978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)	6,687,584,441円	6,415,751,839円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	30,245,618,400円	18,965,376,503円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,300,671円	3,827,301円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,305,620円	3,197,684円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	5,162,231円	4,142,866円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	4,512,043円	3,674,744円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,298,365,222円	2,622,823,187円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	25,455,562円	21,181,591円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	71,133,429円	60,542,719円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	104,507,296円	91,524,256円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	99,255,361円	87,887,848円

		2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,212,367,273円	4,121,897,936円
	計	74,383,931,913円	63,265,396,098円
2.	受益権の総数	74,383,931,913口	63,265,396,098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 6月16日 至 2020年12月15日	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

	2020年12月15日現在	2021年 6月15日現在
	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2020年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	13,688,527,036
投資証券	109,795,130
合計	13,798,322,166

（2021年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	42,823,025,253
投資証券	1,148,049,294
合計	43,971,074,547

(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）

（2020年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,747,176,203	-	2,739,520,476	7,655,727
	合計	2,747,176,203	-	2,739,520,476	7,655,727

(2021年 6月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,027,508,243	-	4,078,026,740	50,518,497
合計		4,027,508,243	-	4,078,026,740	50,518,497

(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)

(2020年12月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	939,913,100	-	944,418,000	4,504,900
	米ドル	668,404,860	-	665,850,000	2,554,860
	ユーロ	271,508,240	-	278,568,000	7,059,760
	売建	209,787,600	-	209,948,600	161,000
	米ドル	176,868,000	-	176,987,000	119,000
	豪ドル	32,919,600	-	32,961,600	42,000
合計		1,149,700,700	-	1,154,366,600	4,343,900

(2021年 6月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,444,951,160	-	2,460,275,930	15,324,770
	米ドル	1,914,901,800	-	1,926,299,930	11,398,130
	ユーロ	530,049,360	-	533,976,000	3,926,640
	売建	49,124,300	-	49,327,135	202,835

	加ドル	12,635,700	-	12,695,018	59,318
	ユーロ	23,247,000	-	23,353,925	106,925
	シンガポールドル	13,241,600	-	13,278,192	36,592
	合計	2,494,075,460	-	2,509,603,065	15,121,935

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年12月15日現在		2021年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	3.0412円	1口当たり純資産額	3.7713円
(1万口当たり純資産額)	(30,412円)	(1万口当たり純資産額)	(37,713円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES CO	25,945	24.74	641,879.30	
	CHENIERE ENERGY INC	8,760	88.82	778,063.20	
	CHEVRON CORP	75,971	107.97	8,202,588.87	
	CONOCOPHILLIPS	53,256	60.31	3,211,869.36	
	DEVON ENERGY CORPORATION	23,000	28.98	666,540.00	
	EOG RESOURCES INC	24,062	84.86	2,041,901.32	
	EXXON MOBIL CORP	166,921	62.07	10,360,786.47	
	HALLIBURTON CO	34,687	23.60	818,613.20	

HESS CORP	10,910	88.67	967,389.70
KINDER MORGAN INC	80,380	18.84	1,514,359.20
MARATHON PETROLEUM CORP	27,132	62.99	1,709,044.68
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	37,921	28.28	1,072,405.88
ONEOK INC	17,040	55.44	944,697.60
PHILLIPS 66	16,285	91.44	1,489,100.40
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,570	162.13	1,389,454.10
SCHLUMBERGER LTD	51,631	34.05	1,758,035.55
VALERO ENERGY CORP	16,882	81.95	1,383,479.90
WILLIAMS COS INC	50,374	27.52	1,386,292.48
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,725	299.12	2,609,822.00
ALBEMARLE CORP	4,890	168.34	823,182.60
AMCOR PLC	67,580	12.15	821,097.00
AVERY DENNISON CORP	3,200	213.56	683,392.00
BALL CORP	13,280	81.12	1,077,273.60
CELANESE CORP	5,120	156.47	801,126.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,070	52.69	477,898.30
CORTEVA INC	28,232	43.96	1,241,078.72
CROWN HOLDINGS INC	5,235	100.11	524,075.85
DOW INC	30,625	66.96	2,050,650.00
DUPONT DE NEMOURS INC	22,262	81.55	1,815,466.10
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	122.10	622,099.50
ECOLAB INC	9,820	213.24	2,094,016.80
FMC CORP	5,140	118.46	608,884.40
FREEPORT-MCMORAN INC	56,488	39.48	2,230,146.24
INTERNATIONAL PAPER CO	15,950	62.30	993,685.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,315	147.77	1,376,477.55
LINDE PLC	20,830	290.91	6,059,655.30
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	108.52	1,090,626.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,425	347.31	842,226.75
MOSAIC CO/THE	14,870	33.13	492,643.10
NEWMONT CORP	30,352	69.83	2,119,480.16
NUCOR CORP	12,939	102.71	1,328,964.69
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	138.86	497,118.80
PPG INDUSTRIES INC	8,774	175.38	1,538,784.12

RPM INTERNATIONAL INC	5,590	90.96	508,466.40
SEALED AIR CORP	7,116	58.60	416,997.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,921	273.76	2,715,972.96
STEEL DYNAMICS INC	7,510	63.13	474,106.30
VULCAN MATERIALS CO	5,383	171.73	924,422.59
WESTROCK CO	10,519	55.27	581,385.13
3M CO	22,886	201.36	4,608,324.96
ALLEGION PLC	3,850	138.31	532,493.50
AMETEK INC	8,943	136.18	1,217,857.74
BOEING CO/THE	21,282	245.14	5,217,069.48
CARRIER GLOBAL CORP	34,588	46.21	1,598,311.48
CATERPILLAR INC	21,556	219.01	4,720,979.56
CUMMINS INC	6,235	248.44	1,549,023.40
DEERE & CO	11,810	335.54	3,962,727.40
DOVER CORP	6,280	150.34	944,135.20
EATON CORP PLC	15,806	146.00	2,307,676.00
EMERSON ELECTRIC CO	24,390	97.38	2,375,098.20
FASTENAL CO	20,886	52.73	1,101,318.78
FORTIVE CORP	13,254	71.11	942,491.94
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,570	97.95	545,581.50
GENERAC HOLDINGS INC	2,180	355.09	774,096.20
GENERAL DYNAMICS CORP	10,092	190.84	1,925,957.28
GENERAL ELECTRIC CO	347,503	13.47	4,680,865.41
HEICO CORP	2,000	143.52	287,040.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	131.08	325,078.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,856	223.17	6,216,623.52
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	34.96	510,520.88
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,800	219.80	395,640.00
IDEX CORP	2,830	220.83	624,948.90
ILLINOIS TOOL WORKS	12,525	232.43	2,911,185.75
INGERSOLL-RAND INC	12,038	47.53	572,166.14
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,370	62.77	588,154.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,824	66.16	1,840,835.84
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,205	222.18	1,822,986.90
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	333.61	467,054.00

LOCKHEED MARTIN CORP	9,976	389.11	3,881,761.36
MASCO CORP	11,689	58.85	687,897.65
NORDSON CORP	2,010	221.29	444,792.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,244	372.23	2,324,204.12
OTIS WORLDWIDE CORP	17,404	80.80	1,406,243.20
OWENS CORNING	4,030	96.81	390,144.30
PACCAR INC	14,054	91.07	1,279,897.78
PARKER HANNIFIN CORP	4,780	296.91	1,419,229.80
PENTAIR PLC	5,098	66.90	341,056.20
PLUG POWER INC	19,000	30.57	580,830.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	60,436	88.72	5,361,881.92
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	281.70	1,212,155.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,030	464.28	1,871,048.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	59.63	385,806.10
SMITH (A.O.) CORP	4,770	68.84	328,366.80
SNAP-ON INC	1,820	235.25	428,155.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,886	202.94	1,194,504.84
SUNRUN INC	4,900	46.15	226,135.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,600	424.81	679,696.00
TEXTRON INC	9,246	67.15	620,868.90
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,766	182.61	1,783,369.26
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	668.91	1,458,223.80
UNITED RENTALS INC	3,050	302.98	924,089.00
WABTEC CORP	8,020	80.63	646,652.60
WW GRAINGER INC	1,607	454.80	730,863.60
XYLEM INC	6,308	117.27	739,739.16
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,570	87.53	487,542.10
CINTAS CORP	3,557	353.26	1,256,545.82
CLARIVATE PLC	12,400	26.32	326,368.00
COPART INC	7,730	125.68	971,506.40
COSTAR GROUP INC	1,685	879.77	1,482,412.45
EQUIFAX INC	5,214	228.85	1,193,223.90
IHS MARKIT LTD	15,333	109.85	1,684,330.05
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,640	138.56	781,478.40
LEIDOS HOLDINGS INC	4,840	106.70	516,428.00

REPUBLIC SERVICES INC	8,130	109.64	891,373.20
ROBERT HALF INTL INC	4,405	90.68	399,445.40
ROLLINS INC	9,015	33.64	303,264.60
TRANSUNION	6,640	106.78	709,019.20
VERISK ANALYTICS INC	6,380	173.27	1,105,462.60
WASTE CONNECTIONS INC	10,626	121.66	1,292,759.16
WASTE MANAGEMENT INC	16,744	140.25	2,348,346.00
AMERCO	375	540.87	202,826.25
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,850	98.71	577,453.50
CSX CORP	30,273	97.29	2,945,260.17
DELTA AIR LINES INC	5,105	45.90	234,319.50
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	124.85	814,895.95
FEDEX CORP	9,928	292.99	2,908,804.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	164.61	539,920.80
KANSAS CITY SOUTHERN	3,860	292.36	1,128,509.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,270	46.44	244,738.80
LYFT INC-A	9,660	58.41	564,240.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,910	271.52	2,690,763.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,815	250.13	954,245.95
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	57.28	313,321.60
UBER TECHNOLOGIES INC	47,080	50.77	2,390,251.60
UNION PACIFIC CORP	26,746	222.62	5,954,194.52
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,387	201.09	5,708,341.83
XPO LOGISTICS INC	3,480	148.45	516,606.00
APTIV PLC	11,260	157.47	1,773,112.20
AUTOLIV INC	2,540	103.85	263,779.00
BORGWARNER INC	9,890	51.97	513,983.30
FORD MOTOR COMPANY	162,795	14.87	2,420,761.65
GENERAL MOTORS CORP	50,475	60.79	3,068,375.25
LEAR CORP	2,710	187.38	507,799.80
TESLA INC	30,500	617.69	18,839,545.00
DR HORTON INC	12,956	87.98	1,139,868.88
GARMIN LTD	5,865	142.68	836,818.20
HASBRO INC	5,298	95.50	505,959.00
LENNAR CORP-CL A	10,480	92.04	964,579.20

