【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】	2022年1月26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】	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）
【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】

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）（以下「ファンド」といいます。）
・愛称として「ＤＣ Ａナビ40」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1.1%（税抜１％）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。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、１円以上１円単位とします。

（7）【申込期間】

2022年1月27日から2022年7月26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】

① ファンドの目的

４つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

② 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
		債券
	海外	不動産投信
追加型投信		その他資産（　　）
	内外	
		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 大型株 中小型株	年１回	グローバル （含む日本）		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　）	年２回 年４回 年６回 （隔月） 年 12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （部分ヘッジ） なし
不動産投信				
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）））				
資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券））

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

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

◇年１回

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

◇グローバル（含む日本）

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。

※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。

③　ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」
主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

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

「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

※TOPIX（東証株価指数）：TOPIXの指数値およびTOPIX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：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。
※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）：同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%とします。
組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投　資　対　象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	5%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	5%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。
※基本投資比率からカイ離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

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

ファンドの仕組み

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

主な投資制限

・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

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

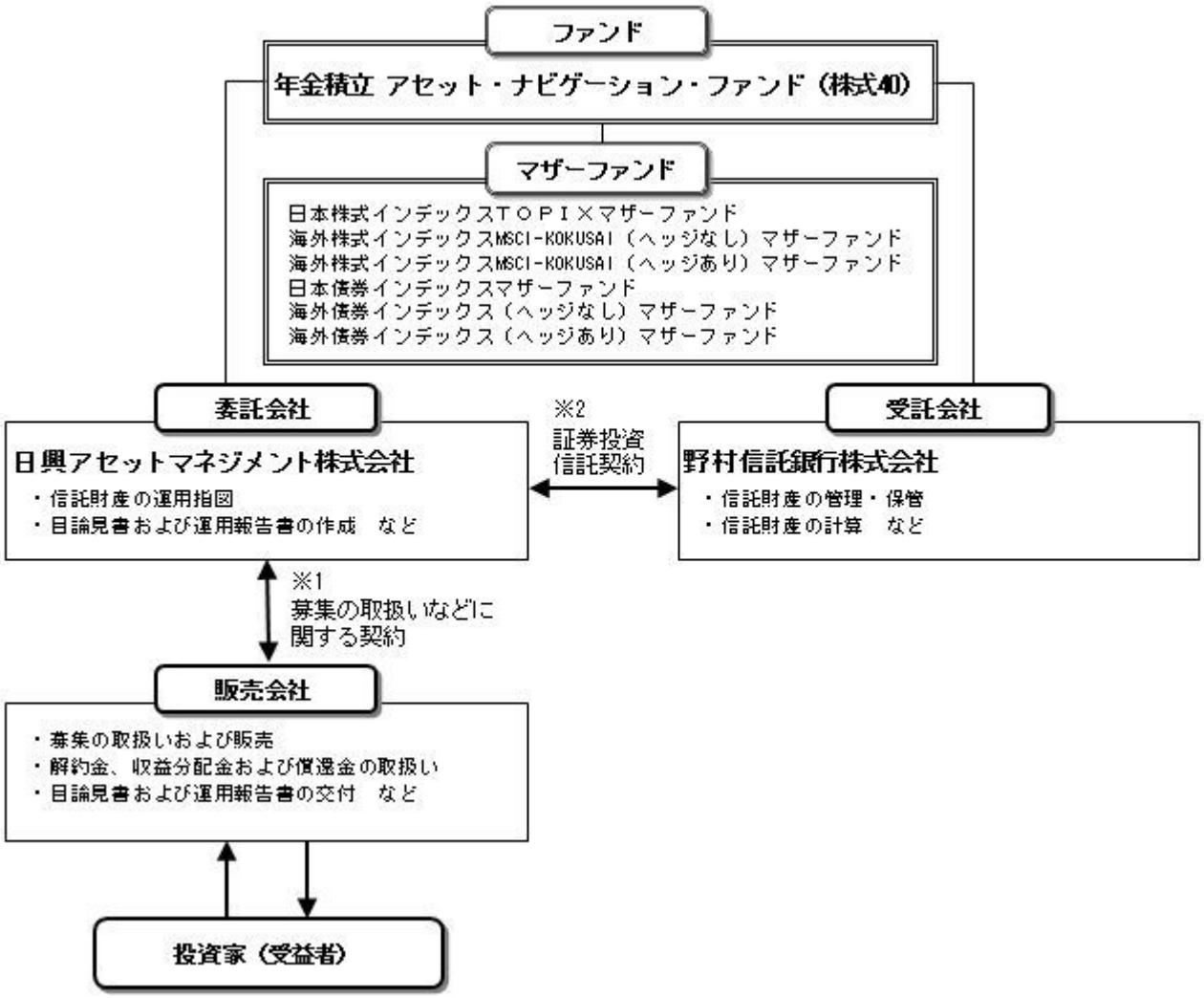
④　信託金限度額
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（2）【ファンドの沿革】

2001年10月17日
・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①　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。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。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。

②　委託会社の概況（2021年10月末現在）

1）資本金

17,363百万円

2）沿革

1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立

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

3）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

ざします。
証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
株式の標準実質組入比率……40%
公社債および短期金融資産の標準実質組入比率……60%
・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
・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】

＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）＞
以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
証券投資信託 「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
証券投資信託 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
証券投資信託 「日本債券インデックスマザーファンド」
証券投資信託 「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託 「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券
２）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
３）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
４）証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
５）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
６）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
７）株券または新株引受権証書
８）国債証券
９）地方債証券
10）特別の法律により法人の発行する債券
11）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
13）コマーシャル・ペーパー
14）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
15）外国または外国の者の発行する証券または証書で、７）～14）の証券または証書の性質を有するも

の
16）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
17）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で18）に定めるもの以外のもの
18）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
19）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
20）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
22）外国法人が発行する譲渡性預金証書
23）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
25）外国の者に対する権利で24）の有価証券の性質を有するもの

③　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

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引
10）資金の借入

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

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

４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）～８）の証券の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
14）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③　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

④　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。

①　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

②　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

③　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

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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。

①　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

②　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

③　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

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引

＜日本債券インデックスマザーファンド＞
わが国の公社債を主要投資対象とします。

①　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

②　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

③　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

④　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。

①　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

②　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

③　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

④　次の取引ができます。
１）先物取引等
２）スワップ取引
３）金利先渡取引
４）為替先渡取引
５）有価証券の貸付
６）公社債の空売
７）公社債の借入
８）外国為替予約取引

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞
内外の公社債を主要投資対象とします。

①　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

②　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

③　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

④　次の取引ができます。
１）先物取引等
２）スワップ取引
３）金利先渡取引
４）為替先渡取引
５）有価証券の貸付
６）公社債の空売
７）公社債の借入
８）外国為替予約取引

◆投資対象とするマザーファンドの概要
＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	**わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。**
主な投資対象	**わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。**

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

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

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。

※ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の構成銘柄は、現行の市場区分において、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄が対象となります。（有価証券届出書提出日現在）

＜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	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）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	・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なわずに円換算したものです。

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

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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（円ヘッジあり・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	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	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・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、株価指数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、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、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入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	・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。（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合＊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	・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	・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られます。

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	・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	・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。

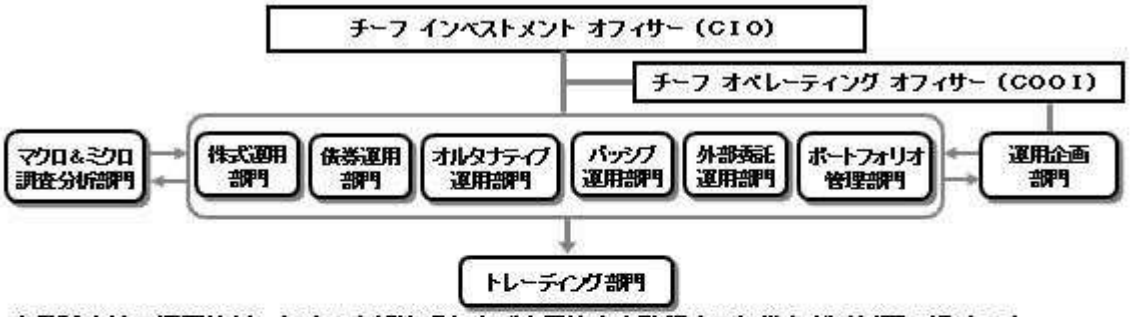
＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

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、ヘッジあり・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	・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、ヘッジあり・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が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入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	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

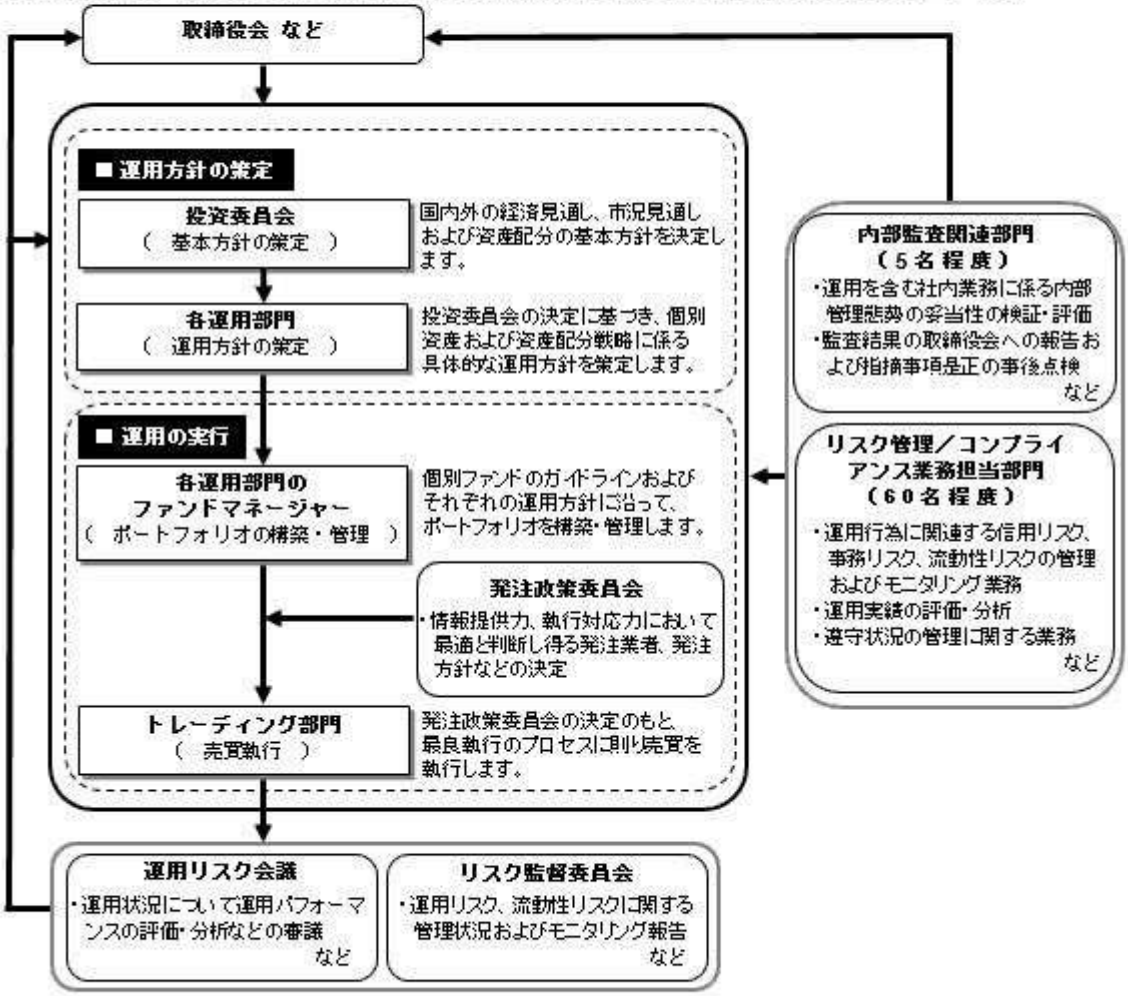
＊FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

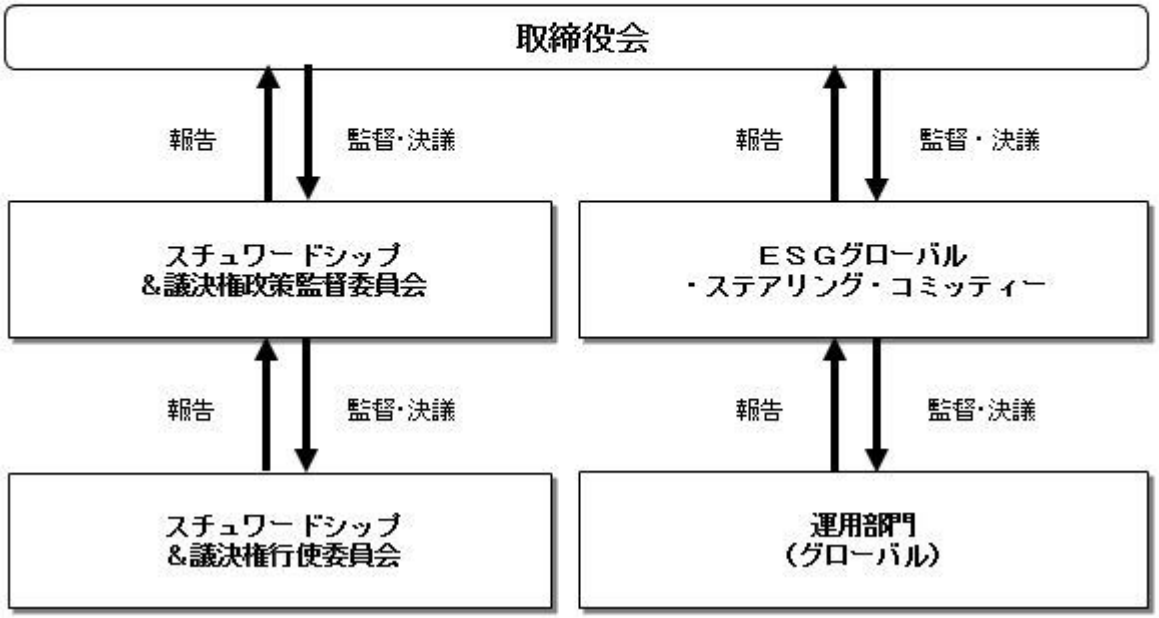


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

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10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】

① 収益分配方針
毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。
１）分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
２）分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
② 収益分配金の支払い
原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）＞
１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
３）投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５%以下とします。
４）外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

６）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

７）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

８）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

９）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

10）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

12）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

15）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ）解約に伴な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）解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とします。

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

16）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

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

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

３）外貨建資産への投資は行ないません。

４）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

５）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

６）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

８）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

９）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

12）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

13）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

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

3）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

4）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

5）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

6）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

7）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

8）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

9）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

10）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

12）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

15）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法

により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

７）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

８）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

９）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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）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。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

12）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

15）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資は行ないません。

3）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

4）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

5）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

6）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

7）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

8）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

9）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

10）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

4）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

5）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

６）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

８）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

９）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

12）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

１）株式への投資は行ないません。

２）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

３）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

４）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

５）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

６）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

８）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

9）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

12）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・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。

・投資者の皆様の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）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

② 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。

③ 信用リスク

・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体

の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。

・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④　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。

・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないますが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

＜その他の留意事項＞

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

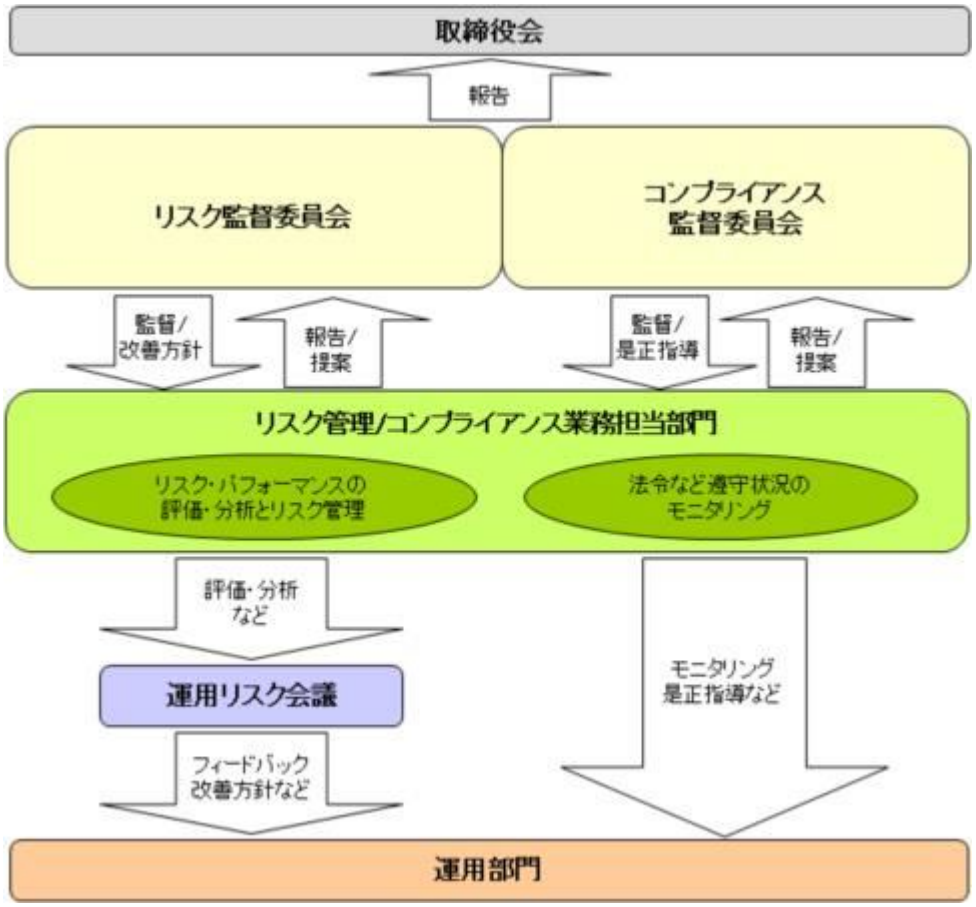
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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、流動性リスクなど）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や流動性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、運用リスクおよび流動性リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

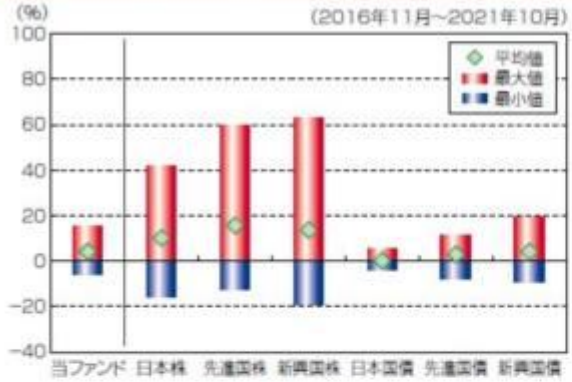
■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は2021年10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	4.2%	10.1%	15.6%	13.7%	0.2%	3.0%	4.1%
最大値	15.3%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-6.1%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.0%	-7.9%	-9.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※上記は2016年11月から2021年10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して計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>
日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)
先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)
新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)
日本国債……NOMURA-BPI国債
先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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11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して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。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数（TOPIX、配当込）
当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

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

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（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1.1%（税抜１％）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。
・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。
※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】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（１口当たり）が差し引かれます。
※「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことです。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.671%（税抜0.61%）の率を乗じて得た額とします。
② 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
0.61%	0.17%	0.40%	0.04%

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。
③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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

① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
③ 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、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

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

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

≪確定拠出年金でない場合≫
① 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す。）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す。）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す。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。
※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所

得との損益通算はできません。ただし、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 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。

③ 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。

④ 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

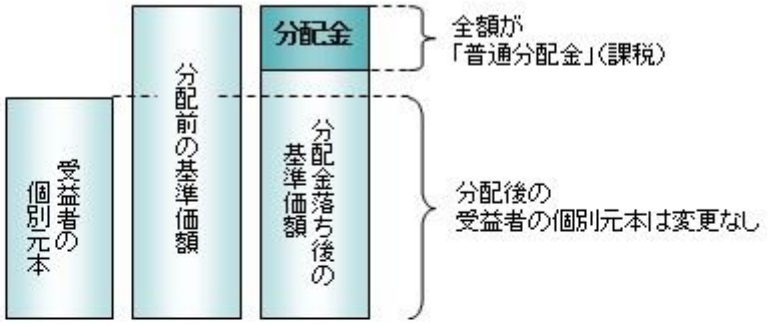
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

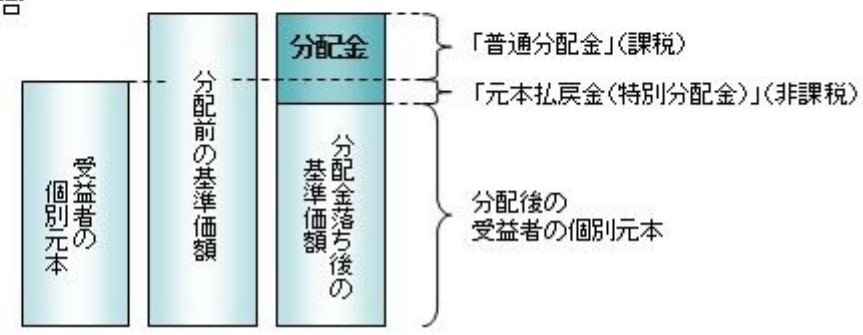
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜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2022年1月26日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

以下の運用状況は2021年10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,310,594,516	95.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	225,410,412	4.97
合計（純資産総額）		4,536,004,928	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(％)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	1,449,082,259	1.4100	2,043,205,986	1.4120	2,046,104,149	45.11
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	692,707,343	1.9592	1,357,214,686	1.9427	1,345,722,555	29.67
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	56,016,674	4.1177	230,659,859	4.1392	231,864,217	5.11
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	89,208,929	2.5748	229,695,151	2.5884	230,908,391	5.09
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	87,993,007	2.5816	227,162,747	2.5986	228,658,627	5.04
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	141,290,601	1.6005	226,136,060	1.6090	227,336,577	5.01

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	95.03
合　　計	95.03

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第11計算期間末 (2012年10月26日)	2,262	2,264	1.0722	1.0732
第12計算期間末 (2013年10月28日)	2,855	2,858	1.3161	1.3171
第13計算期間末 (2014年10月27日)	3,118	3,120	1.3794	1.3804
第14計算期間末 (2015年10月26日)	3,504	3,506	1.5181	1.5191
第15計算期間末 (2016年10月26日)	3,531	3,533	1.4905	1.4915
第16計算期間末 (2017年10月26日)	3,783	3,785	1.6356	1.6366
第17計算期間末 (2018年10月26日)	3,745	3,747	1.5921	1.5931
第18計算期間末 (2019年10月28日)	4,092	4,094	1.6670	1.6680
第19計算期間末 (2020年10月26日)	4,113	4,115	1.6837	1.6847
第20計算期間末 (2021年10月26日)	4,541	4,543	1.8625	1.8635
2020年10月末日	4,084	—	1.6626	—
11月末日	4,271	—	1.7373	—
12月末日	4,350	—	1.7573	—
2021年 1月末日	4,358	—	1.7580	—
2月末日	4,379	—	1.7680	—
3月末日	4,502	—	1.8133	—
4月末日	4,498	—	1.8076	—
5月末日	4,490	—	1.8174	—
6月末日	4,507	—	1.8281	—
7月末日	4,514	—	1.8249	—
8月末日	4,537	—	1.8448	—
9月末日	4,549	—	1.8582	—
10月末日	4,536	—	1.8610	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第11期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0010
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010

第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.0010
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	0.0010

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第11期	2011年10月27日～2012年10月26日	3.44
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	22.84
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	4.89
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	10.13
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	△1.75
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	9.80
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	△2.60
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	4.77
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	1.06
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	10.68

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第11期	2011年10月27日～2012年10月26日	231,577,094	139,126,385
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	341,443,254	281,539,572
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	263,538,060	172,992,670
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	247,412,143	199,495,601
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	233,869,947	173,144,761
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	230,481,180	286,599,979
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	282,357,045	242,784,664
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	293,438,215	191,187,785
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	307,946,853	319,803,689
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	299,470,215	304,209,193

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

以下の運用状況は2021年10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	40,998,075,830	98.65
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	561,959,540	1.35
合計（純資産総額）		41,560,035,370	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	617,675,000	1.49

(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	757,500	1,980.18	1,499,990,000	2,006.50	1,519,923,750	3.66
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	93,700	13,405.05	1,256,053,500	13,140.00	1,231,218,000	2.96
日本	株式	キーエンス	電気機器	13,500	66,760.00	901,260,000	68,510.00	924,885,000	2.23
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	110,200	7,401.99	815,700,000	7,572.00	834,434,400	2.01
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	945,900	640.20	605,565,180	622.50	588,822,750	1.42
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	171,600	3,266.43	560,519,600	3,188.00	547,060,800	1.32
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	88,000	6,500.00	572,000,000	6,164.00	542,432,000	1.31
日本	株式	信越化学工業	化学	25,100	19,480.00	488,948,000	20,255.00	508,400,500	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,500	51,406.00	488,357,000	52,850.00	502,075,000	1.21
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	29,200	17,275.47	504,444,000	16,725.00	488,370,000	1.18
日本	株式	日本電産	電気機器	38,800	12,574.02	487,872,000	12,570.00	487,716,000	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,100	25,584.16	488,657,500	24,890.00	475,399,000	1.14
日本	株式	日立製作所	電気機器	71,900	6,773.78	487,035,000	6,554.00	471,232,600	1.13
日本	株式	任天堂	その他製品	8,400	49,150.00	412,860,000	50,200.00	421,680,000	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	110,400	3,615.47	399,148,800	3,612.00	398,764,800	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	117,800	3,410.55	401,763,000	3,349.00	394,512,200	0.95
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	102,100	3,808.47	388,844,900	3,721.00	379,914,100	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	43,900	8,536.38	374,747,200	8,653.00	379,866,700	0.91
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	107,000	3,680.00	393,760,000	3,528.00	377,496,000	0.91