LULULEMON ATHLETICA INC	5,140	337.62	1,735,366.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,458	188.24	462,693.92
NEWELL BRANDS INC	16,126	27.34	440,884.84
NIKE INC -CL B	49,848	131.36	6,548,033.28
NVR INC	125	4,671.74	583,967.50
PELOTON INTERACTIVE INC-A	8,740	112.09	979,666.60
PULTE GROUP INC	11,640	53.53	623,089.20
VF CORP	13,620	81.36	1,108,123.20
WHIRLPOOL CORP	2,864	221.10	633,230.40
AIRBNB INC-CLASS A	2,000	149.21	298,420.00
ARAMARK	7,800	37.64	293,592.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,623	2,305.04	3,741,079.92
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,990	106.62	851,893.80
CARNIVAL CORP	28,587	28.75	821,876.25
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,105	1,391.33	1,537,419.65
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	137.50	693,412.50
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	448.16	685,684.80
DRAFTKINGS INC - CL A	6,110	50.62	309,288.20
EXPEDIA GROUP INC	5,912	169.14	999,955.68
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,920	128.61	1,404,421.20
LAS VEGAS SANDS CORP	14,900	54.15	806,835.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	11,353	143.90	1,633,696.70
MCDONALD'S CORP	29,391	236.98	6,965,079.18
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,080	16.75	135,340.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	17,560	42.22	741,383.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	87.95	769,386.60
STARBUCKS CORP	46,594	112.45	5,239,495.30
VAIL RESORTS INC	1,520	322.79	490,640.80
WYNN RESORTS LTD	3,510	124.95	438,574.50
YUM! BRANDS INC	12,264	118.06	1,447,887.84
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,290	99.18	3,004,162.20
ALPHABET INC-CL A	11,885	2,448.91	29,105,295.35
ALPHABET INC-CL C	11,647	2,527.04	29,432,434.88
ALTICE USA INC- A	10,600	34.84	369,304.00
CABLE ONE INC	160	1,810.07	289,611.20

CHARTER COMMUNICATION-A	5,506	690.61	3,802,498.66
COMCAST CORP-CLASS A	180,314	57.28	10,328,385.92
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,790	30.82	178,447.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	28.84	357,904.40
DISH NETWORK CORP-A	9,279	40.03	371,438.37
ELECTRONIC ARTS INC	12,164	148.55	1,806,962.20
FACEBOOK INC-CLASS A	95,040	336.77	32,006,620.80
FOX CORP - CLASS A	14,464	37.68	545,003.52
FOX CORP- CLASS B	5,466	35.96	196,557.36
IAC/INTERACTIVECORP	2,740	153.59	420,836.60
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,566	33.63	422,594.58
LIBERTY BROADBAND-A	760	159.03	120,862.80
LIBERTY BROADBAND-C	6,620	162.00	1,072,440.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	45.86	152,484.50
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,616	45.66	302,086.56
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,970	45.30	315,741.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,060	86.40	523,584.00
MATCH GROUP INC	10,592	143.86	1,523,765.12
NETFLIX INC	17,430	499.89	8,713,082.70
NEWS CORP - CLASS A	18,680	26.31	491,470.80
OMNICOM GROUP	8,337	82.57	688,386.09
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	68.67	1,438,636.50
ROKU INC	4,350	364.86	1,587,141.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.75	318,870.00
SNAP INC - A	37,770	63.57	2,401,038.90
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,020	186.75	937,485.00
THE WALT DISNEY CO.	71,452	178.18	12,731,317.36
TWITTER INC	29,470	60.83	1,792,660.10
VIACOMCBS INC - CLASS B	22,823	42.63	972,944.49
ZILLOW GROUP INC - A	2,710	116.60	315,986.00
ZILLOW GROUP INC - C	5,760	113.58	654,220.80
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,488	198.59	494,091.92
AMAZON.COM INC	16,925	3,383.87	57,271,999.75
AUTOZONE INC	927	1,385.99	1,284,812.73
BEST BUY CO INC	9,554	114.03	1,089,442.62

BURLINGTON STORES INC	2,430	309.88	753,008.40
CARMAX INC	6,249	118.10	738,006.90
CARVANA CO	2,340	278.69	652,134.60
CHEWY INC - CLASS A	3,410	75.07	255,988.70
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,780	209.55	2,049,399.00
DOLLAR TREE INC	9,976	100.20	999,595.20
EBAY INC	27,917	65.89	1,839,451.13
ETSY INC	4,980	170.30	848,094.00
GENUINE PARTS CO	5,611	127.61	716,019.71
HOME DEPOT INC	42,540	309.32	13,158,472.80
L BRANDS INC	9,030	65.74	593,632.20
LKQ CORP	10,810	48.69	526,338.90
LOWE'S COS INC	29,072	189.66	5,513,795.52
MERCADOLIBRE INC	1,765	1,432.63	2,528,591.95
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,835	532.42	1,509,410.70
POOL CORP	1,810	430.96	780,037.60
ROSS STORES INC	14,412	119.22	1,718,198.64
TARGET CORP	19,860	233.07	4,628,770.20
TJX COMPANIES INC	47,166	65.13	3,071,921.58
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,840	183.15	886,446.00
ULTA BEAUTY INC	2,180	336.79	734,202.20
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	317.44	901,529.60
COSTCO WHOLESALE CORP	17,404	383.76	6,678,959.04
KROGER CO	31,870	38.40	1,223,808.00
SYSCO CORP	19,886	79.40	1,578,948.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28,602	54.43	1,556,806.86
WALMART INC	62,112	140.56	8,730,462.72
ALTRIA GROUP INC	73,128	48.08	3,515,994.24
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,383	65.22	1,394,599.26
BOSTON BEER COMPANY INC-A	340	1,021.88	347,439.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	75.71	884,292.80
BUNGE LTD	5,457	82.62	450,857.34
CAMPBELL SOUP CO	5,385	45.82	246,740.70
COCA-COLA CO/THE	161,172	55.55	8,953,104.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	61.75	510,055.00

CONAGRA BRANDS INC	19,470	37.47	729,540.90
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,110	236.37	1,680,590.70
GENERAL MILLS INC	22,559	62.65	1,413,321.35
HERSHEY CO/THE	5,715	174.67	998,239.05
HORMEL FOODS CORP	11,500	48.91	562,465.00
JM SMUCKER CO/THE	4,760	136.10	647,836.00
KELLOGG CO	10,528	65.39	688,425.92
KEURIG DR PEPPER INC	23,950	34.85	834,657.50
KRAFT HEINZ CO/THE	28,661	42.82	1,227,264.02
LAMB WESTON HOLDING INC	5,990	83.43	499,745.70
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,410	89.20	928,572.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,330	59.76	497,800.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	56,655	63.79	3,614,022.45
MONSTER BEVERAGE CORP	16,150	93.40	1,508,410.00
PEPSICO INC	54,541	148.57	8,103,156.37
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	61,408	100.50	6,171,504.00
TYSON FOODS INC-CL A	12,276	77.35	949,548.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,680	84.54	818,347.20
CLOROX COMPANY	4,456	174.23	776,368.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	31,260	83.41	2,607,396.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,890	303.22	2,695,625.80
KIMBERLY-CLARK CORP	13,773	129.52	1,783,878.96
PROCTER & GAMBLE CO	97,969	134.91	13,216,997.79
ABBOTT LABORATORIES	69,876	110.48	7,719,900.48
ABIOMED INC	1,910	302.87	578,481.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,110	605.77	1,883,944.70
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	118.73	685,547.02
ANTHEM INC	9,786	383.51	3,753,028.86
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,619	82.77	1,623,864.63
BECTON DICKINSON AND CO	11,477	242.72	2,785,697.44
BOSTON SCIENTIFIC CORP	56,968	42.54	2,423,418.72
CARDINAL HEALTH INC	11,355	58.33	662,337.15
CENTENE CORP	22,967	68.78	1,579,670.26
CERNER CORP	11,120	80.69	897,272.80
CIGNA CORP	14,220	239.59	3,406,969.80

COOPER COS INC/THE	2,190	376.54	824,622.60
CVS HEALTH CORP	51,888	84.62	4,390,762.56
DANAHER CORP	25,209	247.41	6,236,958.69
DAVITA INC	3,068	121.56	372,946.08
DENTSPLY SIRONA INC	9,332	64.67	603,500.44
DEXCOM INC	3,710	409.09	1,517,723.90
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,880	100.96	2,511,884.80
HCA HEALTHCARE INC	10,675	207.86	2,218,905.50
HENRY SCHEIN INC	5,040	77.43	390,247.20
HOLOGIC INC	10,298	63.39	652,790.22
HUMANA INC	5,375	415.12	2,231,270.00
IDEXX LABORATORIES INC	3,530	592.36	2,091,030.80
INSULET CORP	2,710	283.95	769,504.50
INTUITIVE SURGICAL INC	4,660	872.79	4,067,201.40
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,225	259.83	1,097,781.75
MASIMO CORP	2,020	225.43	455,368.60
MCKESSON CORP	6,604	192.91	1,273,977.64
MEDTRONIC PLC	53,308	124.15	6,618,188.20
MOLINA HEALTHCARE INC	2,550	243.61	621,205.50
NOVOCURE LTD	3,430	219.92	754,325.60
OAK STREET HEALTH INC	3,420	57.20	195,624.00
QUEST DIAGNOSTICS	5,246	128.04	671,697.84
RESMED INC	6,150	231.70	1,424,955.00
STERIS PLC	3,400	198.37	674,458.00
STRYKER CORP	13,303	255.69	3,401,444.07
TELADOC HEALTH INC	4,960	157.48	781,100.80
TELEFLEX INC	1,760	395.70	696,432.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,490	399.16	14,964,508.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	156.37	472,237.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,550	303.90	1,686,645.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,920	345.14	1,007,808.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,472	157.55	1,334,763.60
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,770	191.17	529,540.90
ABBVIE INC	69,686	115.40	8,041,764.40
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,410	144.39	1,647,489.90

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,200	181.65	1,489,530.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,740	166.66	789,968.40
AMGEN INC	23,111	241.19	5,574,142.09
AVANTOR INC	22,000	33.34	733,480.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	960	606.67	582,403.20
BIO-TECHNE CORP	1,480	449.37	665,067.60
BIOGEN INC	5,743	406.14	2,332,462.02
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,570	82.48	624,373.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	89,725	67.29	6,037,595.25
CATALENT INC	6,520	109.58	714,461.60
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	355.33	678,680.30
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	33.48	553,290.48
ELI LILLY & CO	32,274	226.10	7,297,151.40
EXACT SCIENCES CORP	6,990	125.01	873,819.90
GILEAD SCIENCES INC	49,304	68.15	3,360,067.60
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,820	92.56	723,819.20
ILLUMINA INC	5,760	452.14	2,604,326.40
INCYTE CORP	6,670	82.64	551,208.80
IQVIA HOLDINGS INC	7,193	244.47	1,758,472.71
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	186.42	415,716.60
JOHNSON & JOHNSON	104,051	165.37	17,206,913.87
MERCK & CO. INC.	99,833	75.45	7,532,399.85
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	930	1,351.84	1,257,211.20
MODERNA INC	12,370	207.41	2,565,661.70
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,230	99.62	421,392.60
NOVAVAX INC	2,600	207.71	540,046.00
PERKINELMER INC	4,790	147.15	704,848.50
PFIZER INC	219,420	39.63	8,695,614.60
PPD INC	5,510	46.53	256,380.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,035	528.75	2,133,506.25
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,460	44.62	288,245.20
SEAGEN INC	5,140	156.29	803,330.60
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	48,910	11.05	540,455.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,709	470.07	7,384,329.63
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,440	194.80	2,033,712.00

VIATRIS INC	48,469	15.63	757,570.47
WATERS CORP	2,336	336.18	785,316.48
ZOETIS INC	18,690	184.58	3,449,800.20
BANK OF AMERICA CORP	307,469	41.36	12,716,917.84
CITIGROUP INC	82,077	75.16	6,168,907.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,580	47.10	733,818.00
FIFTH THIRD BANCORP	27,119	39.54	1,072,285.26
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,410	186.18	1,193,413.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	51,960	14.37	746,665.20
JPMORGAN CHASE & CO	120,290	157.57	18,954,095.30
KEYCORP	41,558	21.53	894,743.74
M & T BANK CORP	5,643	152.56	860,896.08
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,770	187.11	3,137,834.70
REGIONS FINANCIAL CORP	41,044	21.18	869,311.92
SVB FINANCIAL GROUP	1,885	545.74	1,028,719.90
TRUIST FINANCIAL CORP	53,300	56.69	3,021,577.00
US BANCORP	54,271	58.16	3,156,401.36
WELLS FARGO & CO	163,900	45.15	7,400,085.00
ALLY FINANCIAL INC	14,000	53.41	747,740.00
AMERICAN EXPRESS CO	27,134	163.81	4,444,820.54
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,960	254.62	1,262,915.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,220	57.51	415,222.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,912	49.64	1,633,751.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	54,170	283.53	15,358,820.10
BLACKROCK INC	6,050	876.78	5,304,519.00
BLACKSTONE GROUP INC/THE -A	27,290	95.61	2,609,196.90
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,965	158.71	2,851,225.15
CARLYLE GROUP INC/THE	4,270	43.53	185,873.10
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	114.76	452,154.40
CME GROUP INC	14,200	216.70	3,077,140.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,290	120.69	1,362,590.10
EQUITABLE HOLDINGS INC	17,100	31.16	532,836.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	328.00	524,800.00
FRANKLIN RESOURCES INC	12,475	33.92	423,152.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	155.02	279,036.00

GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,598	372.92	5,070,966.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,100	113.84	2,515,864.00
INVESCO LTD	15,567	28.77	447,862.59
KKR & CO INC -A	19,150	55.29	1,058,803.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	454.71	645,688.20
MOODY'S CORP	6,837	347.76	2,377,635.12
MORGAN STANLEY	55,713	90.72	5,054,283.36
MSCI INC	3,170	490.76	1,555,709.20
NASDAQ INC	4,835	175.16	846,898.60
NORTHERN TRUST CORP	7,980	116.47	929,430.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,360	129.01	691,493.60
S&P GLOBAL INC	9,467	396.37	3,752,434.79
SCHWAB (CHARLES) CORP	57,243	72.01	4,122,068.43
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	62.35	287,121.75
STATE STREET CORP	13,027	84.79	1,104,559.33
SYNCHRONY FINANCIAL	21,570	48.64	1,049,164.80
T ROWE PRICE GROUP INC	9,375	192.63	1,805,906.25
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	84.42	368,071.20
VOYA FINANCIAL INC	5,580	63.47	354,162.60
AFLAC INC	25,764	55.43	1,428,098.52
ALLEGHANY CORP	500	698.71	349,355.00
ALLSTATE CORP	11,633	130.98	1,523,690.34
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	123.79	358,991.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,925	51.10	1,682,467.50
AON PLC	9,072	250.06	2,268,544.32
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,825	39.14	658,530.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,150	144.46	1,177,349.00
ASSURANT INC	2,300	160.83	369,909.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	3,810	62.81	239,306.10
BROWN & BROWN INC	10,380	52.12	541,005.60
CHUBB LTD	17,875	166.46	2,975,472.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,230	120.48	750,590.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	191.42	227,789.80
EVEREST RE GROUP LTD	1,384	254.03	351,577.52
FNF GROUP	11,561	46.93	542,557.73

GLOBE LIFE INC	3,246	102.97	334,240.62
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,812	64.71	829,064.52
LINCOLN NATIONAL CORP	8,243	66.26	546,181.18
LOEWS CORP	10,835	55.82	604,809.70
MARKEL CORP	525	1,203.87	632,031.75
MARSH & MCLENNAN COS	19,933	139.63	2,783,244.79
METLIFE INC	31,055	63.31	1,966,092.05
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,890	64.24	699,573.60
PROGRESSIVE CORP	22,300	93.12	2,076,576.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,742	104.42	1,539,359.64
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,740	123.15	337,431.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,437	150.03	365,623.11
TRAVELERS COS INC/THE	10,524	153.25	1,612,803.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,228	256.12	1,338,995.36
WR BERKLEY CORP	5,394	75.44	406,923.36
CBRE GROUP INC - A	12,560	87.70	1,101,512.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.93	242,556.00
ACCENTURE PLC-CL A	24,998	285.71	7,142,178.58
ADOBE INC	18,934	556.95	10,545,291.30
AKAMAII TECHNOLOGIES INC	6,350	118.00	749,300.00
ANSYS INC	3,480	338.50	1,177,980.00
AUTODESK INC	8,570	280.52	2,404,056.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,981	199.17	3,382,105.77
AVALARA INC	3,040	140.13	425,995.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,340	63.43	402,146.20
BLACK KNIGHT INC	6,530	74.16	484,264.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,630	160.96	745,244.80
CADENCE DESIGN SYS INC	10,510	130.96	1,376,389.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,990	89.13	533,888.70
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,320	120.97	522,590.40
CITRIX SYSTEMS INC	5,028	120.66	606,678.48
CLOUDFLARE INC-CLASS A	8,190	95.64	783,291.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,008	70.79	1,416,366.32
COUPA SOFTWARE INC	2,450	239.11	585,819.50
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,170	233.53	1,674,410.10

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,400	139.70	195,580.00
DATADOG INC-CLASS A	7,240	97.25	704,090.00
DOCUSIGN INC	7,340	257.26	1,888,288.40
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	29.52	316,159.20
DYNATRACE INC	6,630	56.16	372,340.80
EPAM SYSTEMS INC	2,350	508.21	1,194,293.50
FAIR ISAAC CORP	1,055	505.60	533,408.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,418	146.50	3,577,237.00
FISERV INC	23,614	109.11	2,576,523.54
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,040	270.05	820,952.00
FORTINET INC	5,470	231.46	1,266,086.20
GARTNER INC	3,790	229.62	870,259.80
GLOBAL PAYMENTS INC	11,719	192.21	2,252,508.99
GODADDY INC-CLASS A	7,040	85.40	601,216.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	113.29	325,142.30
HUBSPOT INC	1,540	537.26	827,380.40
INTL BUSINESS MACHINES CORP	35,342	150.03	5,302,360.26
INTUIT INC	10,416	476.97	4,968,119.52
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	163.33	463,857.20
MASTERCARD INC	35,145	366.52	12,881,345.40
MICROSOFT CORP	283,004	259.89	73,549,909.56
MONGODB INC	2,200	346.67	762,674.00
NORTONLIFELOCK INC	19,775	28.45	562,598.75
OKTA INC	4,990	227.79	1,136,672.10
ORACLE CORP	77,673	82.62	6,417,343.26
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	19,600	25.00	490,000.00
PALO ALTO NETWORKS INC	4,060	367.55	1,492,253.00
PAYCHEX INC	13,232	104.49	1,382,611.68
PAYCOM SOFTWARE INC	1,805	341.02	615,541.10
PAYPAL HOLDINGS INC	43,957	274.93	12,085,098.01
PTC INC	4,690	137.66	645,625.40
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,220	274.80	884,856.00
SALESFORCE.COM INC	35,915	246.26	8,844,427.90
SERVICENOW INC	7,735	509.34	3,939,744.90
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	17,030	44.89	764,476.70

SNOWFLAKE INC-CLASS A	780	244.20	190,476.00
SPLUNK INC	6,820	122.39	834,699.80
SQUARE INC - A	15,090	230.95	3,485,035.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,910	73.99	585,260.90
SYNOPSYS INC	6,377	266.49	1,699,406.73
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,715	601.56	1,031,675.40
TWILIO INC - A	5,710	343.07	1,958,929.70
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,540	437.05	673,057.00
UNITY SOFTWARE INC	1,950	102.30	199,485.00
VERISIGN INC	3,900	220.17	858,663.00
VISA INC-CLASS A SHARES	66,622	234.08	15,594,877.76
VMWARE INC	2,965	160.57	476,090.05
WESTERN UNION CO	14,561	24.75	360,384.75
WIX.COM LTD	2,280	284.93	649,640.40
WORKDAY INC-CLASS A	7,460	232.28	1,732,808.80
ZENDESK INC	5,210	141.02	734,714.20
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,770	365.91	2,843,120.70
ZSCALER INC	2,820	211.43	596,232.60
AMPHENOL CORP-CL A	24,860	68.31	1,698,186.60
APPLE INC	663,068	130.48	86,517,112.64
ARISTA NETWORKS INC	2,180	364.90	795,482.00
ARROW ELECTRONICS INC	2,750	119.40	328,350.00
CDW CORP/DE	5,590	169.30	946,387.00
CISCO SYSTEMS INC	166,800	54.17	9,035,556.00
COGNEX CORP	7,570	80.14	606,659.80
CORNING INC	28,088	41.46	1,164,528.48
DELL TECHNOLOGIES -C	8,802	102.74	904,317.48
F5 NETWORKS INC	2,385	191.73	457,276.05
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,655	15.72	796,296.60
HP INC	54,625	29.39	1,605,428.75
IPG PHOTONICS CORP	1,840	206.85	380,604.00
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	28.51	361,022.13
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,760	148.58	1,152,980.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,675	211.40	1,411,095.00
NETAPP INC	7,606	82.99	631,221.94

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,694	94.66	917,634.04
TE CONNECTIVITY LTD	12,555	137.10	1,721,290.50
TRIMBLE INC	11,140	78.79	877,720.60
WESTERN DIGITAL CORP	12,428	74.71	928,495.88
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,280	509.92	1,162,617.60
AT&T INC	281,327	29.09	8,183,802.43
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,285	27.76	146,711.60
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	17,221	27.83	479,260.43
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	14.85	510,632.10
T-MOBILE US INC	24,739	145.26	3,593,587.14
VERIZON COMMUNICATIONS INC	163,387	57.18	9,342,468.66
AES CORP	27,718	25.74	713,461.32
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	58.57	483,788.20
AMEREN CORPORATION	10,942	85.84	939,261.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,468	85.13	1,742,440.84
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	160.48	1,076,018.40
ATMOS ENERGY CORP	4,880	101.10	493,368.00
CENTERPOINT ENERGY INC	24,962	25.98	648,512.76
CMS ENERGY CORP	12,240	60.30	738,072.00
CONSOLIDATED EDISON INC	11,936	77.75	928,024.00
DOMINION ENERGY INC	31,511	78.27	2,466,365.97
DTE ENERGY COMPANY	8,018	138.38	1,109,530.84
DUKE ENERGY CORP	29,126	102.53	2,986,288.78
EDISON INTERNATIONAL	14,869	58.68	872,512.92
ENERGY CORP	7,127	108.90	776,130.30
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	48.66	447,185.40
EVERGY INC	8,720	63.92	557,382.40
EVERSOURCE ENERGY	14,360	82.55	1,185,418.00
EXELON CORP	39,166	47.11	1,845,110.26
FIRSTENERGY CORP	22,345	38.79	866,762.55
NEXTERA ENERGY INC	77,780	73.31	5,702,051.80
NISOURCE INC	15,050	26.03	391,751.50
NRG ENERGY INC	10,000	37.08	370,800.00
P G & E CORP	60,460	10.65	643,899.00
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	88.08	390,106.32