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	117,500	3,184.00	374,120,000	3,203.00	376,352,500	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	222,300	1,540.36	342,424,050	1,554.50	345,565,350	0.83
日本	株式	第一三共	医薬品	117,500	2,854.68	335,425,100	2,867.00	336,872,500	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	101,000	3,232.69	326,501,800	3,242.00	327,442,000	0.79
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,900	18,002.54	304,243,000	17,940.00	303,186,000	0.73
日本	株式	ＳＭＣ	機械	4,400	68,720.00	302,368,000	67,940.00	298,936,000	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	114,400	2,617.54	299,447,700	2,592.00	296,524,800	0.71
日本	株式	ファナック	電気機器	13,100	24,542.36	321,505,000	22,310.00	292,261,000	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,600	6,017.81	292,465,800	5,998.00	291,502,800	0.70
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	188,600	1,521.00	286,860,600	1,505.00	283,843,000	0.68
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,600	4,798.80	276,411,300	4,782.00	275,443,200	0.66

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	0.21
		建設業	2.27
		食料品	3.36
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.86
		医薬品	4.86
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.79
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.61
		機械	5.36
		電気機器	18.47
		輸送用機器	7.88
		精密機器	2.83
		その他製品	2.14
		電気・ガス業	1.04
		陸運業	3.09
		海運業	0.45
		空運業	0.42
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.31
		卸売業	4.99
		小売業	4.30

		銀行業	4.60
		証券、商品先物取引業	0.74
		保険業	1.94
		その他金融業	1.14
		不動産業	1.97
		サービス業	6.50
合　　計			98.65

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１２月	買建	31	日本円	625,374,950	617,675,000	1.49

(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10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	172,890,055,915	67.54
	カナダ	9,098,627,545	3.55
	ドイツ	6,876,384,988	2.69
	イタリア	1,421,317,540	0.56
	フランス	7,970,694,906	3.11
	オランダ	5,008,404,403	1.96
	スペイン	1,863,978,934	0.73
	ベルギー	637,330,730	0.25
	オーストリア	167,053,800	0.07
	ルクセンブルク	238,378,111	0.09
	フィンランド	965,670,859	0.38
	アイルランド	4,881,657,149	1.91
	ポルトガル	123,860,988	0.05
	イギリス	10,343,808,154	4.04
	スイス	8,414,307,252	3.29
	スウェーデン	2,737,662,790	1.07

	ノルウェー	510,133,492	0.20
	デンマーク	2,089,232,816	0.82
	ケイマン	439,563,313	0.17
	オーストラリア	4,892,274,072	1.91
	バミューダ	382,687,213	0.15
	ニュージーランド	259,510,857	0.10
	パプアニューギニア	29,158,183	0.01
	香港	1,815,668,933	0.71
	シンガポール	704,718,317	0.28
	イスラエル	563,545,778	0.22
	ジャージー	808,084,687	0.32
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	69,090,157	0.03
	小計	246,202,861,882	96.19
投資証券	アメリカ	4,987,758,362	1.95
	カナダ	15,524,838	0.01
	フランス	113,875,578	0.04
	イギリス	150,356,216	0.06
	オーストラリア	367,341,766	0.14
	香港	88,907,875	0.03
	シンガポール	105,277,028	0.04
	小計	5,829,041,663	2.28
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	3,931,060,940	1.54
合計（純資産総額）		255,962,964,485	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	3,650,227,875	1.43
	買建	ドイツ	680,685,236	0.27

(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	—	2,394,633,780	0.94

(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	645,658	16,895.90	10,908,978,684	17,342.63	11,197,409,027	4.37
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	276,814	35,025.13	9,695,448,302	36,868.86	10,205,817,858	3.99
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,560	377,426.45	6,627,608,601	391,771.61	6,879,509,505	2.69
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	31,675	116,495.83	3,690,005,612	122,427.13	3,877,879,558	1.52
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,640	312,472.00	3,637,174,194	331,573.11	3,859,511,077	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,262	315,486.53	3,553,009,393	332,209.66	3,741,345,288	1.46
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	92,680	37,362.19	3,462,727,982	36,024.29	3,338,731,790	1.30
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	96,460	26,332.79	2,540,061,135	28,350.43	2,734,682,931	1.07
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	117,050	19,430.74	2,274,369,264	19,364.82	2,266,652,321	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	36,435	51,093.52	1,861,592,704	51,769.86	1,886,235,024	0.74
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	101,791	18,650.97	1,898,501,254	18,511.15	1,884,269,437	0.74
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	41,080	42,201.12	1,733,622,182	42,236.36	1,735,069,747	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	51,255	32,993.85	1,691,099,997	32,932.47	1,687,953,873	0.66
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	111,133	14,568.46	1,619,037,110	14,957.62	1,662,285,361	0.65
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	298,319	5,400.46	1,611,060,333	5,431.15	1,620,216,012	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	65,352	26,585.13	1,737,392,044	23,852.51	1,558,809,417	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	94,689	16,010.41	1,516,010,613	16,218.43	1,535,707,449	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,252	91,027.11	1,479,372,624	92,726.56	1,506,992,183	0.59
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	70,322	19,552.37	1,374,962,234	19,287.52	1,356,337,375	0.53
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,484	73,541.07	1,359,333,321	72,666.95	1,343,176,044	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	17,155	76,347.59	1,309,742,944	76,619.26	1,314,403,465	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	34,155	41,018.95	1,401,002,449	37,855.52	1,292,955,289	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	37,556	33,409.88	1,254,741,693	33,916.85	1,273,781,391	0.50
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	27,173	44,559.79	1,210,823,242	44,503.66	1,209,298,062	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	163,831	7,314.66	1,198,368,800	7,310.11	1,197,623,893	0.47
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	43,157	28,062.84	1,211,108,400	26,920.46	1,161,806,555	0.45

アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,209	69,082.94	1,050,682,472	70,483.35	1,071,981,375	0.42
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	216,590	4,904.86	1,062,343,735	4,908.27	1,063,082,329	0.42
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	177,664	6,147.27	1,092,149,217	5,899.47	1,048,123,971	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	162,890	6,267.76	1,020,956,045	6,392.80	1,041,323,322	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	3.43
		素材	4.00
		資本財	6.05
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.98
		自動車・自動車部品	2.47
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.81
		メディア・娯楽	7.15
		小売	5.58
		食品・生活必需品小売り	1.38
		食品・飲料・タバコ	3.63
		家庭用品・パーソナル用品	1.62
		ヘルスケア機器・サービス	5.05
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.30
		銀行	6.18
		各種金融	4.73
		保険	3.00
		不動産	0.36
		ソフトウェア・サービス	12.46
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.89
		電気通信サービス	1.46
		公益事業	2.77
		半導体・半導体製造装置	4.73
投資証券	―	―	2.28
合　　計			98.46

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 EMINI2112	買建	140	米ドル	31,924,875	3,628,900,541	32,112,500	3,650,227,875	1.43
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2112	買建	140	ユーロ	5,094,970	676,459,167	5,126,800	680,685,236	0.27

(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	17,100,000.00	1,946,179,640	1,943,006,090	0.76
	ユーロ	買建	3,400,000.00	449,568,480	451,627,690	0.18

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2021年10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	11,839,717,671	66.66
	カナダ	624,641,801	3.52
	ドイツ	471,392,805	2.65
	イタリア	96,749,130	0.54
	フランス	544,719,842	3.07
	オランダ	346,722,717	1.95
	スペイン	130,336,677	0.73
	ベルギー	41,235,171	0.23
	オーストリア	11,533,326	0.06
	ルクセンブルク	14,068,571	0.08
	フィンランド	64,855,412	0.37
	アイルランド	334,770,271	1.88
	ポルトガル	5,746,761	0.03
	イギリス	707,079,282	3.98
	スイス	580,126,651	3.27
	スウェーデン	188,845,065	1.06
	ノルウェー	35,376,232	0.20

	デンマーク	143,763,555	0.81
	ケイマン	31,933,188	0.18
	オーストラリア	334,770,394	1.88
	バミューダ	28,506,040	0.16
	ニュージーランド	14,505,318	0.08
	パプアニューギニア	2,214,236	0.01
	香港	120,931,005	0.68
	シンガポール	46,746,525	0.26
	イスラエル	35,670,725	0.20
	ジャージー	54,856,750	0.31
	マン島	5,349,644	0.03
	小計	16,857,164,765	94.91
投資証券	アメリカ	345,380,219	1.94
	フランス	6,970,046	0.04
	イギリス	11,200,296	0.06
	オーストラリア	24,715,756	0.14
	香港	6,063,009	0.03
	シンガポール	5,785,796	0.03
	小計	400,115,122	2.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	503,691,359	2.84
合計（純資産総額）		17,760,971,246	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	443,241,956	2.50
	買建	ドイツ	82,654,635	0.47

(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	売建	—	17,678,691,566	△99.54

(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	44,278	16,895.90	748,117,050	17,342.63	767,897,055	4.32
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,988	35,025.13	665,057,303	36,868.86	700,065,999	3.94
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,205	377,426.45	454,798,881	391,771.61	472,084,792	2.66
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	2,174	116,495.83	253,261,947	122,427.13	266,156,595	1.50
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	794	312,472.01	248,102,776	331,573.11	263,269,055	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	778	315,486.53	245,448,527	332,209.66	258,459,122	1.46
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	6,361	37,362.19	237,660,905	36,024.29	229,150,549	1.29
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,630	26,332.79	174,586,412	28,350.43	187,963,382	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,991	19,430.74	155,271,121	19,364.82	154,744,286	0.87
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	7,016	18,650.97	130,855,231	18,511.15	129,874,295	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,499	51,093.52	127,682,727	51,769.86	129,372,892	0.73
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	2,833	42,201.12	119,555,785	42,236.36	119,655,613	0.67
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	3,531	32,993.85	116,501,299	32,932.47	116,284,560	0.65
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	7,638	14,568.46	111,273,928	14,957.62	114,246,314	0.64
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	20,367	5,400.46	109,991,203	5,431.15	110,616,285	0.62
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	4,497	26,585.13	119,553,373	23,852.51	107,264,750	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,531	16,010.41	104,564,050	16,218.43	105,922,603	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,111	91,027.11	101,131,121	92,726.56	103,019,217	0.58
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	4,831	19,552.37	94,457,532	19,287.52	93,178,036	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,269	73,541.07	93,323,630	72,666.95	92,214,369	0.52
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	2,355	41,018.95	96,599,642	37,855.52	89,149,750	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	1,162	76,347.59	88,715,902	76,619.26	89,031,584	0.50
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	2,551	33,409.88	85,228,620	33,916.85	86,521,896	0.49
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	1,845	44,559.79	82,212,817	44,503.66	82,109,260	0.46
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,227	7,314.66	82,121,738	7,310.11	82,070,691	0.46
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	2,961	28,062.84	83,094,098	26,920.46	79,711,500	0.45

アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,911	4,904.86	73,136,375	4,908.27	73,187,223	0.41
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,035	69,082.94	71,500,845	70,483.35	72,950,274	0.41
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	12,180	6,147.27	74,873,792	5,899.47	71,855,581	0.40
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	11,212	6,267.76	70,274,168	6,392.80	71,676,083	0.40

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	3.38
		素材	3.96
		資本財	5.99
		商業・専門サービス	1.24
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	2.43
		耐久消費財・アパレル	1.87
		消費者サービス	1.77
		メディア・娯楽	7.08
		小売	5.52
		食品・生活必需品小売り	1.34
		食品・飲料・タバコ	3.59
		家庭用品・パーソナル用品	1.61
		ヘルスケア機器・サービス	5.01
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.19
		銀行	6.15
		各種金融	4.62
		保険	2.93
		不動産	0.35
		ソフトウェア・サービス	12.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.84
		電気通信サービス	1.41
		公益事業	2.75
		半導体・半導体製造装置	4.65
投資証券	—	—	2.25
合　　計			97.16

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

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 EMINI2112	買建	17	米ドル	3,878,725	440,894,670	3,899,375	443,241,956	2.50
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2112	買建	17	ユーロ	618,370	82,100,984	622,540	82,654,635	0.47

(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	売建	114,002,000.00	12,970,264,260	12,949,314,944	△72.91
	加ドル	売建	6,717,000.00	617,134,999	617,304,349	△3.48
	ユーロ	売建	13,763,000.00	1,818,902,863	1,828,218,690	△10.29
	英ポンド	売建	4,950,000.00	774,892,657	775,708,368	△4.37
	スイスフラン	売建	4,166,000.00	515,628,506	520,025,875	△2.93
	スウェーデンクローナ	売建	15,081,000.00	199,521,630	201,331,350	△1.13
	ノルウェークローネ	売建	2,633,000.00	35,852,835	35,833,430	△0.20
	デンマーククローネ	売建	8,025,000.00	142,559,187	143,307,462	△0.81
	豪ドル	売建	4,410,000.00	376,188,313	377,264,730	△2.12
	ニュージーランドドル	売建	136,000.00	11,080,465	11,083,434	△0.06
	香港ドル	売建	10,113,000.00	148,022,037	147,739,070	△0.83
	シンガポールドル	売建	634,000.00	53,524,336	53,529,166	△0.30
	イスラエルシュケル	売建	502,000.00	17,853,447	18,030,698	△0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2021年10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	37,013,080,424	75.72
地方債証券	日本	4,809,628,775	9.84
特殊債券	日本	5,297,884,490	10.84
社債券	日本	1,617,842,190	3.31
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	140,005,957	0.29
合計（純資産総額）		48,878,441,836	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）	720,000,000	100.69	724,975,200	100.77	725,558,400	0.100	2029/12/20	1.48
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	101.60	711,214,000	101.63	711,473,000	0.300	2025/12/20	1.46
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	690,000,000	100.89	696,161,700	100.94	696,520,500	0.100	2027/3/20	1.43
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	680,000,000	100.89	686,099,600	100.96	686,528,000	0.100	2028/3/20	1.40
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	660,000,000	100.62	664,144,800	100.75	664,969,800	0.100	2030/3/20	1.36
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	610,000,000	100.85	615,197,200	100.90	615,496,100	0.100	2026/12/20	1.26
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	590,000,000	100.92	595,457,500	100.98	595,811,500	0.100	2027/12/20	1.22
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	590,000,000	100.86	595,091,700	100.93	595,492,900	0.100	2028/9/20	1.22
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	550,000,000	100.56	553,080,000	100.68	553,789,500	0.100	2030/6/20	1.13
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	535,000,000	100.86	539,627,750	100.96	540,157,400	0.100	2028/6/20	1.11
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	490,000,000	101.72	498,472,100	101.73	498,501,500	0.500	2024/9/20	1.02
日本	国債証券	第１４４回利付国債（２０年）	430,000,000	115.12	495,033,200	115.10	494,955,800	1.500	2033/3/20	1.01
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	420,000,000	101.91	428,051,400	101.95	428,190,000	0.400	2025/9/20	0.88
日本	国債証券	第１４０回利付国債（２０年）	358,000,000	116.87	418,398,180	116.85	418,323,000	1.700	2032/9/20	0.86
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	355,000,000	117.60	417,504,850	117.65	417,671,700	1.700	2033/6/20	0.85
日本	国債証券	第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	117.38	402,620,260	117.50	403,028,430	2.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	390,000,000	101.65	396,438,900	101.67	396,544,200	0.400	2025/3/20	0.81
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	370,000,000	101.77	376,563,800	101.80	376,674,800	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	116.49	337,835,500	116.60	338,151,600	2.100	2029/9/20	0.69
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	300,000,000	112.60	337,812,000	112.66	337,992,000	1.200	2035/3/20	0.69
日本	国債証券	第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	111.04	333,144,000	111.09	333,279,000	2.300	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	325,000,000	100.81	327,642,250	100.92	328,003,000	0.100	2029/3/20	0.67
日本	国債証券	第１５３回利付国債（２０年）	270,000,000	114.08	308,021,400	114.14	308,186,100	1.300	2035/6/20	0.63
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	300,000,000	100.82	302,466,000	100.92	302,787,000	0.100	2028/12/20	0.62
日本	国債証券	第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	101.72	300,100,550	101.70	300,041,550	1.400	2022/12/20	0.61

日本	国債証券	第１５５回利付国債（２０年）	270,000,000	110.17	297,467,100	110.23	297,642,600	1.000	2035/12/20	0.61
日本	国債証券	第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	111.64	279,122,500	111.69	279,247,500	2.300	2026/9/20	0.57
日本	国債証券	第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	115.49	265,643,100	115.53	265,737,400	1.600	2032/6/20	0.54
日本	国債証券	第１６４回利付国債（２０年）	255,000,000	102.24	260,727,300	102.32	260,923,650	0.500	2038/3/20	0.53
日本	国債証券	第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	115.25	253,556,600	115.29	253,642,400	1.600	2032/3/20	0.52

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.72
地方債証券	9.84
特殊債券	10.84
社債券	3.31
合　　計	99.71

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10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	73,748,830,710	45.96
	カナダ	3,143,681,885	1.96
	メキシコ	1,110,911,598	0.69
	ドイツ	11,790,070,552	7.35
	イタリア	14,679,003,385	9.15
	フランス	16,306,488,909	10.16
	オランダ	2,990,750,392	1.86
	スペイン	9,546,105,960	5.95
	ベルギー	3,627,266,799	2.26
	オーストリア	2,357,412,633	1.47
	フィンランド	963,899,316	0.60

	アイルランド	1,312,786,323	0.82
	イギリス	9,877,608,271	6.16
	スウェーデン	489,691,722	0.31
	ノルウェー	408,399,235	0.25
	デンマーク	816,606,894	0.51
	ポーランド	837,472,602	0.52
	オーストラリア	2,896,694,445	1.81
	シンガポール	669,864,486	0.42
	マレーシア	771,420,463	0.48
	イスラエル	735,736,866	0.46
	小計	159,080,703,446	99.15
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,370,723,565	0.85
合計（純資産総額）		160,451,427,011	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	—	107,983,595	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。

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	8,400,000	10,903.43	915,888,920	10,965.60	921,110,636	1.125	2031/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,367.13	909,370,458	11,366.68	909,334,629	0.125	2022/10/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,313.27	905,061,855	11,306.39	904,511,265	0.250	2023/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,480,000	11,382.98	851,447,222	11,448.70	856,362,782	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,312.16	791,851,417	11,307.05	791,493,977	0.125	2023/7/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	12,002.61	732,159,745	11,996.62	731,794,122	2.375	2026/4/30	0.46
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	22,837.39	693,114,966	23,000.79	698,074,157	4.500	2041/4/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	10,688.53	653,069,316	10,742.48	656,365,588	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,795.48	625,160,571	11,787.26	624,725,180	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,415.56	613,328,678	12,424.88	613,789,356	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	11,927.13	613,054,743	11,923.36	612,860,767	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,814.35	593,080,511	11,804.80	592,601,302	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,254.82	575,976,731	12,246.16	575,569,794	3.000	2025/9/30	0.36
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,692,000	20,905.04	562,763,750	21,345.99	574,634,100	2.500	2046/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,870,000	11,802.58	574,785,980	11,796.81	574,504,875	2.000	2025/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	12,639.34	570,034,598	12,656.22	570,795,578	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,856.53	569,113,717	11,848.76	568,740,734	2.125	2025/5/15	0.35

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	13,514.07	554,077,080	13,831.55	567,093,633	3.000	2048/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,274.64	563,732,156	11,268.20	563,410,237	0.250	2024/3/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,264.87	563,243,728	11,259.99	562,999,519	0.375	2024/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,621.42	562,476,984	11,619.20	562,369,537	1.625	2026/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,037.09	551,854,528	11,031.31	551,565,914	0.375	2026/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,898.49	549,710,510	11,890.72	549,351,514	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,933.18	546,659,457	10,944.95	547,247,784	0.750	2028/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,540,000	21,299.44	541,005,811	21,331.08	541,809,444	5.750	2032/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,813.30	540,665,137	10,824.18	541,209,065	0.500	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	10,479.84	533,423,912	10,536.01	536,282,914	0.625	2030/8/15	0.33
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,560,000	14,983.05	533,396,746	15,006.02	534,214,449	1.500	2031/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	12,045.02	529,981,028	12,037.25	529,639,127	2.625	2025/3/31	0.33
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,630,000	14,590.37	529,630,580	14,571.92	528,960,758	4.250	2023/10/25	0.33

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.15
合　　計	99.15

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	950,000.00	108,122,500	107,983,595	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。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2021年10月29日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	11,728,091,926	46.18
	カナダ	486,713,427	1.92
	メキシコ	190,288,136	0.75
	ドイツ	1,676,716,667	6.60
	イタリア	2,234,514,867	8.80
	フランス	2,583,270,042	10.17

	オランダ	527,176,575	2.08
	スペイン	1,501,826,534	5.91
	ベルギー	620,988,124	2.45
	オーストリア	430,695,428	1.70
	フィンランド	134,140,865	0.53
	アイルランド	231,707,909	0.91
	イギリス	1,560,370,521	6.14
	スウェーデン	124,104,752	0.49
	ノルウェー	71,219,746	0.28
	デンマーク	82,350,241	0.32
	ポーランド	152,539,705	0.60
	オーストラリア	454,993,262	1.79
	シンガポール	106,087,925	0.42
	マレーシア	247,217,460	0.97
	イスラエル	103,401,645	0.41
	小計	25,248,415,757	99.42
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	146,287,872	0.58
合計（純資産総額）		25,394,703,629	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	売建	—	25,627,841,433	△100.92

(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	4,000,000	11,818.57	472,742,845	11,819.90	472,796,133	2.000	2026/11/15	1.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,830,000	11,898.49	455,712,393	11,890.72	455,414,783	2.375	2024/8/15	1.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	11,878.73	451,391,993	11,871.63	451,122,027	2.250	2024/11/15	1.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,550,000	11,617.87	412,434,494	11,611.87	412,221,673	1.750	2023/5/15	1.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,900,000	11,963.76	346,949,258	11,973.09	347,219,664	2.250	2027/11/15	1.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,750,000	11,713.33	322,116,787	11,980.19	329,455,396	2.250	2046/8/15	1.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,813.30	324,399,082	10,824.18	324,725,439	0.500	2027/10/31	1.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	9,298.51	288,254,020	9,569.37	296,650,504	1.250	2050/5/15	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	10,688.53	288,590,369	10,742.48	290,046,986	0.875	2030/11/15	1.14
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,770.39	282,489,464	11,761.29	282,271,027	2.000	2024/6/30	1.11
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,621.42	278,914,206	11,619.20	278,860,927	1.625	2026/5/15	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,564.14	277,539,500	11,558.81	277,411,635	1.500	2023/3/31	1.09

フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,300,000	21,299.44	276,892,738	21,331.08	277,304,046	5.750	2032/10/25	1.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	11,814.35	271,730,115	11,804.80	271,510,557	2.000	2025/8/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,927.13	238,542,701	11,923.36	238,467,224	2.250	2025/11/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	11,795.48	235,909,650	11,787.26	235,745,351	2.500	2023/8/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	12,873.12	199,533,476	13,171.06	204,151,535	2.750	2047/8/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	11,802.58	194,742,683	11,796.81	194,647,442	2.000	2025/2/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,432.65	186,489,844	12,447.30	186,709,625	2.875	2028/8/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,631.85	186,109,745	11,625.86	186,013,844	1.625	2026/2/15	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	11,585.23	185,363,797	11,581.68	185,306,962	1.750	2023/1/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,856.53	177,848,036	11,848.76	177,731,479	2.125	2025/5/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	9,591.12	172,640,308	9,864.64	177,563,640	1.375	2050/8/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,676.04	175,140,605	11,669.60	175,044,014	2.375	2023/1/31	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	12,230.62	171,228,748	12,469.95	174,579,351	2.500	2045/2/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	11,894.94	171,287,189	11,886.72	171,168,894	2.750	2023/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,350,000	12,257.71	165,479,087	12,521.01	169,033,723	2.500	2046/2/15	0.67
イギリス	国債証券	UK TREASURY	560,000	28,333.12	158,665,507	30,160.63	168,899,566	4.250	2055/12/7	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,067.95	166,019,253	11,058.84	165,882,715	0.375	2025/11/30	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	11,625.19	162,752,788	11,620.98	162,693,732	2.125	2022/12/31	0.64

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.42
合　　計	99.42

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	売建	104,761,000.00	11,920,494,041	11,899,638,887	△46.86
	加ドル	売建	5,366,000.00	493,012,625	493,129,237	△1.94
	メキシコペソ	売建	35,233,000.00	196,681,794	194,357,742	△0.77
	ユーロ	売建	75,940,000.00	10,035,514,216	10,087,113,450	△39.72
	英ポンド	売建	10,031,000.00	1,570,387,723	1,571,935,168	△6.19
	スウェーデンクローナ	売建	9,438,000.00	124,867,820	125,997,269	△0.50
	ノルウェークローネ	売建	5,342,000.00	72,740,055	72,680,859	△0.29
	デンマーククローネ	売建	4,724,000.00	83,942,485	84,381,968	△0.33
	ポーランドズロチ	売建	5,486,000.00	156,876,351	157,239,500	△0.62
	豪ドル	売建	5,352,000.00	456,506,477	457,763,727	△1.80
	シンガポールドル	売建	1,269,000.00	107,145,021	107,155,405	△0.42
	マレーシアリンギット	売建	9,796,000.00	267,948,028	267,785,415	△1.05

	イスラエルシュケル	売建	3,025,000.00	107,582,518	108,662,806	△0.43

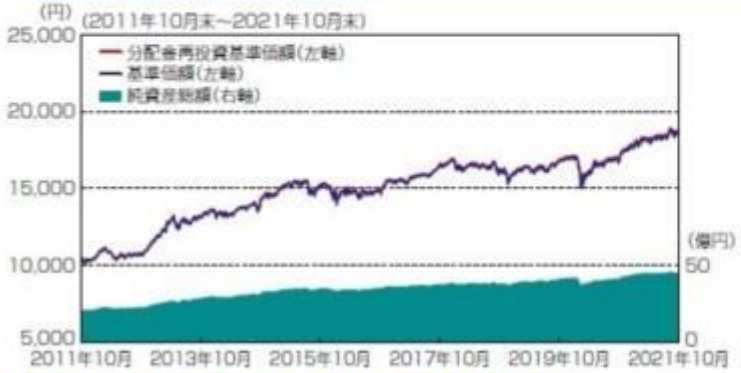
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2021年10月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……18,610円
純資産総額……45.36億円

※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10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して計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年10月	2018年10月	2019年10月	2020年10月	2021年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	170円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比　率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	29.67%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.11%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5.09%
日本債券インデックスマザーファンド	45.11%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.04%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5.01%
現金その他	4.97%