	PPL CORP	29,828	29.26	872,767.28	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,608	61.84	1,336,238.72	
	SEMPRA ENERGY	11,567	143.25	1,656,972.75	
	SOUTHERN CO	41,855	63.79	2,669,930.45	
	UGI CORP	7,720	47.05	363,226.00	
	VISTRA CORP	20,980	18.39	385,822.20	
	WEC ENERGY GROUP INC	12,040	92.69	1,115,987.60	
	XCEL ENERGY INC	20,004	69.08	1,381,876.32	
	ADVANCED MICRO DEVICES	47,680	81.55	3,888,304.00	
	ANALOG DEVICES INC	15,100	168.44	2,543,444.00	
	APPLIED MATERIALS INC	36,243	139.03	5,038,864.29	
	BROADCOM INC	15,955	475.83	7,591,867.65	
	ENPHASE ENERGY INC	4,930	147.65	727,914.50	
	INTEL CORP	161,782	58.19	9,414,094.58	
	KLA CORP	6,039	325.21	1,963,943.19	
	LAM RESEARCH CORP	5,662	650.24	3,681,658.88	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	30,984	53.80	1,666,939.20	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,440	104.13	1,191,247.20	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,684	155.76	1,508,379.84	
	MICRON TECHNOLOGY INC	44,127	80.49	3,551,782.23	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,930	351.79	678,954.70	
	NVIDIA CORP	24,365	720.75	17,561,073.75	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,967	203.57	2,232,552.19	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	14,160	38.32	542,611.20	
	QORVO INC	4,930	184.94	911,754.20	
	QUALCOMM INC	44,592	137.31	6,122,927.52	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,180	173.83	1,248,099.40	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	1,890	242.87	459,024.30	
	TERADYNE INC	6,540	131.48	859,879.20	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	36,422	190.26	6,929,649.72	
	XILINX INC	9,455	128.33	1,213,360.15	
米ドル小計		12,483,846		1,483,231,283.63	(163,318,596,640)
加ドル	CAMECO CORP	14,272	23.41	334,107.52	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	48,154	45.53	2,192,451.62	

CENOVUS ENERGY INC	55,183	12.17	671,577.11
ENBRIDGE INC	80,167	49.43	3,962,654.81
IMPERIAL OIL LTD	9,622	40.99	394,405.78
INTER PIPELINE LTD	14,620	20.15	294,593.00
KEYERA CORP	8,460	34.79	294,323.40
PARKLAND CORP	7,370	39.95	294,431.50
PEMBINA PIPELINE CORP	24,572	40.46	994,183.12
SUNCOR ENERGY INC	62,819	30.63	1,924,145.97
TC ENERGY CORP	38,733	64.16	2,485,109.28
AGNICO EAGLE MINES LTD	9,775	86.15	842,116.25
B2GOLD CORP	42,000	5.95	249,900.00
BARRICK GOLD CORP	71,794	28.11	2,018,129.34
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	68.79	395,542.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,200	28.05	538,560.00
FRANCO-NEVADA CORP	8,145	184.78	1,505,033.10
IVANHOE MINES LTD-CL A	21,000	8.77	184,170.00
KINROSS GOLD CORP	46,025	9.42	433,555.50
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	10,600	52.20	553,320.00
LUNDIN MINING CORP	21,150	12.75	269,662.50
NUTRIEN LTD	21,068	77.41	1,630,873.88
PAN AMERICAN SILVER CORP	8,780	38.18	335,220.40
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	27.99	503,120.25
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,100	85.68	351,288.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18,535	58.05	1,075,956.75
YAMANA GOLD INC	32,800	6.15	201,720.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	8,330	21.66	180,427.80
CAE INC	10,265	38.47	394,894.55
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,710	107.51	398,862.10
WSP GLOBAL INC	4,030	140.79	567,383.70
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	8,510	40.20	342,102.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	72.31	292,132.40
THOMSON REUTERS CORP	6,076	119.53	726,264.28
AIR CANADA	7,190	28.34	203,764.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,908	134.77	3,761,161.16
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,325	97.90	2,479,317.50

MAGNA INTERNATIONAL INC	11,858	117.23	1,390,113.34
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,420	43.02	276,188.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,318	82.60	1,017,466.80
QUEBECOR INC -CL B	6,110	32.38	197,841.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	36.13	631,010.45
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	202.73	399,378.10
DOLLARAMA INC	11,780	55.42	652,847.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	33,950	45.29	1,537,595.50
EMPIRE CO LTD 'A'	8,290	42.09	348,926.10
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	75.99	418,628.91
METRO INC	11,140	58.45	651,133.00
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	119.09	399,904.22
SAPUTO INC	9,620	36.70	353,054.00
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	38.26	485,289.84
CANOPY GROWTH CORP	9,140	30.46	278,404.40
BANK OF MONTREAL	25,871	126.50	3,272,681.50
BANK OF NOVA SCOTIA	47,949	80.84	3,876,197.16
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	17,915	144.38	2,586,567.70
NATIONAL BANK OF CANADA	12,060	91.21	1,099,992.60
ROYAL BANK OF CANADA	56,449	126.41	7,135,718.09
TORONTO-DOMINION BANK	71,940	86.93	6,253,744.20
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	51,319	60.21	3,089,916.99
IGM FINANCIAL INC	3,335	44.69	149,041.15
ONEX CORPORATION	2,765	85.66	236,849.90
TMX GROUP LTD	1,810	131.34	237,725.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,110	555.76	616,893.60
GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	36.28	323,037.12
IA FINANCIAL CORP INC	3,895	68.26	265,872.70
INTACT FINANCIAL CORP	5,965	167.67	1,000,151.55
MANULIFE FINANCIAL CORP	79,501	24.59	1,954,929.59
POWER CORP OF CANADA	23,289	39.50	919,915.50
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,214	63.52	1,474,553.28
FIRSTSERVICE CORP	1,770	208.47	368,991.90
BLACKBERRY LTD	22,208	17.07	379,090.56
CGI INC	8,930	110.50	986,765.00

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	780	1,809.40	1,411,332.00
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	3,440	92.26	317,374.40
	OPEN TEXT CORP	10,940	60.60	662,964.00
	SHOPIFY INC - CLASS-A	4,355	1,585.83	6,906,289.65
	BCE INC	5,900	60.77	358,543.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,575	62.56	974,372.00
	TELUS CORP	12,662	27.64	349,977.68
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	19.66	532,392.80
	ALTAGAS LTD	9,000	25.23	227,070.00
	ATCO LTD -CLASS I	2,300	45.62	104,926.00
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	52.00	283,140.00
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.94	163,886.40
	EMERA INC	12,030	57.42	690,762.60
	FORTIS INC	19,615	56.67	1,111,582.05
	HYDRO ONE LTD	11,790	30.81	363,249.90
	NORTHLAND POWER INC	8,600	41.85	359,910.00
加ドル小計		1,613,936		94,360,652.10 (8,556,623,932)
ユーロ	ENI SPA	107,926	10.72	1,157,830.12
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	9.87	210,309.42
	NESTE OYJ	15,770	55.40	873,658.00
	OMV AG	6,480	50.74	328,795.20
	REPSOL SA	57,649	11.47	661,349.32
	TENARIS SA	19,915	9.74	194,051.76
	TOTALENERGIES SE	99,977	40.88	4,087,559.64
	VOPAK	2,510	39.85	100,023.50
	AIR LIQUIDE SA	18,750	140.86	2,641,125.00
	AKZO NOBEL	6,827	106.45	726,734.15
	ARCELORMITTAL	28,822	26.92	776,032.35
	ARKEMA	3,045	108.40	330,078.00
	BASF SE	36,345	67.24	2,443,837.80
	COVESTRO AG	7,410	53.62	397,324.20
	CRH PLC	29,850	42.75	1,276,087.50
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,540	28.32	241,852.80
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	42.90	124,410.00

HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	74.68	426,796.20
KONINKLIJKE DSM NV	6,552	151.90	995,248.80
LANXESS AG	3,115	60.70	189,080.50
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,740	46.32	358,516.80
SOLVAY SA	3,231	112.30	362,841.30
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,305	15.08	291,215.92
SYMRISE AG	5,370	112.40	603,588.00
UMICORE	8,880	49.50	439,560.00
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	32.50	635,960.00
VOESTALPINE AG	4,249	36.24	153,983.76
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	25.57	268,127.02
AIRBUS GROUP SE	23,468	112.40	2,637,803.20
ALSTOM	11,635	45.46	528,927.10
BOUYGUES SA	9,460	33.49	316,815.40
BRENTAG SE	6,735	76.14	512,802.90
CNH INDUSTRIAL NV	46,280	14.29	661,341.20
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	20,756	56.74	1,177,695.44
DASSAULT AVIATION SA	90	1,024.00	92,160.00
EIFFAGE	3,250	90.94	295,555.00
FERROVIAL SA	18,485	25.34	468,409.90
GEA GROUP AG	6,680	34.00	227,120.00
KINGSPAN GROUP PLC	6,260	78.48	491,284.80
KION GROUP AG	2,284	89.78	205,057.52
KNORR-BREMSE AG	2,970	102.65	304,870.50
KONE OYJ-B	14,244	67.58	962,609.52
LEGRAND SA	11,278	88.00	992,464.00
MTU AERO ENGINES AG	2,020	208.00	420,160.00
PRYSMIAN SPA	9,565	29.26	279,871.90
RATIONAL AG	230	705.40	162,242.00
SAFRAN SA	12,810	123.10	1,576,911.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,188	130.10	2,756,558.80
SIEMENS AG-REG	30,356	135.74	4,120,523.44
SIEMENS ENERGY AG	15,843	25.43	402,887.49
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,760	25.93	304,936.80
THALES SA	3,745	86.10	322,444.50

VINCI SA	20,040	96.01	1,924,040.40
WARTSILA OYJ ABP	21,180	12.18	257,972.40
BUREAU VERITAS SA	14,440	26.14	377,461.60
RANDSTAD NV	4,965	64.60	320,739.00
TELEPERFORMANCE	2,120	321.00	680,520.00
WOLTERS KLUWER	10,377	80.96	840,121.92
ADP	1,090	126.60	137,994.00
AENA SA	2,870	143.10	410,697.00
ATLANTIA SPA	18,740	15.73	294,873.90
DEUTCHE LUFTHANSA	11,940	10.68	127,519.20
DEUTSCHE POST AG-REG	37,733	56.90	2,147,007.70
GETLINK	14,730	13.00	191,490.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,235	94.79	1,254,545.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	79.65	136,998.00
CONTINENTAL AG	4,385	128.72	564,437.20
DAIMLER AG	33,872	78.92	2,673,178.24
FAURECIA	4,256	45.50	193,648.00
FERRARI NV	5,214	168.25	877,255.50
MICHELIN (CGDE)-B	6,669	129.10	860,967.90
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	97.20	551,124.00
RENAULT SA	6,837	36.83	251,840.89
STELLANTIS NV	86,706	16.96	1,471,227.40
VALEO SA	8,060	28.22	227,453.20
VOLKSWAGEN AG	1,441	296.80	427,688.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,183	230.10	1,652,808.30
ADIDAS AG	7,521	293.00	2,203,653.00
ESSILORLUXOTTICA	10,675	148.50	1,585,237.50
HERMES INTERNATIONAL	1,207	1,196.00	1,443,572.00
KERING	2,957	744.00	2,200,008.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,959	672.60	7,371,023.40
MONCLER SPA	8,860	57.12	506,083.20
PUMA SE	4,530	93.26	422,467.80
SEB SA	847	153.70	130,183.90
ACCOR SA	7,646	34.68	265,163.28
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,946	159.70	1,109,276.20