※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産		銘　柄	業　種　・　種　類	比　率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.66%
	2	ソニーグループ	電気機器	2.96%
	3	キーエンス	電気機器	2.23%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.37%
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.99%
	3	AMAZON.COM INC	小売	2.69%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.32%
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.94%
	3	AMAZON.COM INC	小売	2.66%
日本債券インデックスマザーファンド	1	第357回利付国債(10年)	国債証券	1.48%
	2	第341回利付国債(10年)	国債証券	1.46%
	3	第346回利付国債(10年)	国債証券	1.43%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1	US TREASURY N/B(クーポン1.125%)	国債証券	0.57%
	2	US TREASURY N/B(クーポン0.125%)	国債証券	0.57%
	3	US TREASURY N/B(クーポン0.250%)	国債証券	0.56%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1	US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	1.86%
	2	US TREASURY N/B(クーポン2.375%)	国債証券	1.79%
	3	US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	1.78%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

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。なお、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、当該規定に従うものとします。

（２）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。

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

（４）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、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。

（５）申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、１円以上１円単位とします。

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

（７）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。

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

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

（４）解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額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。

（５）手取額
１口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。
※確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関でない場合、解約価額から解約に係る所定の税金が差し引かれます。
※税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、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。

（６）解約単位
１口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

（７）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。

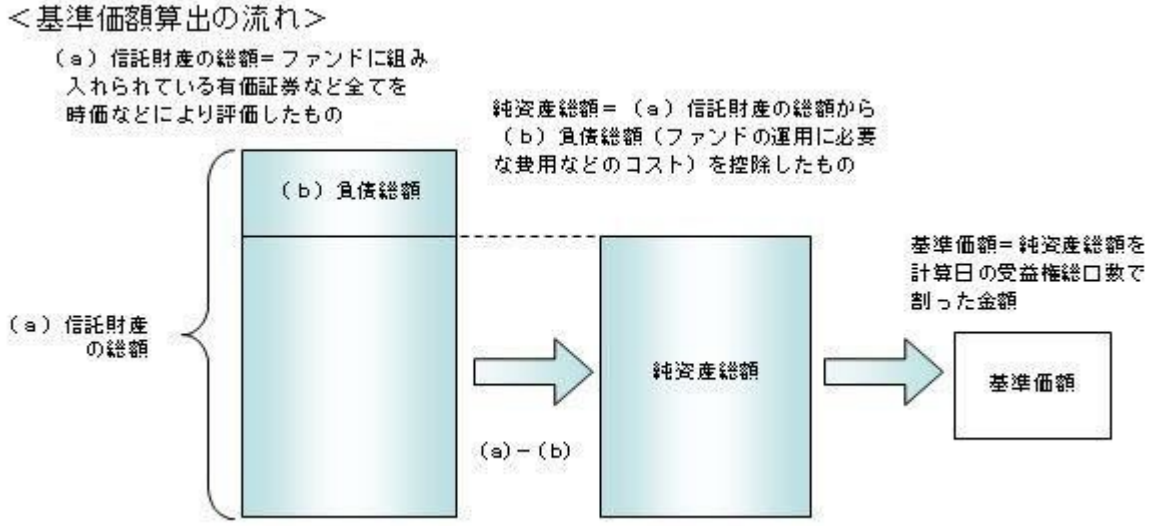
（８）受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

③　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（2001年10月17日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年10月27日から翌年10月26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】

①　信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、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。
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ないません。
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。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその

公告および書面の交付が困難な場合

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

5）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 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。

③ 信託約款の変更

1）委託会社は、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ないません。

3）この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

4）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

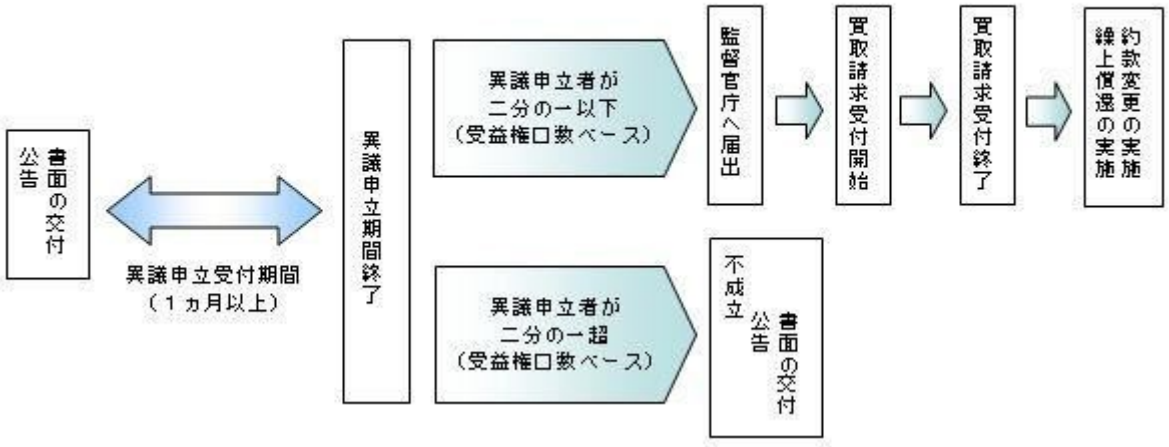
④ 異議の申立て

1）繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

2）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、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ないません。

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＞



⑤ 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れ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/

⑦　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年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。**

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間（2020年10月27日から2021年10月26日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 2020年10月26日現在	第20期 2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	218,626,706	240,963,691
親投資信託受益証券	3,911,688,421	4,318,650,635
未収入金	2,678,174	610,084
流動資産合計	4,132,993,301	4,560,224,410
資産合計	4,132,993,301	4,560,224,410
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,442,983	2,438,244
未払解約金	3,771,265	1,292,812
未払受託者報酬	883,990	996,927
未払委託者報酬	12,597,746	14,207,138
未払利息	61	96
その他未払費用	88,342	99,640
流動負債合計	19,784,387	19,034,857
負債合計	19,784,387	19,034,857
純資産の部		
元本等		
元本	2,442,983,188	2,438,244,210
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,670,225,726	2,102,945,343
（分配準備積立金）	777,814,308	1,090,516,684
元本等合計	4,113,208,914	4,541,189,553
純資産合計	4,113,208,914	4,541,189,553
負債純資産合計	4,132,993,301	4,560,224,410

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自　2019年10月29日 至　2020年10月26日	第20期 自　2020年10月27日 至　2021年10月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	64,297,206	472,333,573
営業収益合計	64,297,206	472,333,573
営業費用		
支払利息	57,665	29,051
受託者報酬	1,772,959	1,956,406
委託者報酬	25,266,339	27,880,573
その他費用	177,569	195,532
営業費用合計	27,274,532	30,061,562
営業利益又は営業損失（△）	37,022,674	442,272,011
経常利益又は経常損失（△）	37,022,674	442,272,011
当期純利益又は当期純損失（△）	37,022,674	442,272,011
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（△）	△9,459,988	37,135,339
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,637,256,237	1,670,225,726
剰余金増加額又は欠損金減少額	201,080,074	239,214,940
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	201,080,074	239,214,940
剰余金減少額又は欠損金増加額	212,150,264	209,193,751
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	212,150,264	209,193,751
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	2,442,983	2,438,244
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,670,225,726	2,102,945,343

（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）

		第19期 2020年10月26日現在	第20期 2021年10月26日現在
１．	期首元本額	2,454,840,024円	2,442,983,188円
	期中追加設定元本額	307,946,853円	299,470,215円
	期中一部解約元本額	319,803,689円	304,209,193円
２．	受益権の総数	2,442,983,188口	2,438,244,210口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第19期 自 2019年10月29日 至 2020年10月26日		第20期 自 2020年10月27日 至 2021年10月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	40,018,873円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	57,631,654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	347,102,898円
C 信託約款に定める収益調整金	1,168,276,339円	C 信託約款に定める収益調整金	1,255,251,203円
D 信託約款に定める分配準備積立金	740,238,418円	D 信託約款に定める分配準備積立金	688,220,376円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	1,948,533,630円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	2,348,206,131円
F 分配対象収益(1万口当たり)	7,976円	F 分配対象収益(1万口当たり)	9,630円
G 分配金額	2,442,983円	G 分配金額	2,438,244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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第19期 自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	第20期 自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第19期 2020年10月26日現在	第20期 2021年10月26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）

第19期（2020年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額

親投資信託受益証券	81,627,314
合計	81,627,314

第20期（2021年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	403,097,249
合計	403,097,249

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第19期 2020年10月26日現在		第20期 2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6837円	1口当たり純資産額	1.8625円
(1万口当たり純資産額)	(16,837円)	(1万口当たり純資産額)	(18,625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	57,058,720	234,950,691	
	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	90,331,157	232,584,663	

	日本債券インデックスマザーファンド	1,449,114,415	2,043,251,325	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	88,314,261	227,992,096	
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	140,965,478	225,615,247	
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	691,194,107	1,354,256,613	
合計		2,516,978,138	4,318,650,635	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	114,776,019	386,683,019
株式	33,489,436,240	41,021,026,450
派生商品評価勘定	445,600	1,881,150
未収配当金	292,763,801	338,895,356
前払金	2,115,000	16,455,000
流動資産合計	33,899,536,660	41,764,940,975
資産合計	33,899,536,660	41,764,940,975
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,333,250	9,546,500

未払解約金	28,402,432	3,366,714
未払利息	32	154
流動負債合計	31,735,714	12,913,368
負債合計	31,735,714	12,913,368
純資産の部		
元本等		
元本	22,017,538,384	21,309,131,563
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	11,850,262,562	20,442,896,044
元本等合計	33,867,800,946	41,752,027,607
純資産合計	33,867,800,946	41,752,027,607
負債純資産合計	33,899,536,660	41,764,940,975

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
1．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	21,582,031,788円	22,017,538,384円
	期首からの追加設定元本額	5,024,902,333円	2,456,144,995円
	期首からの一部解約元本額	4,589,395,737円	3,164,551,816円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	694,622,832円	700,290,293円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	1,780,001,539円	1,832,450,915円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	3,373,731,467円	3,596,095,059円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	3,455,337,100円	3,970,867,945円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,361,389,089円	1,406,433,104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	3,267,569,917円	3,083,752,587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）	734,514,070円	636,617,068円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	49,415,304円	43,960,093円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	41,038,145円	38,865,552円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	58,523,187円	46,430,665円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	53,449,514円	40,636,155円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,758,810,767円	2,907,194,622円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	292,909,234円	243,584,625円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	799,731,646円	691,194,107円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,179,083,972円	1,045,621,245円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	1,117,410,601円	1,025,137,528円
	計	22,017,538,384円	21,309,131,563円
２．	受益権の総数	22,017,538,384口	21,309,131,563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	369,625,000円	630,570,000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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年10月26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10月26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	111,722,397
合計	111,722,397

（2021年10月26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	7,556,941,566
合計	7,556,941,566

(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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	375,130,000	－	372,255,000	△2,875,000
合計		375,130,000	－	372,255,000	△2,875,000

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	755,415,000	－	747,770,000	△7,645,000
合計		755,415,000	－	747,770,000	△7,645,000

（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10月26日現在		2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.5382円	1口当たり純資産額	1.9593円
(1万口当たり純資産額)	(15,382円)	(1万口当たり純資産額)	(19,593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	2,992.00	2,094,400	
日本水産	18,700	655.00	12,248,500	
マルハニチロ	3,100	2,590.00	8,029,000	
雪国まいたけ	1,600	1,444.00	2,310,400	
カネコ種苗	600	1,459.00	875,400	
サカタのタネ	2,400	3,400.00	8,160,000	
ホクト	1,700	1,939.00	3,296,300	
ホクリヨウ	300	752.00	225,600	
住石ホールディングス	3,400	161.00	547,400	
日鉄鉱業	500	6,990.00	3,495,000	
三井松島ホールディングス	800	1,736.00	1,388,800	
ＩＮＰＥＸ	80,700	987.00	79,650,900	
石油資源開発	2,600	2,183.00	5,675,800	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	900	1,674.00	1,506,600	
ヒノキヤグループ	500	2,264.00	1,132,000	
ショーボンドホールディングス	2,900	4,650.00	13,485,000	
ミライト・ホールディングス	7,000	2,223.00	15,561,000	
サンヨーホームズ	300	728.00	218,400	
日本アクア	900	565.00	508,500	
ファーストコーポレーション	700	807.00	564,900	
ベステラ	400	1,497.00	598,800	

キャンディル	500	520.00	260,000	
スペースバリューホールディングス	2,500	809.00	2,022,500	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,897.00	758,800	
第一カッター興業	600	1,255.00	753,000	
安藤・間	13,000	775.00	10,075,000	
東急建設	5,900	817.00	4,820,300	
コムシスホールディングス	7,100	2,885.00	20,483,500	
ビーアールホールディングス	2,800	425.00	1,190,000	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,002.00	2,602,600	
東建コーポレーション	600	9,450.00	5,670,000	
ソネック	300	1,072.00	321,600	
ヤマウラ	1,000	917.00	917,000	
オリエンタル白石	7,100	274.00	1,945,400	
大成建設	14,500	3,655.00	52,997,500	
大林組	46,500	973.00	45,244,500	
清水建設	43,600	851.00	37,103,600	
飛島建設	1,400	1,078.00	1,509,200	
長谷工コーポレーション	15,200	1,504.00	22,860,800	
松井建設	1,900	760.00	1,444,000	
錢高組	200	4,050.00	810,000	
鹿島建設	34,100	1,437.00	49,001,700	
不動テトラ	1,200	1,827.00	2,192,400	
大末建設	700	876.00	613,200	
鉄建建設	1,000	1,815.00	1,815,000	
西松建設	3,300	3,250.00	10,725,000	
三井住友建設	11,300	491.00	5,548,300	
大豊建設	1,000	3,875.00	3,875,000	
ナカノフドー建設	1,300	351.00	456,300	
奥村組	2,600	2,955.00	7,683,000	
東鉄工業	2,000	2,505.00	5,010,000	
イチケン	400	1,930.00	772,000	
富士ピー・エス	700	552.00	386,400	
淺沼組	600	4,545.00	2,727,000	
戸田建設	19,300	736.00	14,204,800	
熊谷組	2,200	2,804.00	6,168,800	
北野建設	300	2,164.00	649,200	

植木組	500	1,462.00	731,000	
矢作建設工業	2,100	777.00	1,631,700	
ピーエス三菱	1,600	663.00	1,060,800	
日本ハウスホールディングス	3,300	402.00	1,326,600	
大東建託	5,100	13,610.00	69,411,000	
新日本建設	2,100	837.00	1,757,700	
ＮＩＰＰＯ	3,900	4,035.00	15,736,500	
東亜道路工業	300	5,050.00	1,515,000	
日本道路	500	8,330.00	4,165,000	
東亜建設工業	1,300	2,487.00	3,233,100	
日本国土開発	4,600	601.00	2,764,600	
若築建設	900	2,023.00	1,820,700	
東洋建設	5,300	583.00	3,089,900	
五洋建設	19,800	792.00	15,681,600	
福田組	500	4,785.00	2,392,500	
住友林業	11,900	2,112.00	25,132,800	
日本基礎技術	1,500	527.00	790,500	
巴コーポレーション	2,200	449.00	987,800	
大和ハウス工業	42,900	3,774.00	161,904,600	
ライト工業	2,700	1,974.00	5,329,800	
積水ハウス	50,400	2,366.50	119,271,600	
日特建設	1,300	711.00	924,300	
北陸電気工事	900	1,185.00	1,066,500	
ユアテック	2,800	689.00	1,929,200	
日本リーテック	1,000	1,569.00	1,569,000	
四電工	600	1,664.00	998,400	
中電工	2,200	2,237.00	4,921,400	
関電工	7,600	907.00	6,893,200	
きんでん	9,500	1,896.00	18,012,000	
東京エネシス	1,600	1,103.00	1,764,800	
トーエネック	500	3,480.00	1,740,000	
住友電設	1,300	2,201.00	2,861,300	
日本電設工業	2,600	1,836.00	4,773,600	
エクシオグループ	7,100	2,656.00	18,857,600	
新日本空調	1,300	2,394.00	3,112,200	
九電工	3,300	3,560.00	11,748,000	

三機工業	3,300	1,421.00	4,689,300	
日揮ホールディングス	15,500	1,134.00	17,577,000	
中外炉工業	500	1,750.00	875,000	
ヤマト	1,600	811.00	1,297,600	
太平電業	1,000	2,745.00	2,745,000	
高砂熱学工業	4,200	2,066.00	8,677,200	
三晃金属工業	200	2,526.00	505,200	
朝日工業社	400	3,385.00	1,354,000	
明星工業	3,100	692.00	2,145,200	
大氣社	2,300	3,275.00	7,532,500	
ダイダン	1,100	2,446.00	2,690,600	
日比谷総合設備	1,500	1,939.00	2,908,500	
フィル・カンパニー	300	2,747.00	824,100	
テスホールディングス	900	2,248.00	2,023,200	
インフロニア・ホールディングス	18,300	952.00	17,421,600	
東洋エンジニアリング	2,000	887.00	1,774,000	
レイズネクスト	2,500	1,239.00	3,097,500	
ニップン	4,400	1,599.00	7,035,600	
日清製粉グループ本社	16,800	1,794.00	30,139,200	
日東富士製粉	200	3,170.00	634,000	
昭和産業	1,300	2,786.00	3,621,800	
鳥越製粉	1,300	760.00	988,000	
中部飼料	1,800	1,099.00	1,978,200	
フィード・ワン	2,000	745.00	1,490,000	
東洋精糖	200	1,166.00	233,200	
日本甜菜製糖	800	1,637.00	1,309,600	
DM三井製糖ホールディングス	1,200	2,015.00	2,418,000	
塩水港精糖	1,800	222.00	399,600	
日新製糖	700	1,705.00	1,193,500	
森永製菓	3,500	3,965.00	13,877,500	
中村屋	400	3,795.00	1,518,000	
江崎グリコ	4,100	4,095.00	16,789,500	
名糖産業	700	1,713.00	1,199,100	
井村屋グループ	900	2,290.00	2,061,000	
不二家	800	2,346.00	1,876,800	
山崎製パン	11,200	1,775.00	19,880,000	

第一屋製パン	300	744.00	223,200	
モロゾフ	200	5,390.00	1,078,000	
亀田製菓	900	4,490.00	4,041,000	
寿スピリッツ	1,400	7,420.00	10,388,000	
カルビー	6,800	2,721.00	18,502,800	
森永乳業	2,800	6,600.00	18,480,000	
六甲バター	1,100	1,639.00	1,802,900	
ヤクルト本社	10,200	5,740.00	58,548,000	
明治ホールディングス	9,800	7,060.00	69,188,000	
雪印メグミルク	3,600	2,197.00	7,909,200	
プリマハム	2,100	2,717.00	5,705,700	
日本ハム	5,700	4,020.00	22,914,000	
林兼産業	500	616.00	308,000	
丸大食品	1,500	1,695.00	2,542,500	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,300	3,155.00	4,101,500	
柿安本店	500	2,666.00	1,333,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,600	703.00	6,748,800	
サッポロホールディングス	5,100	2,457.00	12,530,700	
アサヒグループホールディングス	35,000	5,047.00	176,645,000	
キリンホールディングス	54,600	1,979.00	108,053,400	
宝ホールディングス	11,000	1,566.00	17,226,000	
オエノンホールディングス	4,300	377.00	1,621,100	
養命酒製造	500	1,818.00	909,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	10,400	1,528.00	15,891,200	
サントリー食品インターナショナル	10,000	4,445.00	44,450,000	
ダイドーグループホールディングス	800	5,420.00	4,336,000	
伊藤園	4,500	7,250.00	32,625,000	
キーコーヒー	1,500	2,238.00	3,357,000	
ユニカフェ	500	1,092.00	546,000	
ジャパンフーズ	200	1,232.00	246,400	
日清オイリオグループ	1,900	3,010.00	5,719,000	
不二製油グループ本社	3,600	2,675.00	9,630,000	
Ｊ－オイルミルズ	1,400	1,831.00	2,563,400	
キッコーマン	10,700	9,270.00	99,189,000	
味の素	35,300	3,290.00	116,137,000	

ブルドックソース	700	2,228.00	1,559,600	
キユーピー	8,300	2,490.00	20,667,000	
ハウス食品グループ本社	5,600	3,240.00	18,144,000	
カゴメ	5,600	2,849.00	15,954,400	
焼津水産化学工業	800	980.00	784,000	
アリアケジャパン	1,400	7,300.00	10,220,000	
ピエトロ	200	1,790.00	358,000	
エバラ食品工業	300	2,498.00	749,400	
やまみ	200	2,006.00	401,200	
ニチレイ	7,100	2,778.00	19,723,800	
東洋水産	7,700	4,670.00	35,959,000	
イートアンドホールディングス	500	2,106.00	1,053,000	
大冷	200	1,915.00	383,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	757.00	681,300	
日清食品ホールディングス	5,800	8,430.00	48,894,000	
永谷園ホールディングス	700	2,090.00	1,463,000	
一正蒲鉾	600	913.00	547,800	
フジッコ	1,600	1,908.00	3,052,800	
ロック・フィールド	1,600	1,691.00	2,705,600	
日本たばこ産業	79,700	2,253.50	179,603,950	
ケンコーマヨネーズ	900	1,531.00	1,377,900	
わらべや日洋ホールディングス	1,000	2,162.00	2,162,000	
なとり	800	1,948.00	1,558,400	
イフジ産業	200	910.00	182,000	
ピックルスコーポレーション	700	1,806.00	1,264,200	
ファーマフーズ	1,400	2,578.00	3,609,200	
ユーグレナ	7,600	824.00	6,262,400	
紀文食品	900	1,210.00	1,089,000	
ミヨシ油脂	600	1,314.00	788,400	
理研ビタミン	1,400	1,795.00	2,513,000	
片倉工業	1,600	1,741.00	2,785,600	
グンゼ	1,100	4,325.00	4,757,500	
東洋紡	5,700	1,371.00	7,814,700	
ユニチカ	4,300	364.00	1,565,200	
富士紡ホールディングス	700	4,050.00	2,835,000	
倉敷紡績	1,200	1,891.00	2,269,200	

シキボウ	900	936.00	842,400	
日本毛織	4,400	925.00	4,070,000	
ダイトウボウ	2,300	99.00	227,700	
トーア紡コーポレーション	500	432.00	216,000	
ダイドーリミテッド	1,900	170.00	323,000	
帝国繊維	1,600	2,064.00	3,302,400	
帝人	13,700	1,539.00	21,084,300	
東レ	105,100	703.50	73,937,850	
住江織物	300	1,807.00	542,100	
日本フエルト	800	444.00	355,200	
イチカワ	200	1,325.00	265,000	
日東製網	100	1,472.00	147,200	
アツギ	1,200	646.00	775,200	
ダイニック	600	760.00	456,000	
セーレン	3,600	2,380.00	8,568,000	
ソトー	600	878.00	526,800	
東海染工	200	1,138.00	227,600	
小松マテーレ	2,400	910.00	2,184,000	
ワコールホールディングス	3,600	2,320.00	8,352,000	
ホギメディカル	1,900	3,150.00	5,985,000	
クラウディアホールディングス	300	283.00	84,900	
ＴＳＩホールディングス	4,500	355.00	1,597,500	
マツオカコーポレーション	500	1,398.00	699,000	
ワールド	1,900	1,404.00	2,667,600	
三陽商会	800	914.00	731,200	
ナイガイ	500	332.00	166,000	
オンワードホールディングス	8,700	341.00	2,966,700	
ルックホールディングス	400	1,393.00	557,200	
ゴールドウイン	2,400	6,680.00	16,032,000	
デサント	2,500	4,180.00	10,450,000	
キング	800	543.00	434,400	
ヤマトインターナショナル	1,300	319.00	414,700	
特種東海製紙	900	4,430.00	3,987,000	
王子ホールディングス	65,300	570.00	37,221,000	
日本製紙	6,400	1,180.00	7,552,000	
三菱製紙	2,100	355.00	745,500	

北越コーポレーション	10,400	787.00	8,184,800	
中越パルプ工業	600	1,187.00	712,200	
巴川製紙所	500	916.00	458,000	
大王製紙	7,000	1,983.00	13,881,000	
阿波製紙	400	380.00	152,000	
レンゴー	14,900	872.00	12,992,800	
トーモク	900	1,957.00	1,761,300	
ザ・パック	1,100	2,976.00	3,273,600	
北の達人コーポレーション	5,200	424.00	2,204,800	
クラレ	21,200	1,041.00	22,069,200	
旭化成	96,100	1,205.00	115,800,500	
共和レザー	800	682.00	545,600	
昭和電工	12,600	2,920.00	36,792,000	
住友化学	114,200	574.00	65,550,800	
住友精化	700	3,300.00	2,310,000	
日産化学	8,000	6,400.00	51,200,000	
ラサ工業	500	1,851.00	925,500	
クレハ	1,200	7,400.00	8,880,000	
多木化学	600	6,380.00	3,828,000	
テイカ	1,100	1,331.00	1,464,100	
石原産業	2,600	1,225.00	3,185,000	
片倉コープアグリ	400	1,182.00	472,800	
日本曹達	2,000	3,440.00	6,880,000	
東ソー	22,400	1,925.00	43,120,000	
トクヤマ	4,300	1,998.00	8,591,400	
セントラル硝子	2,800	2,136.00	5,980,800	
東亞合成	8,300	1,270.00	10,541,000	
大阪ソーダ	1,500	2,856.00	4,284,000	
関東電化工業	3,500	1,022.00	3,577,000	
デンカ	5,300	3,795.00	20,113,500	
信越化学工業	26,800	19,480.00	522,064,000	
日本カーバイド工業	600	1,388.00	832,800	
堺化学工業	1,000	2,028.00	2,028,000	
第一稀元素化学工業	1,500	1,474.00	2,211,000	
エア・ウォーター	14,800	1,740.00	25,752,000	
日本酸素ホールディングス	12,000	2,637.00	31,644,000	

日本化学工業	400	2,884.00	1,153,600	
東邦アセチレン	200	1,247.00	249,400	
日本パーカライジング	7,300	1,156.00	8,438,800	
高圧ガス工業	2,300	762.00	1,752,600	
四国化成工業	1,900	1,422.00	2,701,800	
戸田工業	300	3,120.00	936,000	
ステラ　ケミファ	800	2,879.00	2,303,200	
保土谷化学工業	400	4,985.00	1,994,000	
日本触媒	2,600	5,840.00	15,184,000	
大日精化工業	1,200	2,614.00	3,136,800	
カネカ	3,800	4,390.00	16,682,000	
三菱瓦斯化学	14,500	2,336.00	33,872,000	
三井化学	12,500	3,475.00	43,437,500	
ＪＳＲ	14,600	3,945.00	57,597,000	
東京応化工業	2,500	7,010.00	17,525,000	
大阪有機化学工業	1,200	3,425.00	4,110,000	
三菱ケミカルホールディングス	96,900	952.60	92,306,940	
ＫＨネオケム	2,400	2,955.00	7,092,000	
ダイセル	19,500	853.00	16,633,500	
住友ベークライト	2,300	4,800.00	11,040,000	
積水化学工業	30,400	1,780.00	54,112,000	
日本ゼオン	13,100	1,494.00	19,571,400	
アイカ工業	4,000	3,530.00	14,120,000	
宇部興産	7,300	2,127.00	15,527,100	
積水樹脂	2,200	2,161.00	4,754,200	
タキロンシーアイ	3,200	609.00	1,948,800	
旭有機材	800	1,388.00	1,110,400	
ニチバン	800	1,833.00	1,466,400	
リケンテクノス	3,500	550.00	1,925,000	
大倉工業	800	2,092.00	1,673,600	
積水化成品工業	1,900	579.00	1,100,100	
群栄化学工業	300	3,215.00	964,500	
タイガースポリマー	800	431.00	344,800	
ミライアル	500	1,585.00	792,500	
ダイキアクシス	600	924.00	554,400	
ダイキョーニシカワ	3,100	685.00	2,123,500	

竹本容器	500	910.00	455,000	
森六ホールディングス	800	1,992.00	1,593,600	
恵和	400	4,680.00	1,872,000	
日本化薬	9,000	1,204.00	10,836,000	
カーリットホールディングス	1,500	760.00	1,140,000	
日本精化	1,100	2,231.00	2,454,100	
扶桑化学工業	1,100	5,150.00	5,665,000	
トリケミカル研究所	1,300	3,425.00	4,452,500	
ＡＤＥＫＡ	6,700	2,494.00	16,709,800	
日油	5,500	5,590.00	30,745,000	
新日本理化	2,500	323.00	807,500	
ハリマ化成グループ	1,100	870.00	957,000	
花王	32,800	6,363.00	208,706,400	
第一工業製薬	500	3,180.00	1,590,000	
石原ケミカル	800	1,427.00	1,141,600	
日華化学	500	967.00	483,500	
ニイタカ	300	2,316.00	694,800	
三洋化成工業	900	5,510.00	4,959,000	
有機合成薬品工業	1,200	321.00	385,200	
大日本塗料	1,700	850.00	1,445,000	
日本ペイントホールディングス	54,500	1,266.00	68,997,000	
関西ペイント	16,300	2,616.00	42,640,800	
神東塗料	1,300	191.00	248,300	
中国塗料	3,100	889.00	2,755,900	
日本特殊塗料	1,100	1,002.00	1,102,200	
藤倉化成	2,000	534.00	1,068,000	
太陽ホールディングス	2,200	2,960.00	6,512,000	
ＤＩＣ	6,100	3,030.00	18,483,000	
サカタインクス	2,900	1,113.00	3,227,700	
東洋インキＳＣホールディングス	3,100	2,018.00	6,255,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,000	807.00	807,000	
富士フイルムホールディングス	26,000	8,804.00	228,904,000	
資生堂	27,600	7,525.00	207,690,000	
ライオン	17,900	1,890.00	33,831,000	
高砂香料工業	900	2,922.00	2,629,800	
マンダム	3,100	1,637.00	5,074,700	

ミルボン	1,800	6,740.00	12,132,000	
ファンケル	5,400	3,520.00	19,008,000	
コーセー	2,800	13,780.00	38,584,000	
コタ	1,000	1,594.00	1,594,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,300	2,492.00	15,699,600	
ノエビアホールディングス	1,300	5,610.00	7,293,000	
アジュバンホールディングス	300	1,215.00	364,500	
新日本製薬	400	1,711.00	684,400	
エステー	1,000	1,680.00	1,680,000	
アグロ　カネショウ	500	1,412.00	706,000	
コニシ	2,400	1,763.00	4,231,200	
長谷川香料	2,600	2,800.00	7,280,000	
星光ＰＭＣ	900	789.00	710,100	
小林製薬	4,200	8,530.00	35,826,000	
荒川化学工業	1,200	1,219.00	1,462,800	
メック	1,100	3,085.00	3,393,500	
日本高純度化学	400	2,892.00	1,156,800	
タカラバイオ	3,900	2,958.00	11,536,200	
ＪＣＵ	1,700	4,485.00	7,624,500	
新田ゼラチン	1,000	623.00	623,000	
ＯＡＴアグリオ	300	2,093.00	627,900	
デクセリアルズ	4,100	2,267.00	9,294,700	
アース製薬	1,200	6,890.00	8,268,000	
北興化学工業	1,400	1,001.00	1,401,400	
大成ラミック	500	2,791.00	1,395,500	
クミアイ化学工業	5,500	846.00	4,653,000	
日本農薬	2,700	535.00	1,444,500	
アキレス	1,000	1,355.00	1,355,000	
有沢製作所	2,100	887.00	1,862,700	
日東電工	9,000	8,120.00	73,080,000	
レック	1,800	1,056.00	1,900,800	
三光合成	1,600	416.00	665,600	
きもと	2,300	233.00	535,900	
藤森工業	1,300	4,630.00	6,019,000	
前澤化成工業	900	1,282.00	1,153,800	
未来工業	500	1,615.00	807,500	

ウェーブロックホールディングス	600	662.00	397,200	
ＪＳＰ	900	1,586.00	1,427,400	
エフピコ	2,700	3,850.00	10,395,000	
天馬	1,100	2,803.00	3,083,300	
信越ポリマー	2,300	1,014.00	2,332,200	
東リ	3,800	236.00	896,800	
ニフコ	5,400	3,755.00	20,277,000	
バルカー	1,200	2,137.00	2,564,400	
ユニ・チャーム	28,500	4,393.00	125,200,500	
ショーエイコーポレーション	300	796.00	238,800	
協和キリン	17,400	3,735.00	64,989,000	
武田薬品工業	123,300	3,184.00	392,587,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	128,400	1,967.50	252,627,000	
大日本住友製薬	11,000	1,986.00	21,846,000	
塩野義製薬	18,600	7,485.00	139,221,000	
わかもと製薬	1,800	340.00	612,000	
日本新薬	4,200	9,050.00	38,010,000	
中外製薬	46,300	4,251.00	196,821,300	
科研製薬	2,500	4,490.00	11,225,000	
エーザイ	16,400	8,124.00	133,233,600	
ロート製薬	7,100	3,360.00	23,856,000	
小野薬品工業	34,000	2,452.50	83,385,000	
久光製薬	4,300	3,995.00	17,178,500	
持田製薬	2,100	3,260.00	6,846,000	
参天製薬	25,800	1,598.00	41,228,400	
扶桑薬品工業	500	2,612.00	1,306,000	
日本ケミファ	200	2,159.00	431,800	
ツムラ	5,000	3,525.00	17,625,000	
日医工	4,200	867.00	3,641,400	
キッセイ薬品工業	2,600	2,366.00	6,151,600	
生化学工業	2,600	1,014.00	2,636,400	
栄研化学	2,600	1,974.00	5,132,400	
日水製薬	500	979.00	489,500	
鳥居薬品	800	2,952.00	2,361,600	
ＪＣＲファーマ	4,200	2,851.00	11,974,200	

東和薬品	2,100	3,395.00	7,129,500	
富士製薬工業	900	1,117.00	1,005,300	
ゼリア新薬工業	2,700	2,030.00	5,481,000	
第一三共	116,400	2,855.00	332,322,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	1,761.00	5,811,300	
大幸薬品	2,200	805.00	1,771,000	
ダイト	1,000	3,220.00	3,220,000	
大塚ホールディングス	30,800	4,653.00	143,312,400	
大正製薬ホールディングス	3,700	6,320.00	23,384,000	
ペプチドリーム	7,800	2,754.00	21,481,200	
あすか製薬ホールディングス	1,700	999.00	1,698,300	
サワイグループホールディングス	3,200	5,090.00	16,288,000	
日本コークス工業	12,500	155.00	1,937,500	
ニチレキ	1,700	1,325.00	2,252,500	
ユシロ化学工業	800	1,169.00	935,200	
ビーピー・カストロール	600	1,428.00	856,800	
富士石油	3,700	287.00	1,061,900	
ＭＯＲＥＳＣＯ	500	1,220.00	610,000	
出光興産	16,400	3,285.00	53,874,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	222,700	467.00	104,000,900	
コスモエネルギーホールディングス	4,700	2,518.00	11,834,600	
横浜ゴム	8,600	1,970.00	16,942,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	7,800	1,852.00	14,445,600	
ブリヂストン	42,700	5,075.00	216,702,500	
住友ゴム工業	13,300	1,426.00	18,965,800	
藤倉コンポジット	1,400	828.00	1,159,200	
オカモト	900	3,990.00	3,591,000	
フコク	700	1,005.00	703,500	
ニッタ	1,500	2,644.00	3,966,000	
住友理工	2,800	751.00	2,102,800	
三ツ星ベルト	1,800	1,998.00	3,596,400	
バンドー化学	2,600	889.00	2,311,400	
日東紡績	2,200	3,610.00	7,942,000	
ＡＧＣ	13,600	5,700.00	77,520,000	
日本板硝子	7,500	665.00	4,987,500	
石塚硝子	300	2,187.00	656,100	

日本山村硝子	600	923.00	553,800	
日本電気硝子	5,900	2,879.00	16,986,100	
オハラ	600	1,385.00	831,000	
住友大阪セメント	2,700	3,280.00	8,856,000	
太平洋セメント	8,400	2,442.00	20,512,800	
日本ヒューム	1,300	755.00	981,500	
日本コンクリート工業	3,200	301.00	963,200	
三谷セキサン	700	7,140.00	4,998,000	
アジアパイルホールディングス	2,300	466.00	1,071,800	
東海カーボン	12,400	1,546.00	19,170,400	
日本カーボン	800	4,410.00	3,528,000	
東洋炭素	1,000	3,070.00	3,070,000	
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,910.00	3,928,000	
ＴＯＴＯ	10,600	5,710.00	60,526,000	
日本碍子	16,300	1,935.00	31,540,500	
日本特殊陶業	11,300	1,726.00	19,503,800	
ダントーホールディングス	1,000	253.00	253,000	
ＭＡＲＵＷＡ	500	11,280.00	5,640,000	
品川リフラクトリーズ	300	4,005.00	1,201,500	
黒崎播磨	300	4,660.00	1,398,000	
ヨータイ	1,000	1,290.00	1,290,000	
イソライト工業	700	915.00	640,500	
東京窯業	1,900	324.00	615,600	
ニッカトー	700	788.00	551,600	
フジミインコーポレーテッド	1,200	6,930.00	8,316,000	
クニミネ工業	500	1,151.00	575,500	
エーアンドエーマテリアル	300	980.00	294,000	
ニチアス	3,700	2,770.00	10,249,000	
ニチハ	2,000	3,260.00	6,520,000	
日本製鉄	69,900	2,064.00	144,273,600	
神戸製鋼所	26,900	694.00	18,668,600	
合同製鐵	800	1,576.00	1,260,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	42,400	1,812.00	76,828,800	
東京製鐵	5,800	1,343.00	7,789,400	
共英製鋼	1,700	1,423.00	2,419,100	
大和工業	3,100	3,905.00	12,105,500	

東京鐵鋼	600	1,531.00	918,600	
大阪製鐵	800	1,204.00	963,200	
淀川製鋼所	1,900	2,507.00	4,763,300	
丸一鋼管	4,800	2,641.00	12,676,800	
モリ工業	500	2,799.00	1,399,500	
大同特殊鋼	2,400	4,825.00	11,580,000	
日本高周波鋼業	600	412.00	247,200	
日本冶金工業	1,200	2,817.00	3,380,400	
山陽特殊製鋼	1,800	1,804.00	3,247,200	
愛知製鋼	800	2,695.00	2,156,000	
日立金属	13,800	2,162.00	29,835,600	
日本金属	400	1,157.00	462,800	
大平洋金属	1,000	2,160.00	2,160,000	
新日本電工	9,700	386.00	3,744,200	
栗本鐵工所	700	1,658.00	1,160,600	
虹技	200	1,088.00	217,600	
日本鋳鉄管	200	1,222.00	244,400	
三菱製鋼	1,100	1,191.00	1,310,100	
日亜鋼業	2,300	294.00	676,200	
日本精線	200	5,030.00	1,006,000	
エンビプロ・ホールディングス	600	2,630.00	1,578,000	
シンニッタン	1,900	232.00	440,800	
新家工業	400	1,747.00	698,800	
大紀アルミニウム工業所	2,200	1,744.00	3,836,800	
日本軽金属ホールディングス	4,000	1,951.00	7,804,000	
三井金属鉱業	4,000	3,395.00	13,580,000	
東邦亜鉛	800	3,375.00	2,700,000	
三菱マテリアル	9,700	2,253.00	21,854,100	
住友金属鉱山	18,700	4,515.00	84,430,500	
ＤＯＷＡホールディングス	3,700	4,865.00	18,000,500	
古河機械金属	2,500	1,266.00	3,165,000	
エス・サイエンス	7,600	32.00	243,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	810.00	1,296,000	
東邦チタニウム	2,700	1,224.00	3,304,800	
ＵＡＣＪ	2,200	2,717.00	5,977,400	
ＣＫサンエツ	300	3,495.00	1,048,500	

古河電気工業	4,600	2,577.00	11,854,200	
住友電気工業	51,200	1,540.50	78,873,600	
フジクラ	17,700	672.00	11,894,400	
昭和電線ホールディングス	1,400	2,240.00	3,136,000	
タツタ電線	2,700	534.00	1,441,800	
カナレ電気	300	1,723.00	516,900	
平河ヒューテック	800	1,178.00	942,400	
リョービ	1,800	1,235.00	2,223,000	
アーレスティ	1,900	437.00	830,300	
アサヒホールディングス	5,500	2,220.00	12,210,000	
稲葉製作所	800	1,344.00	1,075,200	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,609.00	1,304,500	
トーカロ	3,800	1,361.00	5,171,800	
アルファＣｏ	500	1,293.00	646,500	
ＳＵＭＣＯ	22,600	2,180.00	49,268,000	
川田テクノロジーズ	300	3,875.00	1,162,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	500	6,030.00	3,015,000	
ジェイテックコーポレーション	200	2,151.00	430,200	
信和	800	724.00	579,200	
東洋製罐グループホールディングス	9,300	1,325.00	12,322,500	
ホッカンホールディングス	700	1,485.00	1,039,500	
コロナ	800	914.00	731,200	
横河ブリッジホールディングス	2,500	2,317.00	5,792,500	
駒井ハルテック	300	1,663.00	498,900	
高田機工	100	2,801.00	280,100	
三和ホールディングス	13,800	1,424.00	19,651,200	
文化シヤッター	4,300	1,096.00	4,712,800	
三協立山	1,900	746.00	1,417,400	
アルインコ	1,000	998.00	998,000	
東洋シヤッター	300	672.00	201,600	
ＬＩＸＩＬ	20,200	3,100.00	62,620,000	
日本フイルコン	1,000	552.00	552,000	
ノーリツ	2,800	1,880.00	5,264,000	
長府製作所	1,500	2,040.00	3,060,000	
リンナイ	2,800	11,720.00	32,816,000	
ダイニチ工業	700	795.00	556,500	

日東精工	1,800	667.00	1,200,600	
三洋工業	200	1,892.00	378,400	
岡部	3,000	679.00	2,037,000	
ジーテクト	1,800	1,447.00	2,604,600	
東プレ	2,700	1,336.00	3,607,200	
高周波熱錬	2,800	631.00	1,766,800	
東京製綱	1,000	917.00	917,000	
サンコール	1,200	456.00	547,200	
モリテック　スチール	1,100	441.00	485,100	
パイオラックス	2,200	1,649.00	3,627,800	
エイチワン	1,400	752.00	1,052,800	
日本発條	14,600	869.00	12,687,400	
中央発條	700	1,037.00	725,900	
アドバネクス	200	1,211.00	242,200	
立川ブラインド工業	600	1,246.00	747,600	
三益半導体工業	1,100	2,437.00	2,680,700	
日本ドライケミカル	400	2,094.00	837,600	
日本製鋼所	4,400	3,380.00	14,872,000	
三浦工業	6,300	4,475.00	28,192,500	
タクマ	5,000	1,543.00	7,715,000	
ツガミ	3,000	1,592.00	4,776,000	
オークマ	1,700	5,610.00	9,537,000	
芝浦機械	1,500	2,686.00	4,029,000	
アマダ	21,500	1,147.00	24,660,500	
アイダエンジニアリング	3,800	1,037.00	3,940,600	
滝澤鉄工所	400	1,121.00	448,400	
ＦＵＪＩ	5,800	2,635.00	15,283,000	
牧野フライス製作所	1,700	4,330.00	7,361,000	
オーエスジー	6,800	1,872.00	12,729,600	
ダイジェット工業	200	1,110.00	222,000	
旭ダイヤモンド工業	3,800	713.00	2,709,400	
ＤＭＧ森精機	8,700	1,967.00	17,112,900	
ソディック	3,200	891.00	2,851,200	
ディスコ	2,000	31,000.00	62,000,000	
日東工器	700	1,935.00	1,354,500	
日進工具	1,100	1,461.00	1,607,100	

パンチ工業	1,300	588.00	764,400	
冨士ダイス	700	645.00	451,500	
豊和工業	800	817.00	653,600	
ＯＫＫ	700	306.00	214,200	
東洋機械金属	1,100	549.00	603,900	
津田駒工業	300	820.00	246,000	
島精機製作所	2,100	2,101.00	4,412,100	
オプトラン	1,800	2,299.00	4,138,200	
ＮＣホールディングス	500	1,472.00	736,000	
イワキポンプ	900	1,002.00	901,800	
フリュー	1,400	1,627.00	2,277,800	
ヤマシンフィルタ	3,000	670.00	2,010,000	
日阪製作所	1,800	841.00	1,513,800	
やまびこ	2,800	1,216.00	3,404,800	
野村マイクロ・サイエンス	300	4,880.00	1,464,000	
平田機工	700	6,810.00	4,767,000	
ペガサスミシン製造	1,500	455.00	682,500	
マルマエ	600	2,293.00	1,375,800	
タツモ	700	1,700.00	1,190,000	
ナブテスコ	8,300	3,860.00	32,038,000	
三井海洋開発	1,500	1,970.00	2,955,000	
レオン自動機	1,400	1,394.00	1,951,600	
ＳＭＣ	4,400	68,720.00	302,368,000	
ホソカワミクロン	1,000	3,235.00	3,235,000	
ユニオンツール	500	3,855.00	1,927,500	
オイレス工業	2,100	1,706.00	3,582,600	
日精エー・エス・ビー機械	500	3,790.00	1,895,000	
サトーホールディングス	1,900	2,691.00	5,112,900	
技研製作所	1,300	4,340.00	5,642,000	
日本エアーテック	700	1,239.00	867,300	
カワタ	400	999.00	399,600	
日精樹脂工業	1,100	1,112.00	1,223,200	
オカダアイヨン	500	1,300.00	650,000	
ワイエイシイホールディングス	600	945.00	567,000	
小松製作所	67,100	2,922.50	196,099,750	
住友重機械工業	8,500	2,985.00	25,372,500	

日立建機	6,900	3,470.00	23,943,000	
日工	2,200	667.00	1,467,400	
巴工業	600	2,440.00	1,464,000	
井関農機	1,400	1,665.00	2,331,000	
ＴＯＷＡ	1,400	2,444.00	3,421,600	
丸山製作所	300	1,570.00	471,000	
北川鉄工所	700	1,583.00	1,108,100	
ローツェ	600	10,940.00	6,564,000	
タカキタ	500	700.00	350,000	
クボタ	72,200	2,486.50	179,525,300	
荏原実業	700	2,851.00	1,995,700	
三菱化工機	500	2,383.00	1,191,500	
月島機械	2,700	1,162.00	3,137,400	
帝国電機製作所	1,000	1,450.00	1,450,000	
新東工業	3,500	755.00	2,642,500	
澁谷工業	1,300	3,045.00	3,958,500	
アイチ　コーポレーション	2,500	788.00	1,970,000	
小森コーポレーション	3,800	751.00	2,853,800	
鶴見製作所	1,100	1,753.00	1,928,300	
住友精密工業	200	2,352.00	470,400	
酒井重工業	300	2,478.00	743,400	
荏原製作所	6,100	6,220.00	37,942,000	
石井鐵工所	200	2,978.00	595,600	
酉島製作所	1,500	904.00	1,356,000	
北越工業	1,500	939.00	1,408,500	
ダイキン工業	18,900	25,595.00	483,745,500	
オルガノ	500	7,030.00	3,515,000	
トーヨーカネツ	600	2,558.00	1,534,800	
栗田工業	8,000	5,450.00	43,600,000	
椿本チエイン	2,100	3,375.00	7,087,500	
大同工業	700	1,062.00	743,400	
木村化工機	1,300	770.00	1,001,000	
アネスト岩田	2,500	943.00	2,357,500	
ダイフク	8,100	10,490.00	84,969,000	
サムコ	400	2,867.00	1,146,800	
加藤製作所	800	840.00	672,000	

油研工業	300	1,755.00	526,500	
タダノ	7,100	1,298.00	9,215,800	
フジテック	5,100	2,515.00	12,826,500	
ＣＫＤ	3,400	2,245.00	7,633,000	
キトー	1,200	1,588.00	1,905,600	
平和	4,100	2,051.00	8,409,100	
理想科学工業	1,100	2,460.00	2,706,000	
ＳＡＮＫＹＯ	3,500	2,751.00	9,628,500	
日本金銭機械	1,600	826.00	1,321,600	
マースグループホールディングス	900	1,637.00	1,473,300	
フクシマガリレイ	1,000	4,530.00	4,530,000	
オーイズミ	700	382.00	267,400	
ダイコク電機	700	1,212.00	848,400	
竹内製作所	2,500	2,945.00	7,362,500	
アマノ	3,900	2,702.00	10,537,800	
ＪＵＫＩ	2,100	849.00	1,782,900	
サンデンホールディングス	2,100	287.00	602,700	
ジャノメ	1,300	743.00	965,900	
マックス	2,000	1,788.00	3,576,000	
グローリー	3,800	2,443.00	9,283,400	
新晃工業	1,400	2,060.00	2,884,000	
大和冷機工業	2,100	1,285.00	2,698,500	
セガサミーホールディングス	13,500	1,634.00	22,059,000	
日本ピストンリング	500	1,336.00	668,000	
リケン	700	2,725.00	1,907,500	
ＴＰＲ	2,000	1,460.00	2,920,000	
ツバキ・ナカシマ	3,200	1,609.00	5,148,800	
ホシザキ	4,300	9,820.00	42,226,000	
大豊工業	1,200	835.00	1,002,000	
日本精工	30,400	810.00	24,624,000	
ＮＴＮ	34,200	268.00	9,165,600	
ジェイテクト	14,200	1,039.00	14,753,800	
不二越	1,300	4,260.00	5,538,000	
日本トムソン	4,000	582.00	2,328,000	
ＴＨＫ	8,600	2,593.00	22,299,800	
ユーシン精機	1,000	771.00	771,000	

前澤給装工業	1,000	1,057.00	1,057,000	
イーグル工業	1,800	1,207.00	2,172,600	
前澤工業	900	695.00	625,500	
日本ピラー工業	1,500	2,627.00	3,940,500	
キッツ	5,000	768.00	3,840,000	
マキタ	19,300	5,770.00	111,361,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	5,800	570.00	3,306,000	
日立造船	11,700	906.00	10,600,200	
三菱重工業	23,300	3,020.00	70,366,000	
ＩＨＩ	10,000	2,730.00	27,300,000	
サノヤスホールディングス	2,200	135.00	297,000	
スター精密	2,300	1,492.00	3,431,600	
日清紡ホールディングス	9,000	888.00	7,992,000	
イビデン	7,100	6,280.00	44,588,000	
コニカミノルタ	30,000	575.00	17,250,000	
ブラザー工業	18,100	2,262.00	40,942,200	
ミネベアミツミ	25,500	2,845.00	72,547,500	
日立製作所	71,200	6,775.00	482,380,000	
東芝	29,300	4,785.00	140,200,500	
三菱電機	148,100	1,603.50	237,478,350	
富士電機	8,900	5,080.00	45,212,000	
東洋電機製造	600	1,085.00	651,000	
安川電機	15,900	4,965.00	78,943,500	
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,321.00	2,509,900	
明電舎	2,500	2,438.00	6,095,000	
オリジン	400	1,315.00	526,000	
山洋電気	700	6,530.00	4,571,000	
デンヨー	1,300	1,999.00	2,598,700	
東芝テック	1,600	4,565.00	7,304,000	
芝浦メカトロニクス	300	7,310.00	2,193,000	
マブチモーター	3,500	3,915.00	13,702,500	
日本電産	35,700	12,590.00	449,463,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	657.00	525,600	
トレックス・セミコンダクター	800	2,603.00	2,082,400	
東光高岳	800	1,463.00	1,170,400	
ダブル・スコープ	4,300	931.00	4,003,300	

ダイヘン	1,600	4,610.00	7,376,000	
ヤーマン	2,500	1,174.00	2,935,000	
ＪＶＣケンウッド	12,800	208.00	2,662,400	
ミマキエンジニアリング	1,300	887.00	1,153,100	
Ｉ－ＰＥＸ	700	2,018.00	1,412,600	
日新電機	3,500	1,386.00	4,851,000	
大崎電気工業	3,000	561.00	1,683,000	
オムロン	12,300	10,680.00	131,364,000	
日東工業	2,200	1,703.00	3,746,600	
ＩＤＥＣ	2,000	2,327.00	4,654,000	
正興電機製作所	500	1,421.00	710,500	
不二電機工業	300	1,258.00	377,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,300	2,551.00	13,520,300	
サクサホールディングス	400	1,430.00	572,000	
メルコホールディングス	500	4,825.00	2,412,500	
テクノメディカ	300	1,592.00	477,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	2,180.00	872,000	
日本電気	18,800	6,290.00	118,252,000	
富士通	13,300	21,825.00	290,272,500	
沖電気工業	6,000	951.00	5,706,000	
岩崎通信機	700	893.00	625,100	
電気興業	700	2,506.00	1,754,200	
サンケン電気	1,700	5,650.00	9,605,000	
ナカヨ	300	1,405.00	421,500	
アイホン	900	2,383.00	2,144,700	
ルネサスエレクトロニクス	79,900	1,402.00	112,019,800	
セイコーエプソン	18,400	2,047.00	37,664,800	
ワコム	10,700	722.00	7,725,400	
アルバック	2,700	6,360.00	17,172,000	
アクセル	600	710.00	426,000	
ＥＩＺＯ	1,300	4,355.00	5,661,500	
日本信号	3,500	969.00	3,391,500	
京三製作所	3,200	487.00	1,558,400	
能美防災	2,000	2,071.00	4,142,000	
ホーチキ	1,100	1,215.00	1,336,500	