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	49.30	192,270.00
SODEXO	4,090	81.24	332,271.60
BOLLORE	33,530	4.38	147,129.64
PUBLICIS GROUPE	8,645	56.48	488,269.60
SCOUT24 AG	3,880	67.00	259,960.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	59.84	210,038.40
VIVENDI	32,720	29.19	955,096.80
DELIVERY HERO SE	5,680	111.15	631,332.00
HELLOFRESH SE	6,070	83.78	508,544.60
INDITEX	45,445	31.79	1,444,696.55
JUST EAT TAKEAWAY	6,520	73.89	481,762.80
PROSUS	19,170	85.29	1,635,009.30
ZALANDO SE	6,260	95.46	597,579.60
CARREFOUR SA	27,693	17.19	476,181.13
COLRUYT SA	2,305	51.86	119,537.30
JERONIMO MARTINS	9,035	15.88	143,475.80
KESKO OYJ-B SHS	12,330	29.94	369,160.20
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,718	24.79	1,158,372.81
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	30,801	64.61	1,990,052.61
DANONE	24,474	59.48	1,455,713.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,980	11.14	256,112.10
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	83.45	335,886.25
HEINEKEN NV	11,053	98.22	1,085,625.66
JDE PEET'S NV	2,400	31.50	75,600.00
KERRY GROUP PLC-A	7,010	106.40	745,864.00
PERNOD-RICARD SA	8,606	177.35	1,526,274.10
REMY COINTREAU	810	165.90	134,379.00
BEIERSDORF AG	3,805	100.30	381,641.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	80.30	360,547.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	92.88	595,639.44
L'OREAL	9,926	384.55	3,817,043.30
AMPLIFON SPA	5,620	40.85	229,577.00
BIOMERIEUX	1,310	91.88	120,362.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,900	154.15	292,885.00
DIASORIN SPA	930	150.75	140,197.50

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,343	68.98	644,480.14
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,955	45.16	810,847.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,020	44.45	1,601,089.00
ORPEA	1,790	108.00	193,320.00
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,080	414.60	447,768.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	48.72	547,125.60
ARGENX SE	1,840	263.40	484,656.00
BAYER AG-REG	39,234	53.21	2,087,641.14
EUROFINS SCIENTIFIC	5,950	87.13	518,423.50
GRIFOLS SA	9,910	23.54	233,281.40
IPSEN	1,350	91.22	123,147.00
MERCK KGAA	5,130	154.15	790,789.50
ORION OYJ-CLASS B	5,150	37.93	195,339.50
QIAGEN N.V.	9,614	39.23	377,157.22
RECORDATI SPA	3,920	47.71	187,023.20
SANOFI	44,956	88.89	3,996,138.84
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,160	384.60	446,136.00
UCB SA	4,928	83.44	411,192.32
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,360	10.71	143,192.48
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,873	5.34	1,393,844.43
BANCO SANTANDER SA	700,449	3.43	2,407,793.43
BNP PARIBAS	44,502	56.45	2,512,137.90
CAIXABANK S.A	163,050	2.80	457,192.20
COMMERZBANK AG	48,544	6.43	312,137.92
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	12.45	507,563.83
ERSTE GROUP BANK AG	12,928	33.71	435,802.88
FINECOBANK SPA	26,120	13.92	363,721.00
ING GROEP NV-CVA	156,335	11.21	1,752,515.35
INTESA SANPAOLO	677,293	2.45	1,659,367.85
KBC GROEP NV	10,209	68.02	694,416.18
MEDIOBANCA SPA	20,050	9.96	199,698.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,370	20.66	110,944.20
SOCIETE GENERALE	34,339	26.38	905,862.82
UNICREDIT SPA	83,846	10.74	900,506.04
AMUNDI SA	2,140	74.95	160,393.00

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	72,445	11.56	838,043.76
DEUTSCHE BOERSE AG	7,800	137.50	1,072,500.00
EURAZEO SE	1,877	73.60	138,147.20
EXOR NV	3,424	69.62	238,378.88
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	94.28	382,965.36
NATIXIS	34,540	4.00	138,229.08
SOFINA	480	352.00	168,960.00
WENDEL	1,000	116.70	116,700.00
AEGON NV	77,949	3.74	291,919.00
AGEAS	6,794	49.36	335,351.84
ALLIANZ SE-REG	16,348	216.65	3,541,794.20
ASSICURAZIONI GENERALI	38,748	17.15	664,528.20
AXA SA	74,212	22.47	1,667,914.70
CNP ASSURANCES	6,040	14.56	87,972.60
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	142.60	324,415.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,566	233.90	1,301,887.40
NN GROUP NV	9,940	40.54	402,967.60
POSTE ITALIANE SPA	19,560	12.01	235,013.40
SAMPO OYJ-A SHS	18,189	38.86	706,824.54
SCOR SE	7,452	27.98	208,506.96
AROUNDTOWN SA	33,520	7.07	237,120.48
DEUTSCHE WOHNEN SE	13,630	51.76	705,488.80
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	120.75	298,252.50
VONOVIA SE	22,148	53.64	1,188,018.72
ADYEN NV	750	1,931.60	1,448,700.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	65.50	1,119,395.00
ATOS SE	3,890	54.42	211,693.80
BECHTLE AG	1,230	156.20	192,126.00
CAP GEMINI SA	5,849	158.50	927,066.50
DASSAULT SYSTEMES SA	5,470	194.45	1,063,641.50
EDENRED	9,626	50.18	483,032.68
NEMETSCHKE SE	1,790	61.90	110,801.00
NEXI SPA	20,200	17.49	353,399.00
SAP SE	41,452	119.92	4,970,923.84
TEAMVIEWER AG	7,050	32.39	228,349.50

WORLDLINE SA	8,390	78.97	662,558.30
NOKIA OYJ	215,766	4.52	977,204.21
CELLNEX TELECOM SA	16,760	52.20	874,872.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	129,336	17.78	2,300,628.76
ELISA OYJ	5,465	50.52	276,091.80
ILIAD SA	566	134.95	76,381.70
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.65	146,451.18
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	2.67	352,177.65
ORANGE S.A.	85,484	10.45	893,307.80
PROXIMUS	5,600	17.37	97,272.00
TELECOM ITALIA SPA	317,713	0.45	142,970.85
TELECOM ITALIA-RSP	198,057	0.49	98,216.46
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.26	73,577.02
TELEFONICA SA	179,339	4.11	737,441.96
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	34.56	138,240.00
E.ON SE	86,389	10.16	878,403.35
EDF	26,405	11.98	316,463.92
EDP RENOVAVEIS SA	10,400	19.40	201,760.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	121,971	4.59	560,944.62
ELIA GROUP SA/NV	960	93.50	89,760.00
ENAGAS SA	8,240	19.75	162,740.00
ENDESA SA	10,710	22.29	238,725.90
ENEL SPA	322,037	8.10	2,609,143.77
ENGIE	76,034	12.30	935,826.47
FORTUM OYJ	16,415	24.28	398,556.20
IBERDROLA SA	240,612	10.82	2,603,421.84
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,072	21.86	198,313.92
RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	17.09	328,469.80
RWE AG	26,575	31.09	826,216.75
SNAM SPA	79,380	5.04	400,075.20
SUEZ	13,289	20.07	266,710.23
TERNA SPA	49,057	6.54	321,225.23
UNIPER SE	7,030	30.69	215,750.70
VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,664	26.15	540,363.60
VERBUND AG	2,780	76.45	212,531.00

	ASM INTERNATIONAL NV	1,840	271.40	499,376.00	
	ASML HOLDING NV	16,782	577.70	9,694,961.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	53,695	34.21	1,837,174.42	
	STMICROELECTRONICS NV	23,633	31.56	745,975.64	
ユーロ小計		7,385,777		189,645,753.22	(25,308,225,767)
英債券	BP PLC	797,388	3.30	2,634,569.95	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	162,338	14.58	2,367,537.39	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	144,199	13.93	2,009,557.26	
	ANGLO AMERICAN PLC	50,684	31.12	1,577,539.50	
	ANTOFAGASTA PLC	12,060	15.32	184,759.20	
	BHP GROUP PLC	83,911	21.52	1,805,764.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	71.16	392,874.36	
	EVRAZ PLC	21,700	6.33	137,491.20	
	GLENCORE PLC	396,813	3.27	1,300,157.79	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,589	30.78	202,809.42	
	MONDI PLC	20,970	19.55	409,963.50	
	RIO TINTO PLC	44,955	60.92	2,738,658.60	
	ASHTREAD GROUP PLC	16,390	50.86	833,595.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	5.33	645,978.07	
	BUNZL PLC	13,836	22.85	316,152.60	
	DCC PLC	3,820	60.80	232,256.00	
	FERGUSON PLC	9,322	96.22	896,962.84	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	160,580	1.66	267,445.99	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	347,631	1.07	373,216.64	
	SMITHS GROUP PLC	15,443	16.02	247,396.86	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	131.95	343,070.00	
	EXPERIAN PLC	38,178	27.05	1,032,714.90	
	INTERTEK GROUP PLC	7,145	54.20	387,259.00	
	RELX PLC	76,115	19.09	1,453,415.92	
	RENTOKIL INITIAL PLC	78,900	4.90	386,688.90	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	7.31	297,744.64	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	4,890	45.71	223,521.90	
	BURBERRY GROUP PLC	14,144	22.19	313,855.36	
	PERSIMMON PLC	13,570	31.05	421,348.50	

TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.67	207,602.57
COMPASS GROUP PLC	69,398	16.10	1,117,307.80
ENTAIN PLC	21,400	18.11	387,661.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,893	50.38	397,649.34
WHITBREAD PLC	8,260	32.55	268,863.00
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.30	229,824.00
INFORMA PLC	56,580	5.30	299,874.00
PEARSON PLC	26,259	8.51	223,464.09
WPP PLC	50,104	10.02	502,042.08
JD SPORTS FASHION PLC	22,850	9.12	208,437.70
KINGFISHER PLC	88,337	3.44	304,144.29
NEXT PLC	5,467	80.68	441,077.56
OCADO GROUP PLC	20,060	18.93	379,836.10
SAINSBURY (J) PLC	59,501	2.53	151,013.53
TESCO PLC	327,918	2.31	759,949.96
WM MORRISON SUPERMARKETS	78,455	1.76	138,629.98
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,945	22.92	342,539.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	90,867	27.95	2,540,186.98
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	26.36	202,708.40
DIAGEO PLC	92,732	34.34	3,184,880.54
IMPERIAL BRANDS PLC	37,492	16.07	602,683.90
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,365	65.66	1,862,445.90
UNILEVER PLC	103,702	42.95	4,454,000.90
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	35,006	15.49	542,417.97
ASTRAZENECA PLC	52,103	83.48	4,349,558.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	198,831	14.07	2,798,347.49
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	24.65	189,558.50
BARCLAYS PLC	668,451	1.79	1,199,201.09
HSBC HOLDINGS PLC	802,691	4.39	3,527,425.59
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,657,136	0.47	1,271,173.86
NATWEST GROUP PLC	181,130	2.05	371,497.63
STANDARD CHARTERED PLC	109,730	4.91	539,103.49
3I GROUP PLC	36,819	12.41	457,107.88
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	16.36	213,072.30