星和電機	700	521.00	364,700	
エレコム	3,400	1,709.00	5,810,600	
パナソニック	157,900	1,527.00	241,113,300	
シャープ	19,700	1,384.00	27,264,800	
アンリツ	8,900	2,113.00	18,805,700	
富士通ゼネラル	4,500	2,754.00	12,393,000	
ソニーグループ	92,800	13,410.00	1,244,448,000	代用有価証券 35,000株
ＴＤＫ	21,300	4,140.00	88,182,000	
帝国通信工業	700	1,321.00	924,700	
タムラ製作所	5,300	798.00	4,229,400	
アルプスアルパイン	12,100	1,174.00	14,205,400	
池上通信機	500	782.00	391,000	
日本電波工業	1,400	936.00	1,310,400	
鈴木	700	885.00	619,500	
メイコー	1,100	3,100.00	3,410,000	
日本トリム	300	3,480.00	1,044,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	2,970.00	2,673,000	
フォスター電機	1,500	854.00	1,281,000	
ＳＭＫ	400	2,279.00	911,600	
ヨコオ	1,200	2,470.00	2,964,000	
ホシデン	3,900	1,024.00	3,993,600	
ヒロセ電機	2,300	18,410.00	42,343,000	
日本航空電子工業	3,400	1,689.00	5,742,600	
ＴＯＡ	1,800	809.00	1,456,200	
マクセル	2,900	1,300.00	3,770,000	
古野電気	1,900	1,242.00	2,359,800	
ユニデンホールディングス	400	3,220.00	1,288,000	
スミダコーポレーション	1,400	1,338.00	1,873,200	
アイコム	600	2,414.00	1,448,400	
リオン	600	2,440.00	1,464,000	
本多通信工業	1,200	465.00	558,000	
横河電機	14,800	2,311.00	34,202,800	
新電元工業	600	4,015.00	2,409,000	
アズビル	10,000	4,850.00	48,500,000	
東亜ディーケーケー	800	900.00	720,000	

日本光電工業	6,100	3,650.00	22,265,000	
チノー	500	1,409.00	704,500	
共和電業	1,500	405.00	607,500	
日本電子材料	600	1,907.00	1,144,200	
堀場製作所	2,700	7,440.00	20,088,000	
アドバンテスト	11,000	9,200.00	101,200,000	
小野測器	600	520.00	312,000	
エスペック	1,300	2,282.00	2,966,600	
キーエンス	14,600	66,760.00	974,696,000	
日置電機	700	7,820.00	5,474,000	
シスメックス	11,600	14,275.00	165,590,000	
日本マイクロニクス	2,600	1,470.00	3,822,000	
メガチップス	1,500	3,510.00	5,265,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	700	3,660.00	2,562,000	
澤藤電機	200	1,981.00	396,200	
原田工業	600	952.00	571,200	
コーセル	1,800	936.00	1,684,800	
イリソ電子工業	1,200	4,915.00	5,898,000	
オプテックスグループ	2,400	1,470.00	3,528,000	
千代田インテグレ	600	2,203.00	1,321,800	
アイ・オー・データ機器	600	918.00	550,800	
レーザーテック	6,500	25,000.00	162,500,000	
スタンレー電気	10,400	2,902.00	30,180,800	
岩崎電気	500	2,126.00	1,063,000	
ウシオ電機	7,600	2,040.00	15,504,000	
岡谷電機産業	1,100	350.00	385,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,400	324.00	453,600	
エノモト	400	1,901.00	760,400	
日本セラミック	1,400	2,951.00	4,131,400	
遠藤照明	800	1,227.00	981,600	
古河電池	1,100	1,599.00	1,758,900	
双信電機	800	792.00	633,600	
山一電機	1,000	1,675.00	1,675,000	
図研	1,000	4,315.00	4,315,000	
日本電子	2,700	8,570.00	23,139,000	
カシオ計算機	11,900	1,670.00	19,873,000	

ファナック	13,000	24,560.00	319,280,000	
日本シイエムケイ	3,200	425.00	1,360,000	
エンプラス	700	3,135.00	2,194,500	
大真空	500	4,035.00	2,017,500	
ローム	6,200	10,310.00	63,922,000	
浜松ホトニクス	10,600	6,680.00	70,808,000	
三井ハイテック	1,500	8,140.00	12,210,000	
新光電気工業	5,000	3,870.00	19,350,000	
京セラ	22,600	6,751.00	152,572,600	
太陽誘電	6,600	5,620.00	37,092,000	
村田製作所	43,500	8,536.00	371,316,000	
双葉電子工業	2,600	774.00	2,012,400	
北陸電気工業	600	1,023.00	613,800	
ニチコン	4,700	1,077.00	5,061,900	
日本ケミコン	1,500	2,106.00	3,159,000	
ＫＯＡ	2,100	1,525.00	3,202,500	
市光工業	1,800	574.00	1,033,200	
小糸製作所	8,900	6,710.00	59,719,000	
ミツバ	2,800	646.00	1,808,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,600	9,580.00	24,908,000	
キヤノン電子	1,400	1,592.00	2,228,800	
キヤノン	73,600	2,727.00	200,707,200	代用有価証券 10,000株
リコー	37,700	1,100.00	41,470,000	
象印マホービン	4,000	1,577.00	6,308,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,624.00	324,800	
東京エレクトロン	8,700	51,310.00	446,397,000	
トヨタ紡織	4,300	2,147.00	9,232,100	
芦森工業	300	1,005.00	301,500	
ユニプレス	2,400	936.00	2,246,400	
豊田自動織機	12,000	9,640.00	115,680,000	
モリタホールディングス	2,400	1,434.00	3,441,600	
三櫻工業	2,000	1,032.00	2,064,000	
デンソー	32,600	8,080.00	263,408,000	
東海理化電機製作所	3,900	1,648.00	6,427,200	
川崎重工業	11,600	2,361.00	27,387,600	

名村造船所	4,600	237.00	1,090,200	
日本車輌製造	600	2,090.00	1,254,000	
三菱ロジスネクスト	2,000	1,128.00	2,256,000	
近畿車輛	300	1,092.00	327,600	
日産自動車	174,500	588.20	102,640,900	
いすゞ自動車	39,400	1,545.00	60,873,000	
トヨタ自動車	750,500	1,980.00	1,485,990,000	
日野自動車	18,500	1,116.00	20,646,000	
三菱自動車工業	54,800	363.00	19,892,400	
エフテック	1,100	653.00	718,300	
レシップホールディングス	600	575.00	345,000	
ＧＭＢ	300	870.00	261,000	
ファルテック	300	719.00	215,700	
武蔵精密工業	3,300	2,148.00	7,088,400	
日産車体	2,200	793.00	1,744,600	
新明和工業	4,200	940.00	3,948,000	
極東開発工業	2,600	1,601.00	4,162,600	
トピー工業	1,200	1,195.00	1,434,000	
ティラド	500	3,055.00	1,527,500	
タチエス	2,300	1,384.00	3,183,200	
ＮＯＫ	7,200	1,320.00	9,504,000	
フタバ産業	3,800	471.00	1,789,800	
ＫＹＢ	1,700	3,090.00	5,253,000	
大同メタル工業	3,100	616.00	1,909,600	
プレス工業	7,300	336.00	2,452,800	
ミクニ	2,000	320.00	640,000	
太平洋工業	3,100	1,221.00	3,785,100	
河西工業	2,200	331.00	728,200	
アイシン	10,800	4,270.00	46,116,000	
マツダ	46,500	1,045.00	48,592,500	
今仙電機製作所	1,300	678.00	881,400	
本田技研工業	116,600	3,411.00	397,722,600	
スズキ	29,300	5,147.00	150,807,100	
ＳＵＢＡＲＵ	42,400	2,261.50	95,887,600	
安永	700	1,163.00	814,100	
ヤマハ発動機	19,300	3,205.00	61,856,500	

ＴＢＫ	1,900	416.00	790,400	
エクセディ	2,000	1,724.00	3,448,000	
豊田合成	4,800	2,330.00	11,184,000	
愛三工業	2,400	841.00	2,018,400	
盟和産業	300	1,009.00	302,700	
日本プラスト	1,300	636.00	826,800	
ヨロズ	1,300	1,175.00	1,527,500	
エフ・シー・シー	2,500	1,588.00	3,970,000	
シマノ	6,000	30,140.00	180,840,000	
テイ・エス　テック	6,900	1,540.00	10,626,000	
ジャムコ	900	1,008.00	907,200	
テルモ	45,400	5,115.00	232,221,000	
クリエートメディック	400	988.00	395,200	
日機装	4,400	1,028.00	4,523,200	
日本エム・ディ・エム	900	2,200.00	1,980,000	
島津製作所	19,100	4,695.00	89,674,500	
ＪＭＳ	1,200	756.00	907,200	
長野計器	1,000	1,349.00	1,349,000	
ブイ・テクノロジー	700	4,290.00	3,003,000	
東京計器	1,000	1,014.00	1,014,000	
愛知時計電機	200	4,715.00	943,000	
インターアクション	700	2,444.00	1,710,800	
オーバル	1,300	253.00	328,900	
東京精密	2,500	4,565.00	11,412,500	
マニー	5,900	1,981.00	11,687,900	
ニコン	22,600	1,248.00	28,204,800	
トプコン	7,500	1,982.00	14,865,000	
オリンパス	77,800	2,525.00	196,445,000	
理研計器	1,300	3,160.00	4,108,000	
タムロン	1,100	2,637.00	2,900,700	
ＨＯＹＡ	28,900	17,280.00	499,392,000	
シード	600	655.00	393,000	
ノーリツ鋼機	1,300	2,415.00	3,139,500	
エー・アンド・デイ	1,200	1,041.00	1,249,200	
朝日インテック	16,200	2,991.00	48,454,200	
シチズン時計	18,800	519.00	9,757,200	

リズム	500	1,374.00	687,000	
大研医器	1,200	580.00	696,000	
メニコン	4,600	4,150.00	19,090,000	
シンシア	200	602.00	120,400	
松風	700	2,261.00	1,582,700	
セイコーホールディングス	2,100	2,405.00	5,050,500	
ニプロ	11,000	1,152.00	12,672,000	
中本パックス	300	1,730.00	519,000	
スノーピーク	900	5,800.00	5,220,000	
パラマウントベッドホールディングス	2,800	2,169.00	6,073,200	
トランザクション	700	1,099.00	769,300	
粧美堂	400	408.00	163,200	
ニホンフラッシュ	1,200	1,105.00	1,326,000	
前田工繊	1,600	3,260.00	5,216,000	
永大産業	1,600	294.00	470,400	
アートネイチャー	1,300	739.00	960,700	
バンダイナムコホールディングス	12,200	8,707.00	106,225,400	
アイフィスジャパン	300	695.00	208,500	
共立印刷	1,800	176.00	316,800	
ＳＨＯＥＩ	1,400	5,100.00	7,140,000	
フランスベッドホールディングス	1,800	906.00	1,630,800	
パイロットコーポレーション	2,500	4,195.00	10,487,500	
萩原工業	900	1,519.00	1,367,100	
トッパン・フォームズ	2,500	1,083.00	2,707,500	
フジシールインターナショナル	3,000	2,527.00	7,581,000	
タカラトミー	6,500	1,095.00	7,117,500	
広済堂ホールディングス	1,000	1,029.00	1,029,000	
エステールホールディングス	300	667.00	200,100	
タカノ	400	765.00	306,000	
プロネクサス	1,100	1,107.00	1,217,700	
ホクシン	700	205.00	143,500	
ウッドワン	400	1,148.00	459,200	
大建工業	900	2,470.00	2,223,000	
凸版印刷	22,400	1,868.00	41,843,200	
大日本印刷	17,500	2,811.00	49,192,500	
共同印刷	400	2,616.00	1,046,400	

ＮＩＳＳＨＡ	3,000	1,809.00	5,427,000	
光村印刷	100	1,557.00	155,700	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	700	1,777.00	1,243,900	
アシックス	13,000	2,866.00	37,258,000	
ツツミ	300	2,196.00	658,800	
ローランド	1,000	5,100.00	5,100,000	
小松ウオール工業	400	1,928.00	771,200	
ヤマハ	8,800	7,260.00	63,888,000	
河合楽器製作所	400	3,635.00	1,454,000	
クリナップ	1,200	545.00	654,000	
ピジョン	8,900	2,546.00	22,659,400	
兼松サステック	100	1,807.00	180,700	
キングジム	1,100	871.00	958,100	
リンテック	3,100	2,501.00	7,753,100	
イトーキ	2,500	374.00	935,000	
任天堂	8,600	49,150.00	422,690,000	
三菱鉛筆	2,400	1,377.00	3,304,800	
タカラスタンダード	3,000	1,547.00	4,641,000	
コクヨ	7,000	1,742.00	12,194,000	
ナカバヤシ	1,300	575.00	747,500	
グローブライド	1,400	4,255.00	5,957,000	
オカムラ	5,000	1,483.00	7,415,000	
美津濃	1,400	2,661.00	3,725,400	
東京電力ホールディングス	125,700	337.00	42,360,900	
中部電力	45,300	1,289.00	58,391,700	
関西電力	56,100	1,070.50	60,055,050	
中国電力	21,400	990.00	21,186,000	
北陸電力	13,500	582.00	7,857,000	
東北電力	34,700	768.00	26,649,600	
四国電力	12,300	768.00	9,446,400	
九州電力	32,700	836.00	27,337,200	
北海道電力	13,800	521.00	7,189,800	
沖縄電力	2,900	1,419.00	4,115,100	
電源開発	11,800	1,556.00	18,360,800	
エフオン	900	859.00	773,100	
イーレックス	2,200	2,702.00	5,944,400	

レノバ	2,500	4,800.00	12,000,000	
東京瓦斯	28,500	1,870.50	53,309,250	
大阪瓦斯	26,800	1,876.00	50,276,800	
東邦瓦斯	7,300	3,535.00	25,805,500	
北海道瓦斯	800	1,514.00	1,211,200	
広島ガス	3,100	371.00	1,150,100	
西部ガスホールディングス	1,700	2,317.00	3,938,900	
静岡ガス	3,900	1,233.00	4,808,700	
メタウォーター	1,700	1,802.00	3,063,400	
ＳＢＳホールディングス	1,100	4,040.00	4,444,000	
東武鉄道	15,500	2,851.00	44,190,500	
相鉄ホールディングス	5,100	2,212.00	11,281,200	
東急	37,400	1,607.00	60,101,800	
京浜急行電鉄	19,000	1,284.00	24,396,000	
小田急電鉄	23,700	2,479.00	58,752,300	
京王電鉄	8,300	5,780.00	47,974,000	
京成電鉄	11,100	3,700.00	41,070,000	
富士急行	2,000	4,585.00	9,170,000	
東日本旅客鉄道	26,100	7,281.00	190,034,100	
西日本旅客鉄道	16,500	5,363.00	88,489,500	
東海旅客鉄道	12,300	17,010.00	209,223,000	
西武ホールディングス	17,900	1,258.00	22,518,200	
鴻池運輸	2,400	1,246.00	2,990,400	
西日本鉄道	4,100	2,781.00	11,402,100	
ハマキョウレックス	1,100	3,320.00	3,652,000	
サカイ引越センター	700	4,735.00	3,314,500	
近鉄グループホールディングス	14,000	3,595.00	50,330,000	
阪急阪神ホールディングス	18,700	3,505.00	65,543,500	
南海電気鉄道	6,700	2,277.00	15,255,900	
京阪ホールディングス	6,300	3,050.00	19,215,000	
神戸電鉄	300	3,445.00	1,033,500	
名古屋鉄道	11,600	1,926.00	22,341,600	
山陽電気鉄道	1,000	1,955.00	1,955,000	
アルプス物流	1,000	1,042.00	1,042,000	
日本通運	4,900	7,410.00	36,309,000	
ヤマトホールディングス	19,700	2,858.00	56,302,600	

山九	3,600	5,210.00	18,756,000	
丸運	900	271.00	243,900	
丸全昭和運輸	1,100	3,410.00	3,751,000	
センコーグループホールディングス	7,800	1,027.00	8,010,600	
トナミホールディングス	300	4,605.00	1,381,500	
ニッコンホールディングス	4,700	2,248.00	10,565,600	
日本石油輸送	200	2,702.00	540,400	
福山通運	1,800	4,690.00	8,442,000	
セイノーホールディングス	10,500	1,378.00	14,469,000	
エスライン	400	900.00	360,000	
神奈川中央交通	400	3,475.00	1,390,000	
日立物流	2,900	4,865.00	14,108,500	
丸和運輸機関	3,000	1,590.00	4,770,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,400	1,690.00	2,366,000	
九州旅客鉄道	10,900	2,561.00	27,914,900	
ＳＧホールディングス	26,500	2,870.00	76,055,000	
日本郵船	11,700	8,080.00	94,536,000	
商船三井	8,400	6,870.00	57,708,000	
川崎汽船	4,400	5,460.00	24,024,000	
ＮＳユナイテッド海運	700	3,925.00	2,747,500	
飯野海運	6,900	552.00	3,808,800	
乾汽船	1,000	2,347.00	2,347,000	
日本航空	34,200	2,456.00	83,995,200	
ＡＮＡホールディングス	37,900	2,680.00	101,572,000	
パスコ	200	1,488.00	297,600	
トランコム	400	8,070.00	3,228,000	
日新	1,100	1,657.00	1,822,700	
三菱倉庫	4,800	3,260.00	15,648,000	
三井倉庫ホールディングス	1,500	2,307.00	3,460,500	
住友倉庫	5,000	1,859.00	9,295,000	
澁澤倉庫	800	2,133.00	1,706,400	
東陽倉庫	2,300	328.00	754,400	
日本トランスシティ	3,000	598.00	1,794,000	
ケイヒン	300	1,424.00	427,200	
中央倉庫	900	976.00	878,400	
川西倉庫	300	1,167.00	350,100	

安田倉庫	1,200	971.00	1,165,200	
ファイズホールディングス	300	684.00	205,200	
東洋埠頭	400	1,456.00	582,400	
宇徳	1,000	532.00	532,000	
上組	7,700	2,337.00	17,994,900	
サンリツ	400	807.00	322,800	
キムラユニティー	400	1,388.00	555,200	
キユーソー流通システム	300	1,925.00	577,500	
近鉄エクスプレス	2,700	2,765.00	7,465,500	
東海運	800	332.00	265,600	
エーアイテイー	900	1,130.00	1,017,000	
内外トランスライン	500	2,272.00	1,136,000	
日本コンセプト	500	1,754.00	877,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	4,800	2,070.00	9,936,000	
クロスキャット	400	1,267.00	506,800	
システナ	5,200	2,113.00	10,987,600	
デジタルアーツ	800	9,700.00	7,760,000	
日鉄ソリューションズ	2,100	3,755.00	7,885,500	
キューブシステム	800	1,005.00	804,000	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	200	1,833.00	366,600	
コア	600	1,636.00	981,600	
ラクーンホールディングス	1,000	1,555.00	1,555,000	
ソリトンシステムズ	700	1,435.00	1,004,500	
ソフトクリエイトホールディングス	600	3,840.00	2,304,000	
ＴＩＳ	14,500	3,085.00	44,732,500	
ＪＮＳホールディングス	800	526.00	420,800	
グリー	8,900	953.00	8,481,700	
GMOペパボ	200	2,716.00	543,200	
コーエーテクモホールディングス	3,900	5,330.00	20,787,000	
三菱総合研究所	600	4,215.00	2,529,000	
ボルテージ	400	460.00	184,000	
電算	200	2,422.00	484,400	
ＡＧＳ	800	901.00	720,800	
ファインデックス	1,200	954.00	1,144,800	
ブレインパッド	400	5,400.00	2,160,000	
ＫＬａｂ	2,700	655.00	1,768,500	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	1,027.00	2,054,000	
イーブックイニシアティブジャパン	200	4,790.00	958,000	
ネクソン	32,700	2,028.00	66,315,600	
アイスタイル	4,500	412.00	1,854,000	
エムアップホールディングス	400	3,570.00	1,428,000	
エイチーム	1,000	1,608.00	1,608,000	
エニグモ	1,400	1,121.00	1,569,400	
テクノスジャパン	1,200	587.00	704,400	
ｅｎｉｓｈ	900	420.00	378,000	
コロプラ	4,800	808.00	3,878,400	
ブロードリーフ	7,300	556.00	4,058,800	
クロス・マーケティンググループ	600	851.00	510,600	
デジタルハーツホールディングス	700	1,887.00	1,320,900	
システム情報	1,100	929.00	1,021,900	
メディアドゥ	600	4,300.00	2,580,000	
じげん	3,600	399.00	1,436,400	
ブイキューブ	1,500	1,801.00	2,701,500	
エンカレッジ・テクノロジ	300	605.00	181,500	
サイバーリンクス	500	1,278.00	639,000	
フィックスターズ	1,600	762.00	1,219,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	2,440.00	1,464,000	
オプティム	1,000	1,838.00	1,838,000	
セレス	500	3,050.00	1,525,000	
ＳＨＩＦＴ	700	25,180.00	17,626,000	
ティーガイア	1,600	2,061.00	3,297,600	
セック	200	2,289.00	457,800	
テクマトリックス	2,200	1,841.00	4,050,200	
プロシップ	500	1,683.00	841,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	2,174.00	8,478,600	
GMOペイメントゲートウェイ	2,800	14,420.00	40,376,000	
ザッパラス	600	565.00	339,000	
システムリサーチ	400	1,966.00	786,400	
インターネットイニシアティブ	3,900	3,990.00	15,561,000	
さくらインターネット	1,600	601.00	961,600	
ヴィンクス	400	997.00	398,800	

GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	4,550.00	1,365,000	
ＳＲＡホールディングス	800	2,862.00	2,289,600	
システムインテグレータ	400	618.00	247,200	
朝日ネット	1,200	700.00	840,000	
ｅＢＡＳＥ	1,800	770.00	1,386,000	
アバント	1,600	1,623.00	2,596,800	
アドソル日進	500	2,119.00	1,059,500	
ＯＤＫソリューションズ	300	707.00	212,100	
フリービット	900	1,309.00	1,178,100	
コムチュア	1,300	3,060.00	3,978,000	
サイバーコム	200	1,256.00	251,200	
アステリア	1,100	710.00	781,000	
アイル	800	1,694.00	1,355,200	
マークラインズ	700	3,110.00	2,177,000	
メディカル・データ・ビジョン	1,800	1,480.00	2,664,000	
ｇｕｍｉ	2,000	946.00	1,892,000	
ショーケース	400	589.00	235,600	
モバイルファクトリー	400	1,024.00	409,600	
テラスカイ	500	2,121.00	1,060,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,705.00	1,023,000	
ＰＣＩホールディングス	700	1,045.00	731,500	
パイプドＨＤ	300	3,210.00	963,000	
アイビーシー	300	917.00	275,100	
ネオジャパン	300	1,310.00	393,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	300	3,715.00	1,114,500	
ラクス	4,400	3,490.00	15,356,000	
ランドコンピュータ	300	825.00	247,500	
ダブルスタンダード	400	3,765.00	1,506,000	
オープンドア	900	2,497.00	2,247,300	
マイネット	500	674.00	337,000	
アカツキ	600	3,175.00	1,905,000	
ベネフィットジャパン	100	2,700.00	270,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	400	2,832.00	1,132,800	
カナミックネットワーク	1,600	615.00	984,000	
ノムラシステムコーポレーション	800	291.00	232,800	

チェンジ	2,700	2,084.00	5,626,800	
シンクロ・フード	900	395.00	355,500	
オークネット	800	2,327.00	1,861,600	
キャピタル・アセット・プランニング	300	890.00	267,000	
エイトレッド	300	2,452.00	735,600	
マクロミル	3,000	811.00	2,433,000	
ビーグリー	400	1,581.00	632,400	
オロ	500	3,710.00	1,855,000	
ユーザーローカル	400	1,794.00	717,600	
テモナ	300	749.00	224,700	
マネーフォワード	2,200	7,620.00	16,764,000	
サインポスト	400	1,868.00	747,200	
電算システムホールディングス	600	2,519.00	1,511,400	
ソルクシーズ	1,200	537.00	644,400	
フェイス	500	702.00	351,000	
プロトコーポレーション	1,700	1,538.00	2,614,600	
ハイマックス	400	1,210.00	484,000	
野村総合研究所	25,200	4,175.00	105,210,000	
サイバネットシステム	1,100	634.00	697,400	
ＣＥホールディングス	800	542.00	433,600	
日本システム技術	300	2,063.00	618,900	
インテージホールディングス	1,800	1,883.00	3,389,400	
東邦システムサイエンス	400	1,029.00	411,600	
ソースネクスト	7,000	205.00	1,435,000	
インフォコム	1,300	2,385.00	3,100,500	
ＨＥＲＯＺ	400	1,806.00	722,400	
ラクスル	1,600	6,190.00	9,904,000	
ＩＰＳ	400	1,913.00	765,200	
ＦＩＧ	1,700	316.00	537,200	
システムサポート	400	1,344.00	537,600	
イーソル	900	849.00	764,100	
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,616.00	2,585,600	
ＥｄｕＬａｂ	100	1,684.00	168,400	
東海ソフト	200	1,202.00	240,400	
ウイングアーク１ｓｔ	800	2,062.00	1,649,600	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	2,210.00	663,000	
サーバーワークス	100	4,630.00	463,000	
東名	200	1,301.00	260,200	
ヴィッツ	100	1,653.00	165,300	
トビラシステムズ	300	1,125.00	337,500	
Ｓａｎｓａｎ	1,300	12,310.00	16,003,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	300	1,273.00	381,900	
ギフティ	1,300	3,955.00	5,141,500	
ベース	200	4,515.00	903,000	
フォーカスシステムズ	1,000	1,022.00	1,022,000	
クレスコ	1,000	2,017.00	2,017,000	
フジ・メディア・ホールディングス	15,100	1,185.00	17,893,500	
オービック	4,600	21,560.00	99,176,000	
ジャストシステム	2,100	5,900.00	12,390,000	
ＴＤＣソフト	1,300	1,305.00	1,696,500	
Ｚホールディングス	199,600	688.10	137,344,760	
トレンドマイクロ	7,800	6,450.00	50,310,000	
ＩＤホールディングス	900	933.00	839,700	
日本オラクル	2,900	10,760.00	31,204,000	
アルファシステムズ	400	4,190.00	1,676,000	
フューチャー	1,500	2,841.00	4,261,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	900	1,659.00	1,493,100	
ＳＢテクノロジー	500	2,866.00	1,433,000	
トーセ	400	779.00	311,600	
オービックビジネスコンサルタント	1,400	5,830.00	8,162,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,600	3,615.00	23,859,000	
アイティフォー	1,900	895.00	1,700,500	
東計電算	200	4,690.00	938,000	
エックスネット	300	1,018.00	305,400	
大塚商会	7,900	5,730.00	45,267,000	
サイボウズ	1,900	2,628.00	4,993,200	
電通国際情報サービス	2,100	4,045.00	8,494,500	
ＡＣＣＥＳＳ	1,900	901.00	1,711,900	
デジタルガレージ	2,400	5,070.00	12,168,000	
ＥＭシステムズ	2,400	749.00	1,797,600	