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,277	77.70	953,922.90	
	M&G PLC	99,522	2.44	243,032.72	
	SCHRODERS PLC	4,131	35.71	147,518.01	
	ST JAMES'S PLACE PLC	19,260	14.48	278,884.80	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	88,515	2.84	252,090.72	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,505	31.10	202,305.50	
	AVIVA PLC	170,765	4.16	711,919.28	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	51,053	2.95	150,606.35	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	255,901	2.76	708,589.86	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	7.21	179,028.96	
	PRUDENTIAL PLC	102,232	14.85	1,518,145.20	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	35.36	159,650.40	
	SAGE GROUP PLC/THE	42,810	6.68	286,142.04	
	HALMA PLC	16,450	27.91	459,119.50	
	BT GROUP PLC	355,852	1.91	682,702.06	
	VODAFONE GROUP PLC	1,097,428	1.30	1,426,656.40	
	NATIONAL GRID PLC	143,968	9.20	1,324,505.60	
	SEVERN TRENT PLC	11,503	25.19	289,760.57	
	SSE PLC	42,587	15.79	672,661.66	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,415	10.27	332,902.05	
英ボンド小計		11,443,468		70,079,738.25	(10,889,690,526)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	19.33	146,365.95	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	865.50	233,685.00	
	GIVAUDAN-REG	373	4,230.00	1,577,790.00	
	HOLCIM LTD	21,639	56.56	1,223,901.84	
	SIKA AG-REG	5,740	293.80	1,686,412.00	
	ABB LTD-REG	73,175	31.03	2,270,620.25	
	GEBERIT AG-REG	1,560	669.60	1,044,576.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	630	259.00	163,170.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	266.50	394,420.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,477	64.38	352,609.26	
	SGS SA-REG	258	2,817.00	726,786.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	318.80	634,412.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,859	115.10	2,400,870.90	

	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,000	322.50	322,500.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	62.50	115,625.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	105	2,106.00	221,130.00	
	CHOCOLAFABRIKEN LINDT-PC	44	8,750.00	385,000.00	
	CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	4	92,900.00	371,600.00	
	NESTLE SA-REG	113,833	113.82	12,956,472.06	
	ALCON INC	18,824	63.84	1,201,724.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,381	326.40	777,158.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	450	1,403.50	631,575.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,783	664.60	1,849,581.80	
	NOVARTIS AG-REG	87,623	83.84	7,346,312.32	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,230	365.80	449,934.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,733	341.70	9,476,366.10	
	VIFOR PHARMA AG	1,940	137.55	266,847.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	890	82.90	73,781.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,638	9.57	1,001,804.21	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,170	61.52	502,618.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	1,395.00	1,227,600.00	
	UBS GROUP AG-REG	139,272	14.61	2,035,460.28	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,630	147.30	240,099.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,180	457.30	539,614.00	
	SWISS RE AG	12,249	84.80	1,038,715.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,011	371.50	2,233,086.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	93.80	239,283.80	
	TEMENOS AG	2,640	150.55	397,452.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	115.90	771,894.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,094	525.00	574,350.00	
	スイスフラン小計	688,686		60,103,203.43 (7,358,435,195)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,540	307.90	2,629,466.00	
	BOLIDEN AB	10,890	346.50	3,773,385.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	22,310	139.55	3,113,360.50	
	ALFA LAVAL AB	10,550	299.00	3,154,450.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,110	261.50	11,011,765.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,725	514.20	13,227,795.00	

ATLAS COPCO AB-B SHS	16,490	439.40	7,245,706.00
EPIROC AB-A	27,585	180.05	4,966,679.25
EPIROC AB-B	15,450	159.60	2,465,820.00
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	278.40	1,893,120.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	43,080	89.64	3,861,691.20
SANDVIK AB	48,250	221.10	10,668,075.00
SKANSKA AB-B SHS	11,410	244.40	2,788,604.00
SKF AB-B SHARES-B	14,079	219.30	3,087,524.70
VOLVO AB-A SHS	7,120	232.80	1,657,536.00
VOLVO AB-B SHS-B	57,670	225.80	13,021,886.00
SECURITAS AB-B SHS	14,629	133.10	1,947,119.90
ELECTROLUX AB-SER B	8,095	236.30	1,912,848.50
HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	117.30	1,759,500.00
EVOLUTION AB	5,850	1,590.00	9,301,500.00
EMBRACER GROUP AB	9,310	243.20	2,264,192.00
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,138	209.80	6,322,952.40
ICA GRUPPEN AB	4,230	406.70	1,720,341.00
SWEDISH MATCH AB	63,200	78.10	4,935,920.00
ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,065	291.10	6,132,021.50
NORDEA BANK ABP	131,522	94.42	12,418,307.24
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	108.85	6,797,682.50
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	66,610	94.52	6,295,977.20
SWEDBANK AB - A SHARES	39,490	154.56	6,103,574.40
EQT AB	10,680	323.10	3,450,708.00
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,250	341.20	1,450,100.00
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	324.10	1,938,118.00
INVESTOR AB-B SHS	75,060	195.80	14,696,748.00
KINNEVIK AB - B	10,215	324.10	3,310,681.50
KINNEVIK AB -B - REDEMPTION	10,215	174.00	1,777,410.00
LUNDBERGS AB-B SHS	2,370	553.00	1,310,610.00
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,570	580.40	2,652,428.00
SINCH AB	1,660	1,497.00	2,485,020.00
ERICSSON LM-B SHS	119,755	109.42	13,103,592.10
HEXAGON AB-B SHS	78,890	123.50	9,742,915.00
TELE2 AB-B SHS	18,705	116.45	2,178,197.25

	TELIA CO AB	94,230	36.75	3,463,423.65	
スウェーデンクローナ小計		1,276,228		218,038,751.79	(2,882,472,298)
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	37,444	192.16	7,195,239.04	
	NORSK HYDRO A S	62,840	54.32	3,413,468.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,660	471.10	3,608,626.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	162.00	1,846,800.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,830	349.80	1,339,734.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,420	402.10	973,082.00	
	MOWI ASA	15,340	229.50	3,520,530.00	
	ORKLA ASA	22,670	87.96	1,994,053.20	
	DNB ASA	39,765	189.00	7,515,585.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,810	190.45	1,296,964.50	
	TELENOR ASA	21,965	144.05	3,164,058.25	
ノルウェークローネ小計		232,144		35,868,140.79	(474,176,821)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	562.60	2,160,384.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	453.30	3,587,869.50	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	250	2,995.00	748,750.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	40,500	224.30	9,084,150.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	17,610.00	2,025,150.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	223	18,340.00	4,089,820.00	
	DSV PANALPINA A S	8,570	1,446.50	12,396,505.00	
	PANDORA A/S	4,080	847.20	3,456,576.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	1,138.00	4,495,100.00	
	AMBU A/S-B	6,780	234.90	1,592,622.00	
	COLOPLAST-B	4,275	989.20	4,228,830.00	
	DEMANT A/S	4,410	343.80	1,516,158.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	521.20	2,590,364.00	
	GENMAB A/S	2,560	2,703.00	6,919,680.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	68,315	516.30	35,271,034.50	
	DANSKE BANK A/S	31,805	115.45	3,671,887.25	
	TRYG A/S	15,435	152.00	2,346,120.00	
ORSTED A/S	7,760	868.20	6,737,232.00		
		215,753		106,918,232.25	

デンマーククローネ小計				(1,919,182,268)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	29.34	257,458.50
	OIL SEARCH LTD	77,602	4.10	318,168.20
	SANTOS LTD	65,495	7.67	502,346.65
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,333	23.62	905,425.46
	BHP GROUP LTD	116,836	48.95	5,719,122.20
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	22.82	417,834.20
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	5.08	350,520.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,085	23.22	1,534,493.70
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	17,805	44.54	793,034.70
	NEWCREST MINING LTD	30,209	28.33	855,820.97
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	11.50	485,185.00
	ORICA LIMITED	12,135	14.31	173,651.85
	RIO TINTO LTD	15,718	124.94	1,963,806.92
	SOUTH32 LTD	205,747	2.95	606,953.65
	REECE LTD	10,200	22.70	231,540.00
	BRAMBLES LTD	62,498	11.25	703,102.50
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.89	286,187.30
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.71	207,240.00
	SYDNEY AIRPORT	47,076	6.04	284,339.04
	TRANSURBAN GROUP	114,369	14.32	1,637,764.08
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,290	40.70	1,029,303.00
	CROWN RESORTS LTD	11,395	12.22	139,246.90
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	115.30	245,589.00
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,974	5.01	355,579.74
	REA GROUP LTD	1,820	166.70	303,394.00
	SEEK LTD	10,700	31.46	336,622.00
	WESFARMERS LTD	47,175	55.00	2,594,625.00
	COLES GROUP LTD	52,085	16.67	868,256.95
	WOOLWORTHS GROUP LTD	50,462	42.91	2,165,324.42
	TREASURY WINE ESTATES LTD	25,746	11.92	306,892.32
	COCHLEAR LTD	2,917	235.32	686,428.44
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,995	63.62	572,261.90
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,610	35.60	769,316.00
	CSL LTD	18,032	296.64	5,349,012.48

	AUST AND NZ BANKING GROUP	116,069	28.25	3,278,949.25	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	69,927	101.36	7,087,800.72	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	129,523	26.46	3,427,178.58	
	WESTPAC BANKING CORP	140,771	26.29	3,700,869.59	
	ASX LTD	7,925	74.02	586,608.50	
	MACQUARIE GROUP LTD	13,374	151.56	2,026,963.44	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,820	50.12	241,578.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.22	496,552.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	92,560	3.07	284,159.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	64,150	11.32	726,178.00	
	SUNCORP GROUP LTD	57,276	11.22	642,636.72	
	AFTERPAY LTD	8,240	103.52	853,004.80	
	COMPUTERSHARE LTD	17,450	16.06	280,247.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,130	30.70	157,491.00	
	XERO LTD	5,480	134.08	734,758.40	
	TELSTRA CORPORATION LTD	182,084	3.58	651,860.72	
	AGL ENERGY LTD	21,261	9.32	198,152.52	
	APA GROUP	45,818	9.45	432,980.10	
	AUSNET SERVICES	72,810	1.81	132,150.15	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,520	4.84	259,036.80	
豪ドル小計		2,688,597		60,155,003.46	(5,107,761,343)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	7.43	419,906.45	
	A2 MILK CO LTD	23,220	6.29	146,053.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,200	29.13	617,556.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,870	13.05	154,903.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.80	367,569.60	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.43	131,172.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	5.34	245,533.20	
ニュージーランドドル小計		255,762		2,082,694.55	(163,783,099)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,208	59.80	6,650,238.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	55,000	140.70	7,738,500.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	82,000	30.15	2,472,300.00	
	MTR CORP	57,500	43.40	2,495,500.00	

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	92,000	62.45	5,745,400.00	
	SANDS CHINA LTD	111,400	33.95	3,782,030.00	
	SJM HOLDINGS LTD	91,000	8.81	801,710.00	
	WYNN MACAU LTD	63,000	13.14	827,820.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	26.25	1,782,375.00	
	WH GROUP LTD	441,500	7.17	3,165,555.00	
	BANK OF EAST ASIA	45,240	15.60	705,744.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	27.70	4,155,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	27,300	159.20	4,346,160.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	47,400	468.20	22,192,680.00	
	AIA GROUP LTD	476,990	95.60	45,600,244.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	52.55	4,048,346.90	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	24.35	1,845,730.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	19.76	1,541,280.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	38.30	2,217,608.30	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	42.20	3,066,505.20	
	SINO LAND CO	143,050	12.46	1,782,403.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,980	122.00	6,463,560.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	57.75	1,011,606.75	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	23.75	988,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	45.20	2,883,760.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.54	1,581,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	48.10	1,202,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	55,000	78.65	4,325,750.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.88	748,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	451,655	12.32	5,564,389.60	
	HONG KONG & CHINA GAS(N)	22,582	12.32	278,210.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	48.65	2,675,750.00	
香港ドル小計		3,454,027		154,686,256.39 (2,194,997,978)	
シンガポールド ドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	5.18	276,404.80	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,900	3.89	201,891.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.13	276,507.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.88	186,823.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.77	352,789.20	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,715	29.66	2,127,066.90	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	137,740	12.23	1,684,560.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	25.98	1,085,964.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,700	10.71	425,187.00	
	CAPITALAND LTD	118,500	3.76	445,560.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.58	131,134.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	7.39	114,914.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	19.00	188,100.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	369,180	2.33	860,189.40	
シンガポールドル小計		1,265,605		8,357,091.50 (693,555,023)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	23.91	623,811.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	423.40	508,080.00	
	BANK HAPOALIM BM	45,535	27.15	1,236,275.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	25.80	1,470,729.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	40,300	16.48	664,144.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	101.80	498,820.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	241.20	323,208.00	
	NICE LTD	2,715	735.50	1,996,882.50	
イスラエルシュケル小計		179,085		7,321,950.65 (248,382,531)	
合 計		43,182,914		229,115,883,421 (229,115,883,421)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	19,130	337,261.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	1,014,097.20	
		AMERICAN TOWER CORP	17,639	4,779,110.66	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	566,370.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,925	1,269,194.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,977	741,327.31	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	546,167.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,080	3,366,126.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,095	1,801,051.35	
		DUKE REALTY CORPORATION	16,085	796,207.50	
		EQUINIX INC	3,588	2,956,476.12	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	482,076.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	14,290	1,156,203.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	782,192.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	817,293.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	719,237.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	31,199	551,286.33	
		INVITATION HOMES INC	22,810	862,446.10	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	538,646.50	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	441,597.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,030	691,507.70	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	421,736.40	
		PROLOGIS INC	29,068	3,667,218.88	
		PUBLIC STORAGE	6,119	1,802,840.97	
		REALTY INCOME CORP	15,030	1,061,118.00	
		REGENCY CENTERS CORP	6,695	447,493.80	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,100	1,312,041.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,554	1,673,197.12	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	777,888.00	
		UDR INC	13,480	675,617.60	
		VENTAS INC	14,825	874,082.00	
		VEREIT INC	7,592	371,628.40	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	700,378.80	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	343,029.57	
		WELLTOWER INC	17,230	1,399,248.30	
		WEYERHAEUSER CO	27,788	959,519.64	
		WP CAREY INC	6,460	502,200.40	
米ドル小計			509,790	42,205,115.60	(4,647,205,278)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	159,796.00	
			2,800	159,796.00	

加ドル小計				(14,490,301)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	156,271.50
		GECINA SA	1,950	264,615.00
		KLEPIERRE	6,642	165,784.32
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,360	429,443.20
ユーロ小計			15,877	1,016,114.02 (135,600,415)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	190,378.18
		LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	245,286.92
		SEGRO PLC	45,033	493,561.68
英ポンド小計			116,148	929,226.78 (144,392,549)
豪ドル	投資証券	DEXUS	35,587	381,848.51
		GOODMAN GROUP	63,582	1,311,060.84
		GPT GROUP	71,335	350,254.85
		LENDLEASE GROUP	28,927	368,819.25
		MIRVAC GROUP	135,075	401,172.75
		SCENTRE GROUP	198,271	574,985.90
		STOCKLAND	96,900	464,151.00
		VICINITY CENTRES	191,002	319,928.35
豪ドル小計			820,679	4,172,221.45 (354,263,323)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	87,500	6,724,375.00
香港ドル小計			87,500	6,724,375.00 (95,418,881)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	345,241.71
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	191,228	411,140.20
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	155,230.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	281,585.98
シンガポールドル小計			519,070	1,193,197.89 (99,023,492)
合計				5,490,394,239 (5,490,394,239)

(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 599銘柄	97.2%		69.7%
	投資証券 37銘柄		2.8%	2.0%
加ドル	株式 88銘柄	99.8%		3.6%
	投資証券 1銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	99.5%		10.8%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.1%
英ポンド	株式 84銘柄	98.7%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%		3.1%
スウェーデンクローナ	株式 42銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 54銘柄	93.5%		2.2%
	投資証券 8銘柄		6.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 32銘柄	95.8%		0.9%
	投資証券 1銘柄		4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.5%		0.3%
	投資証券 4銘柄		12.5%	0.0%
イスラエルシケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 6月30日現在です。

【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	34,972,583,188円
負債総額	41,210,482円
純資産総額(-)	34,931,372,706円
発行済口数	34,430,517,823口
1口当たり純資産額(/)	1.0145円

(参考)

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	80,846,365,384円
負債総額	314円
純資産総額(-)	80,846,365,070円
発行済口数	30,011,086,859口
1口当たり純資産額(/)	2.6939円

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	75,087,540,861円
負債総額	20,024,032円
純資産総額(-)	75,067,516,829円
発行済口数	29,539,017,852口
1口当たり純資産額(/)	2.5413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	48,088,813,517円
負債総額	291,102,311円
純資産総額（ - ）	47,797,711,206円
発行済口数	33,840,537,230口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4124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	157,808,027,189円
負債総額	302,299,034円
純資産総額（ - ）	157,505,728,155円
発行済口数	61,915,007,522口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5439円

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	39,924,734,654円
負債総額	220,274,805円
純資産総額（ - ）	39,704,459,849円
発行済口数	21,218,611,519口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8712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	240,586,555,107円
負債総額	79,808,377円
純資産総額（ - ）	240,506,746,730円
発行済口数	63,322,783,456口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7981円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2021年6月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2021年6月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2021年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	858	267,333
株式投資信託	790	231,775
単位型	282	11,167
追加型	508	220,607
公社債投資信託	68	35,558
単位型	55	2,181
追加型	13	33,376

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第61期 (2020年3月31日)		第62期 (2021年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,591		24,698
有価証券		19		17
前払費用		603		785
未収入金		14		225
未収委託者報酬		16,912		24,738
未収収益	3	1,412	3	891
関係会社短期貸付金		2,371		2,403
立替金		1,437		930
その他	2	1,316	2	361
流動資産合計		48,679		55,053
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	182	1	245
器具備品	1	135	1	190
有形固定資産合計		318		436
無形固定資産				
ソフトウェア		120		241
無形固定資産合計		120		241
投資その他の資産				
投資有価証券		17,826		22,903
関係会社株式		25,769		25,987
長期差入保証金		484		678

繰延税金資産	2,022	1,845
投資その他の資産合計	46,102	51,414
固定資産合計	46,540	52,092
資産合計	95,220	107,145

(単位：百万円)

	第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	554	844
未払金	5,881	9,834
未払収益分配金	8	8
未払償還金	71	71
未払手数料	5,202	8,956
その他未払金	599	798
未払費用	3 4,289	3 4,660
未払法人税等	1,439	1,090
未払消費税等	4 746	4 775
賞与引当金	2,718	3,034
役員賞与引当金	55	55
その他	42	643
流動負債合計	15,726	20,938
固定負債		
退職給付引当金	1,395	1,456
賞与引当金	-	156
その他	695	544
固定負債合計	2,091	2,157
負債合計	17,818	23,095
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	55,395	61,956
利益剰余金合計	55,395	61,956
自己株式	905	2,067
株主資本合計	77,073	82,472
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	60	1,461
繰延ヘッジ損益	389	115
評価・換算差額等合計	329	1,577
純資産合計	77,402	84,049
負債純資産合計	95,220	107,145

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,265	78,975
その他営業収益	2,994	3,973
営業収益合計	77,259	82,948
営業費用		
支払手数料	31,322	34,050
広告宣伝費	953	953
公告費	2	1
調査費	17,275	17,813
調査費	920	966
委託調査費	16,333	16,825
図書費	21	22
委託計算費	534	545
営業雑経費	1,058	1,053
通信費	116	174
印刷費	337	331
協会費	52	51
諸会費	10	11
その他	541	483
営業費用計	51,148	54,419
一般管理費		
給料	9,857	10,383
役員報酬	360	243
役員賞与引当金繰入額	55	55
給料・手当	6,675	6,766
賞与	64	159
賞与引当金繰入額	2,702	3,158
交際費	92	14
寄付金	29	30
旅費交通費	420	57
租税公課	440	485
不動産賃借料	901	939
退職給付費用	387	388
退職金	82	10
固定資産減価償却費	118	138
福利費	1,014	1,084
諸経費	3,229	4,286
一般管理費計	16,573	17,817
営業利益	9,538	10,711

	(単位：百万円)	
	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取利息	99	75
受取配当金	1 4,881	1 2,555
有価証券償還益	-	14

デリバティブ収益	223	-
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	5	-
その他	145	62
営業外収益合計	5,357	2,710
営業外費用		
支払利息	185	122
有価証券償還損	0	-
デリバティブ費用	-	804
時効成立後支払分配金・償還金	1	25
為替差損	-	59
その他	12	42
営業外費用合計	199	1,054
経常利益	14,695	12,367
特別利益		
投資有価証券売却益	164	774
その他	-	0
特別利益合計	164	774
特別損失		
投資有価証券売却損	19	237
投資有価証券評価損	21	5
固定資産処分損	0	0
役員退職一時金	-	125
特別損失合計	41	369
税引前当期純利益	14,818	12,773
法人税、住民税及び事業税	3,307	3,722
法人税等調整額	45	373
法人税等合計	3,353	3,348
当期純利益	11,465	9,424

(3) 【株主資本等変動計算書】

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

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 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	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

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021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 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 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</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="526 795 1037 873"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法</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>				