ウェザーニューズ	400	8,350.00	3,340,000	
ＣＩＪ	1,000	851.00	851,000	
ビジネスエンジニアリング	100	3,470.00	347,000	
日本エンタープライズ	1,500	200.00	300,000	
WOWOW	700	2,280.00	1,596,000	
スカラ	1,300	702.00	912,600	
インテリジェント　ウェイブ	900	608.00	547,200	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,300	510.00	663,000	
ネットワンシステムズ	5,900	3,905.00	23,039,500	
システムソフト	3,100	146.00	452,600	
アルゴグラフィックス	1,100	3,130.00	3,443,000	
マーベラス	2,300	714.00	1,642,200	
エイベックス	2,500	1,528.00	3,820,000	
日本ユニシス	5,000	3,175.00	15,875,000	
兼松エレクトロニクス	800	3,675.00	2,940,000	
都築電気	700	1,763.00	1,234,100	
ＴＢＳホールディングス	9,600	1,811.00	17,385,600	
日本テレビホールディングス	12,100	1,250.00	15,125,000	
朝日放送グループホールディングス	1,500	715.00	1,072,500	
テレビ朝日ホールディングス	4,500	1,748.00	7,866,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	9,700	432.00	4,190,400	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,203.00	2,203,000	
日本ＢＳ放送	500	1,104.00	552,000	
ビジョン	2,500	1,464.00	3,660,000	
スマートバリュー	400	614.00	245,600	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,400	3,355.00	4,697,000	
コネクシオ	800	1,607.00	1,285,600	
日本通信	12,900	202.00	2,605,800	
クロップス	300	974.00	292,200	
日本電信電話	170,000	3,267.00	555,390,000	
ＫＤＤＩ	116,600	3,680.00	429,088,000	
ソフトバンク	132,100	1,535.50	202,839,550	
光通信	1,700	17,900.00	30,430,000	
エムティーアイ	1,400	722.00	1,010,800	
GMOインターネット	5,100	3,080.00	15,708,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	400	383.00	153,200	

ＫＡＤＯＫＡＷＡ	3,800	5,790.00	22,002,000	
学研ホールディングス	2,000	1,124.00	2,248,000	
ゼンリン	2,600	1,029.00	2,675,400	
昭文社ホールディングス	600	492.00	295,200	
インプレスホールディングス	1,200	263.00	315,600	
アイネット	800	1,308.00	1,046,400	
松竹	1,000	12,510.00	12,510,000	
東宝	8,600	5,410.00	46,526,000	
東映	500	22,880.00	11,440,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	38,700	2,253.00	87,191,100	
ピー・シー・エー	600	1,769.00	1,061,400	
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,843.00	921,500	
ＤＴＳ	3,000	2,557.00	7,671,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,200	6,560.00	40,672,000	
シーイーシー	1,600	1,360.00	2,176,000	
カプコン	12,500	3,465.00	43,312,500	
アイ・エス・ビー	700	1,250.00	875,000	
ジャステック	900	1,302.00	1,171,800	
ＳＣＳＫ	10,200	2,301.00	23,470,200	
日本システムウエア	500	2,480.00	1,240,000	
アイネス	1,400	1,643.00	2,300,200	
ＴＫＣ	2,500	3,465.00	8,662,500	
富士ソフト	1,600	5,690.00	9,104,000	
ＮＳＤ	4,700	2,050.00	9,635,000	
コナミホールディングス	5,300	6,630.00	35,139,000	
福井コンピュータホールディングス	700	4,110.00	2,877,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,000	1,603.00	1,603,000	
ミロク情報サービス	1,400	1,750.00	2,450,000	
ソフトバンクグループ	115,400	6,500.00	750,100,000	
ホウスイ	200	920.00	184,000	
高千穂交易	600	1,200.00	720,000	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,650.00	495,000	
伊藤忠食品	400	5,230.00	2,092,000	
エレマテック	1,200	1,141.00	1,369,200	
ＪＡＬＵＸ	500	1,718.00	859,000	
あらた	1,200	4,040.00	4,848,000	

トーメンデバイス	200	5,620.00	1,124,000	
東京エレクトロン　デバイス	500	7,390.00	3,695,000	
フィールズ	1,400	517.00	723,800	
双日	16,100	1,908.00	30,718,800	
アルフレッサ　ホールディングス	15,200	1,599.00	24,304,800	
横浜冷凍	4,100	867.00	3,554,700	
神栄	200	1,015.00	203,000	
ラサ商事	900	938.00	844,200	
アルコニックス	1,600	1,722.00	2,755,200	
神戸物産	11,300	3,735.00	42,205,500	
ハイパー	500	552.00	276,000	
あい　ホールディングス	2,100	2,119.00	4,449,900	
ディーブイエックス	500	1,112.00	556,000	
ダイワボウホールディングス	6,700	1,991.00	13,339,700	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	2,619.00	9,166,500	
ラクト・ジャパン	500	2,747.00	1,373,500	
グリムス	400	2,716.00	1,086,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	768.00	1,996,800	
八洲電機	1,200	955.00	1,146,000	
メディアスホールディングス	900	890.00	801,000	
レスターホールディングス	1,500	1,933.00	2,899,500	
ジューテックホールディングス	400	1,161.00	464,400	
大光	600	707.00	424,200	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,259.00	629,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,100	880.00	6,248,000	
黒谷	500	701.00	350,500	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	738.00	221,400	
三洋貿易	1,500	1,109.00	1,663,500	
ビューティガレージ	200	3,965.00	793,000	
ウイン・パートナーズ	1,100	964.00	1,060,400	
ミタチ産業	500	1,018.00	509,000	
シップヘルスケアホールディングス	5,200	2,867.00	14,908,400	
明治電機工業	600	1,356.00	813,600	
デリカフーズホールディングス	700	616.00	431,200	
スターティアホールディングス	300	1,429.00	428,700	
コメダホールディングス	3,200	2,045.00	6,544,000	

ピーバンドットコム	300	681.00	204,300	
アセンテック	400	1,333.00	533,200	
富士興産	500	1,053.00	526,500	
協栄産業	200	1,455.00	291,000	
フルサト・マルカホールディングス	1,400	1,995.00	2,793,000	
ヤマエグループホールディングス	1,100	1,111.00	1,222,100	
小野建	1,300	1,681.00	2,185,300	
南陽	300	2,019.00	605,700	
佐鳥電機	1,000	1,018.00	1,018,000	
エコートレーディング	400	639.00	255,600	
伯東	900	1,907.00	1,716,300	
コンドーテック	1,200	985.00	1,182,000	
中山福	1,000	407.00	407,000	
ナガイレーベン	2,000	2,335.00	4,670,000	
三菱食品	1,600	2,950.00	4,720,000	
松田産業	1,100	3,585.00	3,943,500	
第一興商	2,800	4,160.00	11,648,000	
メディパルホールディングス	14,700	2,103.00	30,914,100	
ＳＰＫ	700	1,415.00	990,500	
萩原電気ホールディングス	600	2,113.00	1,267,800	
アズワン	1,100	15,570.00	17,127,000	
スズデン	500	1,659.00	829,500	
シモジマ	900	1,135.00	1,021,500	
ドウシシャ	1,400	1,762.00	2,466,800	
小津産業	300	1,928.00	578,400	
高速	800	1,563.00	1,250,400	
たけびし	500	1,501.00	750,500	
リックス	400	1,489.00	595,600	
丸文	1,300	781.00	1,015,300	
ハピネット	1,300	1,482.00	1,926,600	
橋本総業ホールディングス	300	2,146.00	643,800	
日本ライフライン	4,700	1,254.00	5,893,800	
タカショー	1,000	824.00	824,000	
ＩＤＯＭ	5,000	798.00	3,990,000	
進和	900	2,188.00	1,969,200	
エスケイジャパン	500	512.00	256,000	

ダイトロン	600	2,279.00	1,367,400	
シークス	2,100	1,250.00	2,625,000	
田中商事	500	661.00	330,500	
オーハシテクニカ	800	1,497.00	1,197,600	
白銅	500	2,980.00	1,490,000	
ダイコー通産	200	1,156.00	231,200	
伊藤忠商事	99,700	3,233.00	322,330,100	
丸紅	143,900	970.90	139,712,510	
高島	300	1,901.00	570,300	
長瀬産業	8,000	1,914.00	15,312,000	
蝶理	1,000	1,889.00	1,889,000	
豊田通商	14,700	5,050.00	74,235,000	
三共生興	2,300	579.00	1,331,700	
兼松	5,900	1,344.00	7,929,600	
ツカモトコーポレーション	300	1,368.00	410,400	
三井物産	113,400	2,618.00	296,881,200	
日本紙パルプ商事	800	3,775.00	3,020,000	
カメイ	1,900	1,178.00	2,238,200	
東都水産	200	6,960.00	1,392,000	
ＯＵＧホールディングス	300	2,803.00	840,900	
スターゼン	1,100	2,120.00	2,332,000	
山善	5,700	1,062.00	6,053,400	
椿本興業	300	3,890.00	1,167,000	
住友商事	92,100	1,633.50	150,445,350	
内田洋行	600	4,835.00	2,901,000	
三菱商事	88,800	3,628.00	322,166,400	
第一実業	700	5,230.00	3,661,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	2,296.00	8,265,600	
西華産業	800	1,650.00	1,320,000	
佐藤商事	1,200	1,188.00	1,425,600	
菱洋エレクトロ	1,100	2,366.00	2,602,600	
東京産業	1,400	716.00	1,002,400	
ユアサ商事	1,500	3,060.00	4,590,000	
神鋼商事	300	3,395.00	1,018,500	
トルク	1,000	231.00	231,000	
阪和興業	2,900	3,455.00	10,019,500	

正栄食品工業	1,000	4,050.00	4,050,000	
カナデン	1,200	1,022.00	1,226,400	
菱電商事	1,100	1,801.00	1,981,100	
岩谷産業	3,500	6,710.00	23,485,000	
ナイス	600	1,843.00	1,105,800	
ニチモウ	300	1,991.00	597,300	
極東貿易	400	2,571.00	1,028,400	
アステナホールディングス	2,100	566.00	1,188,600	
三愛石油	3,600	1,512.00	5,443,200	
稲畑産業	3,500	1,687.00	5,904,500	
ＧＳＩクレオス	800	1,018.00	814,400	
明和産業	1,400	845.00	1,183,000	
クワザワホールディングス	600	632.00	379,200	
ワキタ	2,900	1,029.00	2,984,100	
東邦ホールディングス	4,700	1,825.00	8,577,500	
サンゲツ	3,900	1,581.00	6,165,900	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,468.00	3,229,600	
シナネンホールディングス	600	3,480.00	2,088,000	
伊藤忠エネクス	3,300	1,020.00	3,366,000	
サンリオ	4,100	2,595.00	10,639,500	
サンワテクノス	1,000	1,526.00	1,526,000	
リョーサン	1,600	2,332.00	3,731,200	
新光商事	2,000	900.00	1,800,000	
トーホー	700	1,542.00	1,079,400	
三信電気	800	1,646.00	1,316,800	
東陽テクニカ	1,500	1,103.00	1,654,500	
モスフードサービス	2,100	3,110.00	6,531,000	
加賀電子	1,300	3,090.00	4,017,000	
ソーダニッカ	1,500	632.00	948,000	
立花エレテック	1,100	1,588.00	1,746,800	
フォーバル	600	1,193.00	715,800	
ＰＡＬＴＡＣ	2,400	5,160.00	12,384,000	
三谷産業	2,100	370.00	777,000	
太平洋興発	700	686.00	480,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	300	3,915.00	1,174,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,999.00	399,800	

コーア商事ホールディングス	1,200	676.00	811,200	
国際紙パルプ商事	3,200	369.00	1,180,800	
ヤマタネ	700	1,613.00	1,129,100	
丸紅建材リース	200	1,873.00	374,600	
日鉄物産	1,000	5,100.00	5,100,000	
泉州電業	400	4,755.00	1,902,000	
トラスコ中山	3,100	2,747.00	8,515,700	
オートバックスセブン	5,300	1,529.00	8,103,700	
モリト	1,200	691.00	829,200	
加藤産業	2,100	3,200.00	6,720,000	
北恵	400	1,000.00	400,000	
イノテック	900	1,397.00	1,257,300	
イエローハット	2,800	1,933.00	5,412,400	
ＪＫホールディングス	1,400	880.00	1,232,000	
日伝	1,200	2,262.00	2,714,400	
北沢産業	1,200	250.00	300,000	
杉本商事	700	2,458.00	1,720,600	
因幡電機産業	3,900	2,734.00	10,662,600	
東テク	500	2,659.00	1,329,500	
ミスミグループ本社	18,300	4,825.00	88,297,500	
アルテック	1,200	319.00	382,800	
タキヒヨー	500	1,771.00	885,500	
蔵王産業	300	1,766.00	529,800	
スズケン	6,200	3,170.00	19,654,000	
ジェコス	1,100	873.00	960,300	
グローセル	1,800	405.00	729,000	
ローソン	3,700	5,430.00	20,091,000	
サンエー	1,100	4,085.00	4,493,500	
カワチ薬品	1,000	2,174.00	2,174,000	
エービーシー・マート	2,300	5,490.00	12,627,000	
ハードオフコーポレーション	700	777.00	543,900	
アスクル	2,400	1,624.00	3,897,600	
ゲオホールディングス	2,000	1,201.00	2,402,000	
アダストリア	2,000	2,036.00	4,072,000	
ジーフット	1,000	399.00	399,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	400	405.00	162,000	

くら寿司	1,500	3,600.00	5,400,000	
キャンドゥ	700	2,549.00	1,784,300	
アイケイ	500	521.00	260,500	
パルグループホールディングス	1,300	1,571.00	2,042,300	
エディオン	6,200	1,078.00	6,683,600	
サーラコーポレーション	3,000	616.00	1,848,000	
ワッツ	800	751.00	600,800	
ハローズ	600	2,730.00	1,638,000	
フジオフードグループ本社	1,200	1,355.00	1,626,000	
あみやき亭	300	3,070.00	921,000	
ひらまつ	2,900	212.00	614,800	
大黒天物産	500	6,320.00	3,160,000	
ハニーズホールディングス	1,200	1,047.00	1,256,400	
ファーマライズホールディングス	400	827.00	330,800	
アルペン	1,100	2,815.00	3,096,500	
ハブ	500	746.00	373,000	
クオールホールディングス	2,000	1,698.00	3,396,000	
ジンズホールディングス	1,000	7,230.00	7,230,000	
ビックカメラ	8,700	986.00	8,578,200	
ＤＣＭホールディングス	9,000	1,141.00	10,269,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	18,500	2,625.00	48,562,500	
東京一番フーズ	500	587.00	293,500	
アークランドサービスホールディングス	1,100	2,250.00	2,475,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	17,400	1,058.00	18,409,200	
ドトール・日レスホールディングス	2,300	1,650.00	3,795,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	8,200	4,990.00	40,918,000	
ブロンコビリー	900	2,384.00	2,145,600	
ＺＯＺＯ	8,600	4,180.00	35,948,000	
トレジャー・ファクトリー	500	884.00	442,000	
物語コーポレーション	800	7,200.00	5,760,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	833.00	21,241,500	
Ｈａｍｅｅ	400	1,313.00	525,200	
マーケットエンタープライズ	200	736.00	147,200	
ウエルシアホールディングス	7,700	4,255.00	32,763,500	
クリエイトＳＤホールディングス	2,200	3,575.00	7,865,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,900	377.00	716,300	

ミサワ	400	672.00	268,800	
ティーライフ	200	1,422.00	284,400	
シュッピン	1,000	1,315.00	1,315,000	
オイシックス・ラ・大地	1,900	4,810.00	9,139,000	
ネクステージ	2,900	2,152.00	6,240,800	
ジョイフル本田	4,300	1,589.00	6,832,700	
鳥貴族ホールディングス	600	1,931.00	1,158,600	
ホットランド	1,100	1,356.00	1,491,600	
すかいらーくホールディングス	18,800	1,523.00	28,632,400	
ＳＦＰホールディングス	700	1,503.00	1,052,100	
綿半ホールディングス	1,100	1,200.00	1,320,000	
ヨシックスホールディングス	300	2,099.00	629,700	
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	1,039.00	4,363,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,288.00	1,030,400	
ＢＥＥＮＯＳ	700	3,285.00	2,299,500	
あさひ	1,100	1,324.00	1,456,400	
日本調剤	900	1,640.00	1,476,000	
コスモス薬品	1,500	17,520.00	26,280,000	
トーエル	700	816.00	571,200	
オンリー	300	758.00	227,400	
セブン&アイ・ホールディングス	57,100	4,798.00	273,965,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,800	871.00	6,793,800	
ツルハホールディングス	3,200	13,910.00	44,512,000	
サンマルクホールディングス	1,200	1,512.00	1,814,400	
フェリシモ	300	1,405.00	421,500	
トリドールホールディングス	3,600	2,738.00	9,856,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,400	732.00	1,024,800	
ウイルプラスホールディングス	300	1,094.00	328,200	
ＪＭホールディングス	1,000	1,860.00	1,860,000	
サツドラホールディングス	200	2,244.00	448,800	
アレンザホールディングス	1,100	1,192.00	1,311,200	
串カツ田中ホールディングス	400	2,222.00	888,800	
バロックジャパンリミテッド	1,000	845.00	845,000	
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,500.00	11,250,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	8,500	4,905.00	41,692,500	

メディカルシステムネットワーク	1,300	724.00	941,200	
はるやまホールディングス	700	574.00	401,800	
ノジマ	2,600	2,855.00	7,423,000	
カッパ・クリエイト	2,100	1,365.00	2,866,500	
ライトオン	1,200	700.00	840,000	
良品計画	16,800	2,244.00	37,699,200	
三城ホールディングス	1,900	260.00	494,000	
アドヴァングループ	1,500	947.00	1,420,500	
アルビス	500	2,325.00	1,162,500	
コナカ	1,800	333.00	599,400	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,656.00	331,200	
Ｇ－７ホールディングス	1,400	2,191.00	3,067,400	
イオン北海道	1,900	1,238.00	2,352,200	
コジマ	2,500	583.00	1,457,500	
ヒマラヤ	600	1,061.00	636,600	
コーナン商事	2,100	3,640.00	7,644,000	
エコス	600	1,868.00	1,120,800	
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	29,200	2,386.00	69,671,200	
西松屋チェーン	3,200	1,453.00	4,649,600	
ゼンショーホールディングス	7,800	2,607.00	20,334,600	
幸楽苑ホールディングス	900	1,453.00	1,307,700	
ハークスレイ	800	474.00	379,200	
サイゼリヤ	2,200	3,030.00	6,666,000	
ＶＴホールディングス	5,500	514.00	2,827,000	
魚力	500	2,035.00	1,017,500	
フジ・コーポレーション	800	1,213.00	970,400	
ユナイテッドアローズ	1,700	2,313.00	3,932,100	
ハイデイ日高	2,100	1,617.00	3,395,700	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉ	1,200	245.00	294,000	
コロワイド	4,900	1,634.00	8,006,600	
ピーシーデポコーポレーション	1,900	450.00	855,000	
壱番屋	1,000	4,515.00	4,515,000	
ＰＬＡＮＴ	500	722.00	361,000	
スギホールディングス	2,900	8,180.00	23,722,000	
薬王堂ホールディングス	600	2,502.00	1,501,200	

スクロール	2,100	882.00	1,852,200	
ヨンドシーホールディングス	1,300	1,742.00	2,264,600	
木曽路	1,900	2,109.00	4,007,100	
ＳＲＳホールディングス	2,000	756.00	1,512,000	
千趣会	2,700	391.00	1,055,700	
リテールパートナーズ	1,800	1,204.00	2,167,200	
ケーヨー	2,700	821.00	2,216,700	
上新電機	1,700	2,411.00	4,098,700	
日本瓦斯	7,100	1,391.00	9,876,100	
ロイヤルホールディングス	2,500	2,020.00	5,050,000	
東天紅	200	1,090.00	218,000	
いなげや	1,600	1,345.00	2,152,000	
チヨダ	1,500	769.00	1,153,500	
ライフコーポレーション	1,400	3,775.00	5,285,000	
リンガーハット	1,800	2,183.00	3,929,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,000	605.00	1,210,000	
ＡＯＫＩホールディングス	2,900	680.00	1,972,000	
オークワ	2,300	1,099.00	2,527,700	
コメリ	2,300	2,721.00	6,258,300	
青山商事	3,300	795.00	2,623,500	
しまむら	1,700	9,740.00	16,558,000	
はせがわ	1,000	263.00	263,000	
高島屋	10,600	1,086.00	11,511,600	
松屋	3,300	1,102.00	3,636,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	6,900	921.00	6,354,900	
近鉄百貨店	600	2,586.00	1,551,600	
丸井グループ	12,300	2,262.00	27,822,600	
アクシアル　リテイリング	1,200	3,580.00	4,296,000	
イオン	56,100	2,636.00	147,879,600	
イズミ	3,000	3,585.00	10,755,000	
平和堂	2,700	1,967.00	5,310,900	
フジ	1,800	2,018.00	3,632,400	
ヤオコー	1,700	6,610.00	11,237,000	
ゼビオホールディングス	1,800	1,060.00	1,908,000	
ケーズホールディングス	12,400	1,193.00	14,793,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	800	712.00	569,600	

日産東京販売ホールディングス	2,300	248.00	570,400	
シルバーライフ	300	1,410.00	423,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	600	5,470.00	3,282,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,093.00	327,900	
ブックオフグループホールディングス	900	981.00	882,900	
ギフト	200	2,710.00	542,000	
アインホールディングス	2,100	6,740.00	14,154,000	
元気寿司	400	2,699.00	1,079,600	
ヤマダホールディングス	48,900	448.00	21,907,200	
アークランドサカモト	2,300	1,716.00	3,946,800	
ニトリホールディングス	5,800	20,740.00	120,292,000	
愛眼	1,400	220.00	308,000	
ケーユーホールディングス	800	1,035.00	828,000	
吉野家ホールディングス	4,800	2,163.00	10,382,400	
松屋フーズホールディングス	700	3,630.00	2,541,000	
サガミホールディングス	2,200	995.00	2,189,000	
関西スーパーマーケット	1,100	1,830.00	2,013,000	
王将フードサービス	1,000	5,910.00	5,910,000	
プレナス	1,700	1,945.00	3,306,500	
ミニストップ	1,100	1,373.00	1,510,300	
アークス	2,800	2,189.00	6,129,200	
バローホールディングス	3,000	2,408.00	7,224,000	
藤久	400	779.00	311,600	
ベルク	700	5,500.00	3,850,000	
大庄	800	1,010.00	808,000	
ファーストリテイリング	2,000	73,530.00	147,060,000	
サンドラッグ	5,500	3,420.00	18,810,000	
サックスバー　ホールディングス	1,300	554.00	720,200	
ヤマザワ	400	1,718.00	687,200	
やまや	300	2,414.00	724,200	
ベルーナ	3,200	810.00	2,592,000	
島根銀行	500	581.00	290,500	
じもとホールディングス	1,000	641.00	641,000	
めぶきフィナンシャルグループ	75,900	235.00	17,836,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	1,474.00	2,653,200	
九州フィナンシャルグループ	29,800	384.00	11,443,200	

ゆうちょ銀行	41,400	901.00	37,301,400	
富山第一銀行	3,500	297.00	1,039,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	89,100	465.00	41,431,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,500	687.00	6,526,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,376.00	1,788,800	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,557.00	6,136,800	
ひろぎんホールディングス	21,500	633.00	13,609,500	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,462.00	3,200,600	
十六フィナンシャルグループ	1,800	2,070.00	3,726,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,400	1,983.00	2,776,200	
新生銀行	11,900	1,915.00	22,788,500	
あおぞら銀行	8,700	2,649.00	23,046,300	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	999,600	640.20	639,943,920	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	162,900	438.60	71,447,940	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,600	3,842.00	106,039,200	
三井住友フィナンシャルグループ	101,100	3,809.00	385,089,900	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	48,800	729.00	35,575,200	
群馬銀行	30,100	361.00	10,866,100	
武蔵野銀行	2,200	1,775.00	3,905,000	
千葉興業銀行	3,700	270.00	999,000	
筑波銀行	6,100	174.00	1,061,400	
七十七銀行	4,600	1,195.00	5,497,000	
青森銀行	1,100	2,003.00	2,203,300	
秋田銀行	900	1,425.00	1,282,500	
山形銀行	1,700	827.00	1,405,900	
岩手銀行	1,000	1,648.00	1,648,000	
東邦銀行	13,100	203.00	2,659,300	
東北銀行	700	999.00	699,300	
みちのく銀行	1,000	878.00	878,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,200	2,111.00	27,865,200	
静岡銀行	35,600	932.00	33,179,200	
スルガ銀行	12,800	426.00	5,452,800	
八十二銀行	32,900	388.00	12,765,200	
山梨中央銀行	1,700	825.00	1,402,500	
大垣共立銀行	2,900	1,915.00	5,553,500	

福井銀行	1,300	1,436.00	1,866,800	
清水銀行	600	1,556.00	933,600	
富山銀行	300	2,079.00	623,700	
滋賀銀行	2,900	1,839.00	5,333,100	
南都銀行	2,100	1,953.00	4,101,300	
百五銀行	13,200	322.00	4,250,400	
京都銀行	5,200	5,200.00	27,040,000	
紀陽銀行	5,200	1,503.00	7,815,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	843.00	8,177,100	
山陰合同銀行	9,200	571.00	5,253,200	
中国銀行	12,600	834.00	10,508,400	
鳥取銀行	500	1,116.00	558,000	
伊予銀行	19,400	558.00	10,825,200	
百十四銀行	1,600	1,475.00	2,360,000	
四国銀行	2,100	735.00	1,543,500	
阿波銀行	2,200	2,150.00	4,730,000	
大分銀行	800	1,871.00	1,496,800	
宮崎銀行	900	2,041.00	1,836,900	
佐賀銀行	800	1,454.00	1,163,200	
琉球銀行	3,200	764.00	2,444,800	
セブン銀行	48,800	241.00	11,760,800	
みずほフィナンシャルグループ	198,500	1,521.00	301,918,500	
高知銀行	600	775.00	465,000	
山口フィナンシャルグループ	18,300	653.00	11,949,900	
長野銀行	500	1,104.00	552,000	
名古屋銀行	1,200	2,522.00	3,026,400	
北洋銀行	22,000	242.00	5,324,000	
愛知銀行	500	3,495.00	1,747,500	
中京銀行	600	1,357.00	814,200	
大光銀行	500	1,335.00	667,500	
愛媛銀行	2,100	770.00	1,617,000	
トマト銀行	600	1,082.00	649,200	
京葉銀行	6,300	433.00	2,727,900	
栃木銀行	7,000	178.00	1,246,000	
北日本銀行	500	1,554.00	777,000	
東和銀行	2,600	507.00	1,318,200	

福島銀行	1,700	240.00	408,000	
大東銀行	700	681.00	476,700	
トモニホールディングス	11,300	307.00	3,469,100	
フィデアホールディングス	1,400	1,192.00	1,668,800	
池田泉州ホールディングス	16,900	162.00	2,737,800	
ＦＰＧ	5,000	711.00	3,555,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,100	1,288.00	1,416,800	
マーキュリアホールディングス	500	738.00	369,000	
ＳＢＩホールディングス	18,000	2,986.00	53,748,000	
ジャフコ　グループ	1,900	7,620.00	14,478,000	
大和証券グループ本社	109,500	667.30	73,069,350	
野村ホールディングス	222,900	557.20	124,199,880	
岡三証券グループ	12,500	396.00	4,950,000	
丸三証券	4,400	614.00	2,701,600	
東洋証券	5,100	169.00	861,900	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,600	403.00	6,286,800	
光世証券	400	581.00	232,400	
水戸証券	4,000	298.00	1,192,000	
いちよし証券	2,900	676.00	1,960,400	
松井証券	7,200	811.00	5,839,200	
マネックスグループ	13,100	799.00	10,466,900	
極東証券	2,000	785.00	1,570,000	
岩井コスモホールディングス	1,500	1,348.00	2,022,000	
アイザワ証券グループ	2,600	1,108.00	2,880,800	
マネーパートナーズグループ	1,700	257.00	436,900	
スパークス・グループ	6,900	296.00	2,042,400	
かんぽ生命保険	18,100	1,829.00	33,104,900	
ＳＯＭＰＯホールディングス	25,800	4,944.00	127,555,200	
アニコム　ホールディングス	4,100	887.00	3,636,700	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	35,500	3,708.00	131,634,000	
第一生命ホールディングス	71,900	2,455.00	176,514,500	
東京海上ホールディングス	48,100	6,018.00	289,465,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	43,700	1,511.00	66,030,700	
アドバンスクリエイト	700	1,041.00	728,700	
全国保証	3,800	5,390.00	20,482,000	

あんしん保証	500	313.00	156,500	
ジェイリース	500	2,126.00	1,063,000	
イントラスト	400	788.00	315,200	
日本モーゲージサービス	800	1,062.00	849,600	
Ｃａｓａ	400	914.00	365,600	
アルヒ	2,200	1,330.00	2,926,000	
プレミアグループ	700	3,160.00	2,212,000	
クレディセゾン	8,500	1,453.00	12,350,500	
芙蓉総合リース	1,500	7,470.00	11,205,000	
みずほリース	2,300	3,525.00	8,107,500	
東京センチュリー	3,400	6,580.00	22,372,000	
日本証券金融	6,200	871.00	5,400,200	
アイフル	24,600	376.00	9,249,600	
リコーリース	1,200	3,630.00	4,356,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,498.00	13,482,000	
アコム	28,900	387.00	11,184,300	
ジャックス	1,600	3,090.00	4,944,000	
オリエントコーポレーション	39,500	163.00	6,438,500	
オリックス	88,700	2,243.50	198,998,450	
三菱ＨＣキャピタル	50,600	574.00	29,044,400	
九州リースサービス	700	607.00	424,900	
日本取引所グループ	39,400	2,847.00	112,171,800	
イー・ギャランティ	1,700	2,529.00	4,299,300	
アサックス	700	710.00	497,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	600	2,040.00	1,224,000	
いちご	16,500	330.00	5,445,000	
日本駐車場開発	16,500	147.00	2,425,500	
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,462.00	1,169,600	
ＳＲＥホールディングス	200	7,510.00	1,502,000	
ＡＤワークスグループ	3,400	162.00	550,800	
ヒューリック	34,900	1,110.00	38,739,000	
三栄建築設計	600	1,804.00	1,082,400	
野村不動産ホールディングス	8,400	2,920.00	24,528,000	
三重交通グループホールディングス	3,100	505.00	1,565,500	
サムティ	2,100	2,476.00	5,199,600	
ディア・ライフ	2,100	572.00	1,201,200	

コーセーアールイー	600	664.00	398,400	
日本商業開発	1,000	1,743.00	1,743,000	
プレサンスコーポレーション	2,400	1,909.00	4,581,600	
ＴＨＥグローバル社	1,200	207.00	248,400	
ハウスコム	300	1,293.00	387,900	
日本管理センター	800	1,190.00	952,000	
サンセイランディック	500	831.00	415,500	
エストラスト	300	650.00	195,000	
フージャースホールディングス	2,500	694.00	1,735,000	
オープンハウス	4,700	7,230.00	33,981,000	
東急不動産ホールディングス	39,800	673.00	26,785,400	
飯田グループホールディングス	12,200	2,836.00	34,599,200	
イーグランド	300	1,570.00	471,000	
ムゲンエステート	1,100	490.00	539,000	
ビーロット	1,100	553.00	608,300	
ファーストブラザーズ	400	1,033.00	413,200	
ハウスドゥ	800	957.00	765,600	
シーアールイー	400	1,827.00	730,800	
プロパティエージェント	300	2,785.00	835,500	
ケイアイスター不動産	500	6,170.00	3,085,000	
アグレ都市デザイン	400	1,369.00	547,600	
グッドコムアセット	700	1,380.00	966,000	
ジェイ・エス・ビー	300	2,993.00	897,900	
テンポイノベーション	500	943.00	471,500	
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,040.00	312,000	
フェイスネットワーク	200	1,270.00	254,000	
パーク２４	7,900	1,821.00	14,385,900	
パラカ	400	1,616.00	646,400	
三井不動産	66,600	2,621.00	174,558,600	
三菱地所	96,000	1,746.50	167,664,000	
平和不動産	2,500	3,585.00	8,962,500	
東京建物	14,500	1,690.00	24,505,000	
ダイビル	3,700	1,541.00	5,701,700	
京阪神ビルディング	2,600	1,416.00	3,681,600	
住友不動産	32,800	4,168.00	136,710,400	
テーオーシー	2,800	637.00	1,783,600	

東京楽天地	300	4,020.00	1,206,000	
スターツコーポレーション	1,800	2,775.00	4,995,000	
フジ住宅	1,800	687.00	1,236,600	
空港施設	1,700	547.00	929,900	
明和地所	800	610.00	488,000	
ゴールドクレスト	1,400	1,642.00	2,298,800	
エスリード	600	1,654.00	992,400	
日神グループホールディングス	2,300	511.00	1,175,300	
日本エスコン	2,800	814.00	2,279,200	
タカラレーベン	6,500	311.00	2,021,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	900	858.00	772,200	
イオンモール	7,400	1,692.00	12,520,800	
毎日コムネット	600	751.00	450,600	
ファースト住建	600	1,263.00	757,800	
カチタス	3,600	4,090.00	14,724,000	
トーセイ	2,100	1,135.00	2,383,500	
サンフロンティア不動産	1,900	1,086.00	2,063,400	
ＦＪネクストホールディングス	1,500	1,013.00	1,519,500	
インテリックス	500	723.00	361,500	
ランドビジネス	800	280.00	224,000	
グランディハウス	1,200	494.00	592,800	
日本空港ビルデング	5,100	5,450.00	27,795,000	
明豊ファシリティワークス	600	926.00	555,600	
日本工営	800	3,435.00	2,748,000	
ＬＩＦＵＬＬ	4,400	358.00	1,575,200	
ミクシィ	3,600	2,659.00	9,572,400	
ジェイエイシーリクルートメント	1,200	2,243.00	2,691,600	
日本M&Aセンターホールディングス	23,200	3,585.00	83,172,000	
メンバーズ	400	3,270.00	1,308,000	
中広	200	383.00	76,600	
ＵＴグループ	2,000	3,690.00	7,380,000	
アイティメディア	500	2,269.00	1,134,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	800	1,252.00	1,001,600	
夢真ビーネックスグループ	3,800	1,518.00	5,768,400	
コシダカホールディングス	3,800	688.00	2,614,400	
アルトナー	300	878.00	263,400	

パソナグループ	1,500	3,340.00	5,010,000	
ＣＤＳ	400	1,536.00	614,400	
リンクアンドモチベーション	3,200	1,202.00	3,846,400	
エス・エム・エス	4,800	4,425.00	21,240,000	
サニーサイドアップグループ	500	764.00	382,000	
パーソルホールディングス	14,200	2,943.00	41,790,600	
リニカル	800	802.00	641,600	
クックパッド	4,500	233.00	1,048,500	
エスクリ	500	581.00	290,500	
アイ・ケイ・ケイ	700	686.00	480,200	
学情	600	1,182.00	709,200	
スタジオアリス	700	2,127.00	1,488,900	
シミックホールディングス	800	1,490.00	1,192,000	
エプコ	300	842.00	252,600	
ＮＪＳ	300	2,020.00	606,000	
綜合警備保障	5,600	4,995.00	27,972,000	
カカクコム	10,500	3,595.00	37,747,500	
アイロムグループ	500	1,976.00	988,000	
セントケア・ホールディング	1,100	886.00	974,600	
サイネックス	300	667.00	200,100	
ルネサンス	900	1,183.00	1,064,700	
ディップ	2,200	4,185.00	9,207,000	
デジタルホールディングス	1,000	1,796.00	1,796,000	
新日本科学	1,700	1,444.00	2,454,800	
キャリアデザインセンター	400	1,127.00	450,800	
ベネフィット・ワン	5,200	5,600.00	29,120,000	
エムスリー	25,000	7,311.00	182,775,000	
ツカダ・グローバルホールディング	900	340.00	306,000	
ブラス	200	746.00	149,200	
アウトソーシング	8,100	2,081.00	16,856,100	
ウェルネット	1,500	502.00	753,000	
ワールドホールディングス	600	2,940.00	1,764,000	
ディー・エヌ・エー	6,000	2,179.00	13,074,000	
博報堂ＤＹホールディングス	19,700	1,837.00	36,188,900	
ぐるなび	2,500	537.00	1,342,500	
タカミヤ	1,800	450.00	810,000	

ジャパンベストレスキューシステム	1,000	1,078.00	1,078,000	
ファンコミュニケーションズ	3,600	453.00	1,630,800	
ライク	400	1,670.00	668,000	
ビジネス・ブレークスルー	600	427.00	256,200	
エスプール	4,000	1,259.00	5,036,000	
ＷＤＢホールディングス	600	3,590.00	2,154,000	
手間いらず	200	5,700.00	1,140,000	
ティア	900	487.00	438,300	
ＣＤＧ	100	1,440.00	144,000	
アドウェイズ	2,300	811.00	1,865,300	
バリューコマース	1,100	4,585.00	5,043,500	
インフォマート	15,500	1,098.00	17,019,000	
ＪＰホールディングス	4,100	253.00	1,037,300	
エコナックホールディングス	2,800	98.00	274,400	
レッグス	300	1,599.00	479,700	
プレステージ・インターナショナル	5,300	785.00	4,160,500	
アミューズ	800	2,227.00	1,781,600	
ドリームインキュベータ	500	815.00	407,500	
クイック	900	1,387.00	1,248,300	
ＴＡＣ	800	239.00	191,200	
電通グループ	14,600	4,055.00	59,203,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,261.00	882,700	
ぴあ	400	3,920.00	1,568,000	
イオンファンタジー	600	1,850.00	1,110,000	
シーティーエス	1,600	801.00	1,281,600	
ネクシィーズグループ	500	894.00	447,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,000	2,835.00	11,340,000	
アルプス技研	1,300	2,071.00	2,692,300	
ダイオーズ	300	1,009.00	302,700	
日本空調サービス	1,500	797.00	1,195,500	
オリエンタルランド	15,100	18,010.00	271,951,000	
ダスキン	3,300	2,663.00	8,787,900	
明光ネットワークジャパン	1,700	582.00	989,400	
ファルコホールディングス	700	1,739.00	1,217,300	
秀英予備校	300	418.00	125,400	
ラウンドワン	4,800	1,392.00	6,681,600	

リゾートトラスト	6,500	2,021.00	13,136,500	
ビー・エム・エル	1,800	4,065.00	7,317,000	
りらいあコミュニケーションズ	2,200	1,200.00	2,640,000	
リソー教育	7,200	492.00	3,542,400	
早稲田アカデミー	600	1,001.00	600,600	
ユー・エス・エス	15,800	1,799.00	28,424,200	
東京個別指導学院	1,300	687.00	893,100	
サイバーエージェント	34,900	1,981.00	69,136,900	
楽天グループ	72,600	1,256.00	91,185,600	
クリーク・アンド・リバー社	700	2,000.00	1,400,000	
モーニングスター	2,100	527.00	1,106,700	
テー・オー・ダブリュー	2,600	334.00	868,400	
山田コンサルティンググループ	800	1,155.00	924,000	
セントラルスポーツ	500	2,420.00	1,210,000	
フルキャストホールディングス	1,200	2,639.00	3,166,800	
エン・ジャパン	2,500	4,640.00	11,600,000	
リソルホールディングス	200	4,110.00	822,000	
テクノプロ・ホールディングス	8,500	3,660.00	31,110,000	
アトラグループ	400	305.00	122,000	
インターワークス	500	405.00	202,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	10,990.00	6,594,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	900	3,375.00	3,037,500	
ファーストロジック	300	820.00	246,000	
三機サービス	300	1,067.00	320,100	
Ｇｕｎｏｓｙ	900	645.00	580,500	
デザインワン・ジャパン	400	240.00	96,000	
イー・ガーディアン	600	3,170.00	1,902,000	
リブセンス	900	250.00	225,000	
ジャパンマテリアル	4,300	1,549.00	6,660,700	
ベクトル	1,800	1,225.00	2,205,000	
ウチヤマホールディングス	700	369.00	258,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,100	1,780.00	1,958,000	
キャリアリンク	500	1,612.00	806,000	
ＩＢＪ	1,200	1,114.00	1,336,800	
アサンテ	500	1,754.00	877,000	
バリューＨＲ	600	1,824.00	1,094,400	

M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	6,470.00	7,764,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,413.00	847,800	
ＥＲＩホールディングス	400	1,587.00	634,800	
アビスト	200	2,876.00	575,200	
シグマクシス・ホールディングス	800	2,641.00	2,112,800	
ウィルグループ	1,100	1,298.00	1,427,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	213.00	468,600	
メドピア	1,100	3,500.00	3,850,000	
レアジョブ	300	1,293.00	387,900	
リクルートホールディングス	101,400	7,400.00	750,360,000	
エラン	2,000	1,235.00	2,470,000	
土木管理総合試験所	700	351.00	245,700	
ネットマーケティング	700	546.00	382,200	
日本郵政	107,000	878.60	94,010,200	
ベルシステム２４ホールディングス	2,400	1,533.00	3,679,200	
鎌倉新書	1,500	914.00	1,371,000	
ＳＭＮ	300	702.00	210,600	
一蔵	200	464.00	92,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	300	896.00	268,800	
エアトリ	900	3,920.00	3,528,000	
アトラエ	1,000	2,476.00	2,476,000	
ストライク	500	4,370.00	2,185,000	
ソラスト	3,500	1,384.00	4,844,000	
セラク	500	1,946.00	973,000	
インソース	1,400	2,332.00	3,264,800	
ベイカレント・コンサルティング	900	45,750.00	41,175,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	4,525.00	1,357,500	
アイモバイル	400	1,538.00	615,200	
キャリアインデックス	600	1,009.00	605,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	600	1,012.00	607,200	
船場	300	787.00	236,100	
グレイステクノロジー	1,500	1,057.00	1,585,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,100	2,431.00	9,967,100	
フルテック	200	1,468.00	293,600	
ツナググループ・ホールディングス	400	349.00	139,600	

ＧａｍｅＷｉｔｈ	400	506.00	202,400	
ソウルドアウト	300	1,497.00	449,100	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	731.00	219,300	
ウェルビー	500	1,619.00	809,500	
エル・ティー・エス	200	3,230.00	646,000	
ミダックホールディングス	600	5,630.00	3,378,000	
日総工産	1,100	733.00	806,300	
キュービーネットホールディングス	700	1,860.00	1,302,000	
ＲＰＡホールディングス	1,700	449.00	763,300	
スプリックス	400	1,201.00	480,400	
マネジメントソリューションズ	700	3,570.00	2,499,000	
プロレド・パートナーズ	300	1,359.00	407,700	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	400	458.00	183,200	
テノ．ホールディングス	200	828.00	165,600	
フロンティア・マネジメント	400	953.00	381,200	
ピアラ	300	712.00	213,600	
コプロ・ホールディングス	200	1,253.00	250,600	
ギークス	300	1,489.00	446,700	
カーブスホールディングス	3,900	894.00	3,486,600	
フォーラムエンジニアリング	1,000	948.00	948,000	
ダイレクトマーケティングミックス	800	4,550.00	3,640,000	
ポピンズホールディングス	300	3,225.00	967,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1,200	3,260.00	3,912,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	949.00	664,300	
リログループ	7,700	2,390.00	18,403,000	
東祥	900	1,866.00	1,679,400	
ＴＲＥホールディングス	1,900	1,896.00	3,602,400	
人・夢・技術グループ	600	1,970.00	1,182,000	
エイチ・アイ・エス	3,100	2,493.00	7,728,300	
ラックランド	400	2,880.00	1,152,000	
共立メンテナンス	2,300	4,135.00	9,510,500	
イチネンホールディングス	1,500	1,370.00	2,055,000	
建設技術研究所	800	2,708.00	2,166,400	
スペース	1,000	932.00	932,000	
燦ホールディングス	600	1,505.00	903,000	
スバル興業	100	8,120.00	812,000	

東京テアトル	600	1,240.00	744,000	
タナベ経営	600	745.00	447,000	
ナガワ	500	10,980.00	5,490,000	
東京都競馬	1,100	4,335.00	4,768,500	
常磐興産	600	1,420.00	852,000	
カナモト	2,500	2,438.00	6,095,000	
西尾レントオール	1,300	2,793.00	3,630,900	
トランス・コスモス	1,300	3,490.00	4,537,000	
乃村工藝社	6,100	1,116.00	6,807,600	
藤田観光	600	2,357.00	1,414,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	800	1,636.00	1,308,800	
日本管財	1,500	2,682.00	4,023,000	
トーカイ	1,400	2,237.00	3,131,800	
セコム	13,900	7,839.00	108,962,100	
セントラル警備保障	700	2,838.00	1,986,600	
丹青社	2,700	932.00	2,516,400	
メイテック	1,700	6,690.00	11,373,000	
応用地質	1,600	1,727.00	2,763,200	
船井総研ホールディングス	2,900	3,165.00	9,178,500	
進学会ホールディングス	600	414.00	248,400	
オオバ	1,000	820.00	820,000	
いであ	400	2,059.00	823,600	
学究社	400	1,385.00	554,000	
ベネッセホールディングス	5,200	2,606.00	13,551,200	
イオンディライト	1,700	3,460.00	5,882,000	
ナック	700	977.00	683,900	
ダイセキ	2,800	5,460.00	15,288,000	
ステップ	500	1,878.00	939,000	
合　　計	16,105,200		41,021,026,450	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	811,466,919	1,114,800,728
コール・ローン	1,426,733,123	1,256,678,700
株式	223,415,541,666	245,047,142,640
投資証券	5,334,508,523	5,776,317,242
派生商品評価勘定	60,104,909	115,983,661
未収入金	39,451,273	35,090,957
未収配当金	164,265,623	150,233,334
差入委託証拠金	522,276,550	619,735,003
流動資産合計	231,774,348,586	254,115,982,265
資産合計	231,774,348,586	254,115,982,265
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,849,511	410,255
未払金	20,085,890	-
未払解約金	51,950,784	59,987,211
未払利息	398	502
流動負債合計	98,886,583	60,397,968
負債合計	98,886,583	60,397,968
純資産の部		
元本等		
元本	81,609,225,737	61,697,952,086
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	150,066,236,266	192,357,632,211
元本等合計	231,675,462,003	254,055,584,297
純資産合計	231,675,462,003	254,055,584,297
負債純資産合計	231,774,348,586	254,115,982,265

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	（1）デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 （2）為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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10月26日現在	2021年10月26日現在
1．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	70,689,493,098円	81,609,225,737円
	期首からの追加設定元本額	33,463,538,387円	5,464,327,155円
	期首からの一部解約元本額	22,543,805,748円	25,375,600,806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）	21,291,664,890円	25,040,493,433円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	125,790,854円	114,212,302円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	326,099,287円	306,565,733円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	617,768,856円	606,000,742円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	633,127,496円	652,726,376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	1,788,005,391円	1,505,111,876円
	日興五大陸株式ファンド	4,619,536,139円	3,965,095,222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）	60,652,390円	19,546,879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）	128,258,002円	104,560,092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）	6,659,771,936円	6,102,747,886円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	37,356,692,620円	16,508,539,257円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,543,408円	3,671,912円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	3,735,838円	3,199,083円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	5,328,950円	4,003,307円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	4,847,044円	3,267,649円

	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,412,350,660円	2,406,816,230円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	26,570,843円	19,521,661円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	72,789,091円	57,058,720円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	108,320,390円	88,910,634円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	101,730,297円	84,283,948円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,261,641,355円	4,101,619,144円
	計	81,609,225,737円	61,697,952,086円
２．	受益権の総数	81,609,225,737口	61,697,952,086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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	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。	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10月26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	18,727,141,737
投資証券	△798,775,961
合計	17,928,365,776

（2021年10月26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	55,907,720,977
投資証券	1,338,897,771
合計	57,246,618,748

(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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,874,303,434	－	2,916,807,732	42,504,298
合計		2,874,303,434	－	2,916,807,732	42,504,298

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,142,497,754	－	3,227,480,865	84,983,111
合計		3,142,497,754	－	3,227,480,865	84,983,111

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,560,728,900	－	1,551,480,000	△9,248,900

	米ドル	1,275,820,800	－	1,266,193,000	△9,627,800
	ユーロ	284,908,100	－	285,287,000	378,900
合計		1,560,728,900	－	1,551,480,000	△9,248,900

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,384,511,650	－	1,415,107,120	30,595,470
	米ドル	1,031,861,900	－	1,058,362,900	26,501,000
	ユーロ	352,649,750	－	356,744,220	4,094,470
	売建	36,016,988	－	36,022,163	△5,175
	英ポンド	36,016,988	－	36,022,163	△5,175
合計		1,420,528,638	－	1,451,129,283	30,590,295

（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。

①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。

②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10月26日現在		2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.8388円	1口当たり純資産額	4.1177円
(1万口当たり純資産額)	(28,388円)	(1万口当たり純資産額)	(41,177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	28,155	25.16	708,379.80	
	CHENIERE ENERGY INC	9,780	108.00	1,056,240.00	
	CHEVRON CORP	74,641	113.85	8,497,877.85	
	CONOCOPHILLIPS	52,316	76.52	4,003,220.32	
	COTERRA ENERGY INC	26,800	22.56	604,608.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	26,280	40.66	1,068,544.80	
	EOG RESOURCES INC	22,662	94.04	2,131,134.48	
	EXXON MOBIL CORP	163,831	64.35	10,542,524.85	
	HALLIBURTON CO	34,687	26.22	909,493.14	
	HESS CORP	10,910	88.50	965,535.00	
	KINDER MORGAN INC	80,380	17.85	1,434,783.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	25,782	68.20	1,758,332.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	36,251	35.22	1,276,760.22	
	ONEOK INC	17,040	65.87	1,122,424.80	
	PHILLIPS 66	16,825	83.73	1,408,757.25	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,570	192.69	1,651,353.30	
	SCHLUMBERGER LTD	54,581	34.36	1,875,403.16	
	VALERO ENERGY CORP	15,632	82.69	1,292,610.08	
	WILLIAMS COS INC	48,344	28.80	1,392,307.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,725	293.92	2,564,452.00	
	ALBEMARLE CORP	4,600	239.44	1,101,424.00	
	AMCOR PLC	63,210	12.08	763,576.80	
	AVERY DENNISON CORP	3,200	218.02	697,664.00	
	BALL CORP	12,670	87.48	1,108,371.60	
	CELANESE CORP	3,930	171.41	673,641.30	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,060	59.13	476,587.80	
	CORTEVA INC	29,012	42.52	1,233,590.24	
	CROWN HOLDINGS INC	5,235	101.06	529,049.10	