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。
---------------------------	--

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(貸借対照表関係)

第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,311百万円 器具備品 707百万円	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
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 151百万円 (流動負債) 未払費用 623百万円	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 257百万円 (流動負債) 未払費用 1,247百万円
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 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd が ロンドン ウォール リミテッド パートナーシップ に支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対し て保証を行っております。	

(損益計算書関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021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 4,849百万円	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 2,498百万円

(株主資本等変動計算書関係)

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(変動事由の概要)

2019年8月13日の取締役会決議による自己株式の取得 88,800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	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	871,200	1,184,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	2,272,000	1,346,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,417,000	2,394,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,417,000	2,939,000	-
合計		15,088,300	-	7,224,600	7,863,700	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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
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

(リース取引関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第62期 (自 2020年4月1日 至 2021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	912百万円	1年内	911百万円
1年超	6,148百万円	1年超	5,236百万円
合計	7,060百万円	合計	6,148百万円

(金融商品関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

クを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	-
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	-
(3) 未収収益	1,412	1,412	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	17,828	17,828	-
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	-
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	-
デリバティブ取引計	142	142	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	-	-	-
未収委託者報酬	16,912	-	-	-

未収収益	1,412	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。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

週次ペ - 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

(有価証券関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

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

(デリバティブ取引関係)

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外	為替予約取引 売建				

の取引	米ドル	1,808	-	15	15
合計		1,808	-	15	15

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

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				
	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。

(持分法損益等)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021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 3,002	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751

(退職給付関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎
割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

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。

(ストックオプション等関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

権利未行使残	-	-
--------	---	---

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
 2 ス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 1,633百万円
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	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tock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	752,400	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 1,738百万円
- 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。

(税効果会計関係)

第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	822	賞与引当金	929
投資有価証券評価損	102	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	1,430
退職給付引当金	427	退職給付引当金	446
固定資産減価償却費	96	固定資産減価償却費	90
その他	744	その他	978
繰延税金資産小計	3,624	繰延税金資産小計	3,972
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,194	繰延税金資産合計	2,541
繰延税金負債		繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172	繰延ヘッジ利益	51
繰延税金負債合計	172	その他有価証券評価差額金	645
繰延税金資産の純額	2,022	繰延税金負債合計	696
		繰延税金資産の純額	1,845
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	9.6%	受取配当金等永久に益金に参入されない項目	5.7%
その他	1.0%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%

(関連当事者情報)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International	シンガポール	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント	直接 100.00	-	資金の貸付 (米国ドル貸建) (注1)	-	関係会社 短期貸付金	1,793 (USD) 16,500 (千)
							貸付金利息 (米国ドル貸建) (注1)	86 (USD) 798 (千)	未収収益	13 (USD) 122 (千)

	Limited	国		ト業			資金の貸付 (円貨建) (注1)		関係会社 短期 貸付金	
							-		577	
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	1,526 (USD 14,000 千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,700	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円
営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

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)
							資金の貸付 (米国ドル 貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500 千)

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

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。

関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(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。

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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

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。

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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

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。

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61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

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。

(1株当たり情報)

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	395円50銭	432円90銭
1株当たり当期純利益金額	58円61銭	48円45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61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,465	9,424
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)	11,465	9,424
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,599	194,509
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) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株	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

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61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	77,402	84,049
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)	77,402	84,049
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,558	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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)に

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 (2021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 (2021年3月末現在)	事業の内容
エース証券株式会社	8,831百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村證券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社 1	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	10,857百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
オーストラリア・アンド・ニューゼaland・バンキング・グループ・リミテッド(銀行) 1	26,531百万豪ドル (2020年9月末現在)	
株式会社香川銀行	12,014百万円	

株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社三十三銀行 1	37,461百万円 (2021年5月1日現在)	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行 1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社南日本銀行	16,601百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余剰資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	165,600百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
東京都信用農業協同組合連合会	130,200百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	201,700百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	60,662百万円	
新潟県信用農業協同組合連合会	56,200百万円	
石川県信用農業協同組合連合会	33,047百万円	
岐阜県信用農業協同組合連合会	74,618百万円	
静岡県信用農業協同組合連合会	161,300百万円	
愛知県信用農業協同組合連合会	220,402百万円	
三重県信用農業協同組合連合会	68,752百万円	
滋賀県信用農業協同組合連合会	40,700百万円	

大阪府信用農業協同組合連合会	140,600百万円
兵庫県信用農業協同組合連合会	208,800百万円
和歌山県信用農業協同組合連合会	57,883百万円
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円
徳島県信用農業協同組合連合会	32,500百万円
高知県信用農業協同組合連合会	24,879百万円
仙台農業協同組合	3,375百万円
みやぎ亘理農業協同組合	1,532百万円
みやぎ登米農業協同組合	6,378百万円
新みやぎ農業協同組合	10,536百万円
いしのまき農業協同組合	4,584百万円
みやぎ仙南農業協同組合	3,882百万円
秋田しんせい農業協同組合	5,410百万円
山形農業協同組合	4,007百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,682百万円
山形おきたま農業協同組合	4,761百万円
鶴岡市農業協同組合	1,474百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,290百万円
ふくしま未来農業協同組合	15,999百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,231百万円
北つくば農業協同組合	3,393百万円
はが野農業協同組合	3,888百万円
那須南農業協同組合	1,171百万円
高崎市農業協同組合	2,121百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,573百万円
さいたま農業協同組合	8,291百万円
あさか野農業協同組合	867百万円
いるま野農業協同組合	5,778百万円
埼玉中央農業協同組合	2,349百万円
くまがや農業協同組合	2,721百万円
ほくさい農業協同組合	3,135百万円
越谷市農業協同組合	2,035百万円
南彩農業協同組合	2,835百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,469百万円
さいかつ農業協同組合	1,842百万円
ふかや農業協同組合	1,732百万円
横浜農業協同組合	11,919百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,517百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,411百万円
さがみ農業協同組合	5,161百万円
湘南農業協同組合	3,301百万円
秦野市農業協同組合	1,698百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,448百万円

厚木市農業協同組合	2,477百万円
相模原市農業協同組合	859百万円
神奈川つくい農業協同組合	806百万円
佐久浅間農業協同組合	6,853百万円
信州うえだ農業協同組合	4,172百万円
信州諏訪農業協同組合	6,384百万円
上伊那農業協同組合	8,122百万円
みなみ信州農業協同組合	4,436百万円
松本ハイランド農業協同組合	6,494百万円
大北農業協同組合	3,141百万円
グリーン長野農業協同組合	3,803百万円
中野市農業協同組合	2,590百万円
ながの農業協同組合	12,924百万円
北越後農業協同組合	2,971百万円
新潟みらい農業協同組合	4,781百万円
越後中央農業協同組合	5,202百万円
にいがた南蒲農業協同組合	4,946百万円
越後ながおか農業協同組合	5,382百万円
十日町農業協同組合	2,729百万円
ひすい農業協同組合	1,225百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,414百万円
佐渡農業協同組合	2,422百万円
加賀農業協同組合	1,986百万円
小松市農業協同組合	1,876百万円
能美農業協同組合	1,259百万円
金沢中央農業協同組合	1,061百万円
金沢市農業協同組合	3,136百万円
はくい農業協同組合	1,361百万円
能登わかば農業協同組合	2,650百万円
おおぞら農業協同組合	1,404百万円
ぎふ農業協同組合	7,192百万円
西美濃農業協同組合	4,584百万円
いび川農業協同組合	2,019百万円
めぐみの農業協同組合	4,997百万円
陶都信用農業協同組合	1,604百万円
東美濃農業協同組合	2,610百万円
飛騨農業協同組合	6,452百万円
伊豆太陽農業協同組合	1,757百万円
三島函南農業協同組合	1,012百万円
伊豆の国農業協同組合	902百万円
あいら伊豆農業協同組合	901百万円
南駿農業協同組合	3,113百万円
御殿場農業協同組合	1,215百万円

富士市農業協同組合	1,467百万円
富士宮農業協同組合	932百万円
清水農業協同組合	2,945百万円
静岡市農業協同組合	1,868百万円
大井川農業協同組合	3,364百万円
ハイナン農業協同組合	840百万円
掛川市農業協同組合	766百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,495百万円
遠州中央農業協同組合	3,273百万円
とぴあ浜松農業協同組合	3,677百万円
三ヶ日町農業協同組合	295百万円
なごや農業協同組合	2,411百万円
尾張中央農業協同組合	2,091百万円
西春日井農業協同組合	156百万円
あいち尾東農業協同組合	1,201百万円
愛知北農業協同組合	751百万円
愛知西農業協同組合	1,606百万円
あいち知多農業協同組合	6,979百万円
あいち中央農業協同組合	3,542百万円
西三河農業協同組合	1,316百万円
あいち三河農業協同組合	1,118百万円
あいち豊田農業協同組合	1,808百万円
愛知東農業協同組合	948百万円
豊橋農業協同組合	2,495百万円
鈴鹿農業協同組合	1,574百万円
津安芸農業協同組合	2,408百万円
伊勢農業協同組合	6,287百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	3,733百万円
甲賀農業協同組合	2,518百万円
北大阪農業協同組合	1,845百万円
茨木市農業協同組合	1,217百万円
大阪泉州農業協同組合	1,961百万円
いずみの農業協同組合	2,841百万円
堺市農業協同組合	1,190百万円
大阪南農業協同組合	3,728百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,466百万円
大阪中河内農業協同組合	4,237百万円
北河内農業協同組合	2,640百万円
大阪市農業協同組合	2,318百万円
兵庫南農業協同組合	3,749百万円
みのり農業協同組合	4,340百万円
兵庫西農業協同組合	12,582百万円
たじま農業協同組合	4,383百万円

丹波ひかみ農業協同組合	2,220百万円
淡路日の出農業協同組合	1,862百万円
奈良県農業協同組合	9,371百万円
わかやま農業協同組合	4,698百万円
ながみね農業協同組合	2,012百万円
紀の里農業協同組合	3,716百万円
紀北川上農業協同組合	4,671百万円
ありだ農業協同組合	2,091百万円
紀州農業協同組合	3,712百万円
紀南農業協同組合	4,778百万円
みくまの農業協同組合	1,059百万円
鳥取いなば農業協同組合	5,888百万円
鳥取中央農業協同組合	3,740百万円
鳥取西部農業協同組合	5,066百万円
島根県農業協同組合	22,328百万円
広島市農業協同組合	9,390百万円
広島中央農業協同組合	3,076百万円
山口県農業協同組合	16,655百万円
徳島市農業協同組合	3,215百万円
香川県農業協同組合	25,453百万円
越智今治農業協同組合	6,444百万円
高知市農業協同組合	4,777百万円
高知県農業協同組合	11,009百万円
福岡八女農業協同組合	3,409百万円
宮崎中央農業協同組合	5,718百万円
延岡農業協同組合	1,416百万円
沖縄県農業協同組合	22,989百万円

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
ファンドの基本的性格など
委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
目論見書の使用開始日

- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
- 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
- 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
- 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
- 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
- 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
- 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
- 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
- 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
- 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

2021年6月11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 竹 内 知 明
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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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、継続企業的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。継続企業的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

2021年7月21日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2020年12月16日から2021年6月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。