DOW INC	28,855	58.71	1,694,077.05	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,392	71.93	1,466,796.56	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	108.79	554,285.05	
ECOLAB INC	10,060	221.56	2,228,893.60	
FMC CORP	5,140	93.24	479,253.60	
FREEPORT-MCMORAN INC	57,418	39.34	2,258,824.12	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,510	52.98	768,739.80	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	146.34	1,411,449.30	
LINDE PLC	20,220	316.68	6,403,269.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	97.61	980,980.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,425	393.79	954,940.75	
MOSAIC CO/THE	14,870	42.43	630,934.10	
NEWMONT CORP	31,042	57.91	1,797,642.22	
NUCOR CORP	11,709	109.42	1,281,198.78	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	133.92	479,433.60	
PPG INDUSTRIES INC	9,114	160.07	1,458,877.98	
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	87.93	491,528.70	
SEALED AIR CORP	6,376	59.29	378,033.04	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,831	309.72	3,044,857.32	
STEEL DYNAMICS INC	7,510	67.09	503,845.90	
VULCAN MATERIALS CO	5,383	190.87	1,027,453.21	
WESTROCK CO	10,519	48.57	510,907.83	
3M CO	22,486	182.40	4,101,446.40	
ALLEGION PLC	3,850	131.11	504,773.50	
AMETEK INC	8,943	130.49	1,166,972.07	
BOEING CO/THE	21,402	212.87	4,555,843.74	
CARRIER GLOBAL CORP	31,848	54.60	1,738,900.80	
CATERPILLAR INC	21,256	202.21	4,298,175.76	
CUMMINS INC	5,675	241.36	1,369,718.00	
DEERE & CO	11,550	352.72	4,073,916.00	
DOVER CORP	5,350	168.64	902,224.00	
EATON CORP PLC	15,806	162.51	2,568,633.06	
EMERSON ELECTRIC CO	23,260	96.55	2,245,753.00	
FASTENAL CO	21,616	56.15	1,213,738.40	
FORTIVE CORP	13,254	74.38	985,832.52	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,570	97.25	541,682.50	
GENERAC HOLDINGS INC	2,530	470.12	1,189,403.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,452	207.91	1,965,165.32	
GENERAL ELECTRIC CO	42,587	105.30	4,484,411.10	
HEICO CORP	2,000	139.99	279,980.00	
HEICO CORP-CLASS A	2,480	124.59	308,983.20	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,986	217.54	5,870,534.44	
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	30.37	443,493.11	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,800	212.48	382,464.00	
IDEX CORP	2,830	221.19	625,967.70	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,195	225.51	2,750,094.45	
INGERSOLL-RAND INC	15,268	54.55	832,869.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,370	56.82	532,403.40	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,824	73.95	2,057,584.80	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,205	244.27	2,004,235.35	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	304.29	426,006.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,616	376.33	3,618,789.28	
MASCO CORP	8,979	61.51	552,298.29	
NORDSON CORP	2,010	256.13	514,821.30	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,884	406.62	2,392,552.08	
OTIS WORLDWIDE CORP	16,004	81.86	1,310,087.44	
OWENS CORNING	4,030	91.55	368,946.50	
PACCAR INC	14,054	87.23	1,225,930.42	
PARKER HANNIFIN CORP	4,895	303.90	1,487,590.50	
PENTAIR PLC	5,588	76.93	429,884.84	
PLUG POWER INC	19,000	34.88	662,720.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	58,836	91.30	5,371,726.80	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	315.68	1,358,371.04	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,030	487.92	1,966,317.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	56.70	366,849.00	
SMITH (A.O.) CORP	4,770	66.82	318,731.40	
SNAP-ON INC	1,820	210.16	382,491.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,136	189.09	1,160,256.24	
SUNRUN INC	7,160	54.23	388,286.80	
TEXTRON INC	9,246	74.26	686,607.96	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,276	180.07	1,670,329.32	
TRANSDIGM GROUP INC	2,095	636.10	1,332,629.50	
UNITED RENTALS INC	2,820	366.26	1,032,853.20	
WABTEC CORP	5,780	92.91	537,019.80	
WW GRAINGER INC	1,607	435.83	700,378.81	
XYLEM INC	6,308	129.05	814,047.40	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,570	83.66	465,986.20	
CINTAS CORP	3,557	428.59	1,524,494.63	
CLARIVATE PLC	12,400	22.88	283,712.00	
COPART INC	8,140	153.28	1,247,699.20	
COSTAR GROUP INC	14,910	99.19	1,478,922.90	
EQUIFAX INC	4,654	274.78	1,278,826.12	
IHS MARKIT LTD	14,653	123.93	1,815,946.29	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,090	139.14	708,222.60	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,840	101.85	492,954.00	
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	131.26	1,067,143.80	
ROBERT HALF INTL INC	4,405	112.53	495,694.65	
ROLLINS INC	9,015	39.25	353,838.75	
TRANSUNION	7,140	118.18	843,805.20	
VERISK ANALYTICS INC	5,940	212.02	1,259,398.80	
WASTE CONNECTIONS INC	10,626	131.99	1,402,525.74	
WASTE MANAGEMENT INC	16,744	161.15	2,698,295.60	
AMERCO	375	720.60	270,225.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,150	98.19	505,678.50	
CSX CORP	88,179	35.73	3,150,635.67	
DELTA AIR LINES INC	5,105	39.51	201,698.55	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	123.36	805,170.72	
FEDEX CORP	9,893	235.40	2,328,812.20	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	197.73	648,554.40	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,640	302.38	1,100,663.20	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,180	55.48	342,866.40	
LYFT INC-A	9,660	48.12	464,839.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,830	287.33	2,824,453.90	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,995	324.70	1,297,176.50	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	47.48	259,715.60	

UBER TECHNOLOGIES INC	46,970	45.72	2,147,468.40	
UNION PACIFIC CORP	25,616	240.28	6,155,012.48	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,987	203.90	5,706,549.30	
APTIV PLC	10,120	170.29	1,723,334.80	
AUTOLIV INC	2,540	93.63	237,820.20	
BORGWARNER INC	9,890	45.49	449,896.10	
FORD MOTOR COMPANY	147,595	16.00	2,361,520.00	
GENERAL MOTORS CORP	51,505	57.76	2,974,928.80	
LEAR CORP	2,710	168.85	457,583.50	
TESLA INC	31,675	1,024.86	32,462,440.50	
DR HORTON INC	13,386	88.57	1,185,598.02	
GARMIN LTD	5,865	164.06	962,211.90	
HASBRO INC	5,298	88.50	468,873.00	
LENNAR CORP-CL A	10,480	100.31	1,051,248.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,650	427.94	1,989,921.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,458	193.59	475,844.22	
NEWELL BRANDS INC	16,126	22.47	362,351.22	
NIKE INC -CL B	49,248	164.22	8,087,506.56	
NVR INC	135	4,878.42	658,586.70	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,230	96.60	988,218.00	
PULTE GROUP INC	10,010	49.86	499,098.60	
VF CORP	13,620	70.73	963,342.60	
WHIRLPOOL CORP	2,644	208.37	550,930.28	
AIRBNB INC-CLASS A	4,500	169.24	761,580.00	
ARAMARK	7,800	36.74	286,572.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,583	2,412.98	3,819,747.34	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,990	111.94	894,400.60	
CARNIVAL CORP	31,027	22.05	684,145.35	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,105	1,774.98	1,961,352.90	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	143.48	723,569.64	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	466.24	713,347.20	
DRAFTKINGS INC - CL A	11,440	46.82	535,620.80	
EXPEDIA GROUP INC	5,422	161.44	875,327.68	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,920	142.17	1,552,496.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	14,900	37.99	566,051.00	

MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,603	154.79	1,641,238.37	
MCDONALD'S CORP	28,781	237.34	6,830,882.54	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,080	11.21	90,576.80	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,870	48.15	619,690.50	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	84.91	742,792.68	
STARBUCKS CORP	45,394	114.71	5,207,145.74	
VAIL RESORTS INC	1,520	352.16	535,283.20	
WYNN RESORTS LTD	3,510	90.42	317,374.20	
YUM! BRANDS INC	11,624	125.94	1,463,926.56	
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,290	81.19	2,459,245.10	
ALPHABET INC-CL A	11,640	2,748.94	31,997,661.60	
ALPHABET INC-CL C	11,262	2,775.46	31,257,230.52	
ALTICE USA INC- A	10,600	18.04	191,224.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	18,100	36.83	666,623.00	
CABLE ONE INC	225	1,786.49	401,960.25	
CHARTER COMMUNICATION-A	5,121	731.01	3,743,502.21	
COMCAST CORP-CLASS A	177,664	54.08	9,608,069.12	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,790	25.29	146,429.10	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	24.40	302,804.00	
DISH NETWORK CORP-A	9,279	43.59	404,471.61	
ELECTRONIC ARTS INC	11,034	142.19	1,568,924.46	
FACEBOOK INC-CLASS A	92,680	328.69	30,462,989.20	
FOX CORP - CLASS A	14,464	41.83	605,029.12	
FOX CORP- CLASS B	5,466	38.93	212,791.38	
IAC/INTERACTIVECORP	3,330	156.76	522,010.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,536	36.15	489,326.40	
LIBERTY BROADBAND-A	740	172.55	127,687.00	
LIBERTY BROADBAND-C	5,870	175.69	1,031,300.30	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	48.93	162,692.25	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,616	48.96	323,919.36	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,970	55.50	386,835.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,060	100.52	609,151.20	
MATCH GROUP INC	9,892	167.65	1,658,393.80	
NETFLIX INC	17,155	671.66	11,522,327.30	
NEWS CORP - CLASS A	16,580	24.16	400,572.80	

OMNICOM GROUP	8,337	70.18	585,090.66	
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	50.68	1,061,746.00	
ROKU INC	4,350	323.19	1,405,876.50	
SEA LTD-ADR	2,500	348.32	870,800.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.04	285,329.60	
SNAP INC - A	36,810	54.50	2,006,145.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	4,450	182.99	814,305.50	
THE WALT DISNEY CO.	70,322	172.01	12,096,087.22	
TWITTER INC	30,850	62.11	1,916,093.50	
VIACOMCBS INC - CLASS B	22,823	37.61	858,373.03	
ZILLOW GROUP INC - A	2,710	96.36	261,135.60	
ZILLOW GROUP INC - C	5,760	95.43	549,676.80	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,488	230.13	572,563.44	
AMAZON.COM INC	17,560	3,320.37	58,305,697.20	
AUTOZONE INC	847	1,821.09	1,542,463.23	
BATH & BODY WORKS INC	10,670	70.94	756,929.80	
BEST BUY CO INC	9,014	120.48	1,086,006.72	
BURLINGTON STORES INC	2,430	276.99	673,085.70	
CARMAX INC	6,249	139.97	874,672.53	
CARVANA CO	2,950	292.23	862,078.50	
CHEWY INC - CLASS A	3,410	67.95	231,709.50	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,120	222.49	2,029,108.80	
DOLLAR TREE INC	9,296	105.02	976,265.92	
DOORDASH INC - A	2,530	216.33	547,314.90	
EBAY INC	26,367	80.57	2,124,389.19	
ETSY INC	4,980	252.57	1,257,798.60	
GENUINE PARTS CO	5,611	133.54	749,292.94	
HOME DEPOT INC	41,080	371.26	15,251,360.80	
LKQ CORP	10,810	56.59	611,737.90	
LOWE'S COS INC	27,462	231.82	6,366,240.84	
MERCADOLIBRE INC	1,740	1,536.51	2,673,527.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,695	661.34	1,782,311.30	
POOL CORP	1,460	508.62	742,585.20	
ROSS STORES INC	13,722	113.12	1,552,232.64	
TARGET CORP	19,200	260.35	4,998,720.00	

TJX COMPANIES INC	46,716	65.26	3,048,686.16	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,490	211.03	947,524.70	
ULTA BEAUTY INC	2,010	371.00	745,710.00	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	235.13	667,769.20	
COSTCO WHOLESALE CORP	17,164	490.10	8,412,076.40	
KROGER CO	28,230	40.33	1,138,515.90	
SYSCO CORP	19,886	78.05	1,552,102.30	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28,602	49.22	1,407,790.44	
WALMART INC	59,872	150.06	8,984,392.32	
ALTRIA GROUP INC	71,708	47.95	3,438,398.60	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,383	66.63	1,424,749.29	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	340	506.38	172,169.20	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	69.36	810,124.80	
BUNGE LTD	5,457	88.32	481,962.24	
CAMPBELL SOUP CO	6,835	40.20	274,767.00	
COCA-COLA CO/THE	158,052	54.23	8,571,159.96	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	52.12	430,511.20	
CONAGRA BRANDS INC	19,470	32.89	640,368.30	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,690	217.69	1,456,346.10	
GENERAL MILLS INC	23,449	61.89	1,451,258.61	
HERSHEY CO/THE	5,715	180.23	1,030,014.45	
HORMEL FOODS CORP	11,500	41.95	482,425.00	
JM SMUCKER CO/THE	4,760	123.14	586,146.40	
KELLOGG CO	10,528	61.73	649,893.44	
KEURIG DR PEPPER INC	27,050	34.44	931,602.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	26,891	36.22	973,992.02	
LAMB WESTON HOLDING INC	5,990	58.40	349,816.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,410	80.68	839,878.80	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,330	43.76	364,520.80	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,985	60.34	3,257,454.90	
MONSTER BEVERAGE CORP	15,600	84.38	1,316,328.00	
PEPSICO INC	53,311	159.22	8,488,177.42	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	60,068	96.54	5,798,964.72	
TYSON FOODS INC-CL A	11,216	83.29	934,180.64	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,680	83.76	810,796.80	

CLOROX COMPANY	4,916	161.64	794,622.24	
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,950	75.14	2,250,443.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,110	330.06	3,006,846.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	13,023	130.11	1,694,422.53	
PROCTER & GAMBLE CO	94,689	140.85	13,336,945.65	
ABBOTT LABORATORIES	68,726	126.58	8,699,337.08	
ABIOMED INC	1,770	354.02	626,615.40	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	589.81	1,675,060.40	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	122.60	707,892.40	
ANTHEM INC	9,426	434.56	4,096,162.56	
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,619	81.36	1,596,201.84	
BECTON DICKINSON AND CO	11,247	246.41	2,771,373.27	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,988	44.49	2,357,436.12	
CARDINAL HEALTH INC	11,355	48.73	553,329.15	
CENTENE CORP	22,967	67.97	1,561,066.99	
CERNER CORP	11,120	71.63	796,525.60	
CIGNA CORP	13,150	215.62	2,835,403.00	
COOPER COS INC/THE	1,840	414.95	763,508.00	
CVS HEALTH CORP	51,098	87.68	4,480,272.64	
DANAHER CORP	24,969	306.10	7,643,010.90	
DAVITA INC	2,648	113.86	301,501.28	
DENTSPLY SIRONA INC	9,332	57.27	534,443.64	
DEXCOM INC	3,710	568.34	2,108,541.40	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,040	117.30	2,819,892.00	
HCA HEALTHCARE INC	10,405	241.81	2,516,033.05	
HENRY SCHEIN INC	5,040	76.21	384,098.40	
HOLOGIC INC	10,298	73.03	752,062.94	
HUMANA INC	4,975	463.42	2,305,514.50	
IDEXX LABORATORIES INC	3,270	652.52	2,133,740.40	
INSULET CORP	2,710	302.20	818,962.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	13,800	343.59	4,741,542.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,875	281.07	1,089,146.25	
MASIMO CORP	2,020	285.47	576,649.40	
MCKESSON CORP	6,284	207.45	1,303,615.80	
MEDTRONIC PLC	51,988	123.56	6,423,637.28	

MOLINA HEALTHCARE INC	2,360	297.60	702,336.00	
NOVOCURE LTD	3,430	119.29	409,164.70	
OAK STREET HEALTH INC	3,420	46.27	158,243.40	
QUEST DIAGNOSTICS	5,246	145.01	760,722.46	
RESMED INC	5,630	267.98	1,508,727.40	
STERIS PLC	3,620	235.37	852,039.40	
STRYKER CORP	13,073	273.05	3,569,582.65	
TELADOC HEALTH INC	5,180	141.98	735,456.40	
TELEFLEX INC	1,760	376.90	663,344.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,435	449.49	16,377,168.15	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	133.69	403,743.80	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,350	321.65	1,720,827.50	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,920	417.43	1,218,895.60	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,952	151.03	1,200,990.56	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,770	168.75	467,437.50	
ABBVIE INC	68,216	108.50	7,401,436.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,700	158.34	1,852,578.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,740	199.67	946,435.80	
AMGEN INC	22,141	207.63	4,597,135.83	
AVANTOR INC	21,080	37.90	798,932.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	770.48	662,612.80	
BIO-TECHNE CORP	1,480	510.83	756,028.40	
BIOGEN INC	5,823	269.94	1,571,860.62	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,570	73.51	556,470.70	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	86,105	57.81	4,977,730.05	
CATALENT INC	6,520	130.89	853,402.80	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	423.82	809,496.20	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	33.97	561,388.22	
ELI LILLY & CO	31,554	245.05	7,732,307.70	
EXACT SCIENCES CORP	6,990	93.67	654,753.30	
GILEAD SCIENCES INC	48,454	67.67	3,278,882.18	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,280	116.07	961,059.60	
ILLUMINA INC	5,665	420.78	2,383,718.70	
INCYTE CORP	7,110	66.75	474,592.50	
IQVIA HOLDINGS INC	7,453	257.25	1,917,284.25	

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	142.68	318,176.40	
JOHNSON & JOHNSON	101,791	164.08	16,701,867.28	
MERCK & CO. INC.	97,673	81.66	7,975,977.18	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	930	1,470.72	1,367,769.60	
MODERNA INC	13,215	349.56	4,619,435.40	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	102.55	372,256.50	
NOVAVAX INC	2,600	135.35	351,910.00	
PERKINELMER INC	4,550	177.19	806,214.50	
PFIZER INC	216,590	43.15	9,345,858.50	
PPD INC	5,510	46.98	258,859.80	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,060	576.20	2,339,372.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,460	37.67	243,348.20	
SEAGEN INC	5,140	175.52	902,172.80	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	10.12	441,130.80	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,209	607.75	9,243,269.75	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,980	184.99	1,846,200.20	
VIATRIS INC	48,469	13.80	668,872.20	
WATERS CORP	2,336	366.58	856,330.88	
ZOETIS INC	18,340	211.52	3,879,276.80	
BANK OF AMERICA CORP	298,319	47.51	14,173,135.69	
CITIGROUP INC	79,667	70.83	5,642,813.61	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,580	50.31	783,829.80	
FIFTH THIRD BANCORP	27,119	45.58	1,236,084.02	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	215.58	1,455,165.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	56,330	16.64	937,331.20	
JPMORGAN CHASE & CO	117,050	170.94	20,008,527.00	
KEYCORP	39,428	24.07	949,031.96	
M & T BANK CORP	5,223	159.00	830,457.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,460	216.56	3,564,577.60	
REGIONS FINANCIAL CORP	37,044	24.22	897,205.68	
SVB FINANCIAL GROUP	2,225	746.01	1,659,872.25	
TRUIST FINANCIAL CORP	51,850	64.57	3,347,954.50	
US BANCORP	54,831	62.52	3,428,034.12	
WELLS FARGO & CO	160,740	50.62	8,136,658.80	
ALLY FINANCIAL INC	14,000	51.36	719,040.00	

AMERICAN EXPRESS CO	26,504	182.31	4,831,944.24	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,190	298.00	1,248,620.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,220	79.96	577,311.20	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,912	59.40	1,954,972.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,255	290.26	14,877,276.30	
BLACKROCK INC	5,900	924.74	5,455,966.00	
BLACKSTONE INC	26,500	139.57	3,698,605.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,475	168.68	2,947,683.00	
CARLYLE GROUP INC/THE	6,890	55.63	383,290.70	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	129.40	509,836.00	
CME GROUP INC	13,850	217.69	3,015,006.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,120	123.86	1,501,183.20	
EQUITABLE HOLDINGS INC	17,100	33.78	577,638.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,460	432.77	631,844.20	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,475	31.11	388,097.25	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	73.51	132,318.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,193	414.75	5,471,796.75	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,660	133.04	2,881,646.40	
INVESCO LTD	13,527	24.75	334,793.25	
KKR & CO INC -A	20,050	74.86	1,500,943.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	407.25	578,295.00	
MOODY'S CORP	6,482	385.10	2,496,218.20	
MORGAN STANLEY	54,203	101.91	5,523,827.73	
MSCI INC	3,245	652.03	2,115,837.35	
NASDAQ INC	4,485	201.50	903,727.50	
NORTHERN TRUST CORP	7,980	123.39	984,652.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,640	102.00	779,280.00	
S&P GLOBAL INC	9,297	447.37	4,159,198.89	
SCHWAB (CHARLES) CORP	56,083	82.89	4,648,719.87	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	63.99	294,673.95	
STATE STREET CORP	13,667	98.60	1,347,566.20	
SYNCHRONY FINANCIAL	22,800	48.89	1,114,692.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,005	206.69	1,861,243.45	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	86.40	376,704.00	
VOYA FINANCIAL INC	5,580	68.72	383,457.60	

AFLAC INC	25,764	56.98	1,468,032.72	
ALLEGHANY CORP	500	678.82	339,410.00	
ALLSTATE CORP	11,633	129.00	1,500,657.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	137.71	399,359.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,935	59.64	1,964,243.40	
AON PLC	8,722	320.11	2,791,999.42	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,245	43.34	660,718.30	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,150	164.25	1,338,637.50	
ASSURANT INC	2,300	164.58	378,534.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	5,510	90.11	496,506.10	
BROWN & BROWN INC	9,690	66.46	643,997.40	
CHUBB LTD	17,315	188.07	3,256,432.05	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,230	123.44	769,031.20	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	200.87	239,035.30	
EVEREST RE GROUP LTD	1,384	282.64	391,173.76	
FNF GROUP	11,561	49.77	575,390.97	
GLOBE LIFE INC	3,246	92.75	301,066.50	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,892	73.80	1,025,229.60	
LINCOLN NATIONAL CORP	7,533	75.72	570,398.76	
LOEWS CORP	7,055	57.66	406,791.30	
MARKEL CORP	525	1,330.53	698,528.25	
MARSH & MCLENNAN COS	19,693	169.13	3,330,677.09	
METLIFE INC	29,225	65.64	1,918,329.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,890	69.64	758,379.60	
PROGRESSIVE CORP	22,550	96.35	2,172,692.50	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,222	113.81	1,732,415.82	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,847	149.78	276,643.66	
TRAVELERS COS INC/THE	9,844	161.58	1,590,593.52	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,968	244.81	1,216,216.08	
WR BERKLEY CORP	5,394	81.94	441,984.36	
CBRE GROUP INC - A	13,200	104.90	1,384,680.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	5.16	253,872.00	
ACCENTURE PLC-CL A	24,588	356.44	8,764,146.72	
ADOBE INC	18,484	646.97	11,958,593.48	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,350	107.57	683,069.50	

ANSYS INC	3,480	374.21	1,302,250.80	
AUTODESK INC	8,570	311.79	2,672,040.30	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,491	218.07	3,596,192.37	
AVALARA INC	3,310	181.11	599,474.10	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,340	58.41	370,319.40	
BLACK KNIGHT INC	6,530	73.17	477,800.10	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,630	183.43	849,280.90	
CADENCE DESIGN SYS INC	10,900	167.37	1,824,333.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,570	128.99	718,474.30	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,320	122.37	528,638.40	
CITRIX SYSTEMS INC	5,028	98.58	495,660.24	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	8,850	189.41	1,676,278.50	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,848	78.96	1,646,158.08	
COUPA SOFTWARE INC	2,800	243.47	681,716.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,170	280.10	2,008,317.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,400	182.43	255,402.00	
DATADOG INC-CLASS A	7,240	161.58	1,169,839.20	
DOCUSIGN INC	7,340	277.86	2,039,492.40	
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	30.93	331,260.30	
DYNATRACE INC	6,630	77.81	515,880.30	
EPAM SYSTEMS INC	2,205	652.26	1,438,233.30	
FAIR ISAAC CORP	1,055	413.99	436,759.45	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,008	122.44	2,939,539.52	
FISERV INC	23,614	111.11	2,623,751.54	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,040	280.97	854,148.80	
FORTINET INC	5,470	331.91	1,815,547.70	
GARTNER INC	3,240	323.19	1,047,135.60	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,719	157.78	1,849,023.82	
GODADDY INC-CLASS A	7,040	69.99	492,729.60	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	125.31	359,639.70	
HUBSPOT INC	1,725	805.70	1,389,832.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,692	127.64	4,428,086.88	
INTUIT INC	10,616	602.56	6,396,776.96	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	174.05	494,302.00	
MASTERCARD INC	34,155	360.86	12,325,173.30	

MICROSOFT CORP	276,814	308.13	85,294,697.82	
MONGODB INC	2,200	518.87	1,141,514.00	
NORTONLIFELOCK INC	22,205	26.67	592,207.35	
OKTA INC	4,990	261.05	1,302,639.50	
ORACLE CORP	72,853	97.89	7,131,580.17	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	59,450	25.41	1,510,624.50	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,770	497.77	1,876,592.90	
PAYCHEX INC	12,572	123.18	1,548,618.96	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,995	538.93	1,075,165.35	
PAYPAL HOLDINGS INC	43,157	246.88	10,654,600.16	
PTC INC	4,690	129.36	606,698.40	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,220	244.69	787,901.80	
SALESFORCE.COM INC	37,556	293.92	11,038,459.52	
SERVICENOW INC	7,700	688.85	5,304,145.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,290	341.50	2,489,535.00	
SPLUNK INC	6,310	168.36	1,062,351.60	
SQUARE INC - A	15,200	262.00	3,982,400.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	74.99	635,165.30	
SYNOPSYS INC	5,817	324.00	1,884,708.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,150	76.11	1,305,286.50	
TWILIO INC - A	6,275	358.17	2,247,516.75	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,540	532.41	819,911.40	
UNITY SOFTWARE INC	1,950	145.99	284,680.50	
VERISIGN INC	3,900	219.52	856,128.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	65,352	233.88	15,284,525.76	
VMWARE INC	3,215	163.25	524,848.75	
WESTERN UNION CO	14,561	19.57	284,958.77	
WIX.COM LTD	2,280	199.45	454,746.00	
WORKDAY INC-CLASS A	7,460	282.15	2,104,839.00	
ZENDESK INC	4,550	132.22	601,601.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,180	279.79	2,288,682.20	
ZSCALER INC	3,120	311.20	970,944.00	
AMPHENOL CORP-CL A	23,110	79.12	1,828,463.20	
APPLE INC	645,658	148.64	95,970,605.12	
ARISTA NETWORKS INC	2,180	386.04	841,567.20	

ARROW ELECTRONICS INC	2,750	120.40	331,100.00	
CDW CORP/DE	5,590	191.54	1,070,708.60	
CISCO SYSTEMS INC	162,890	55.14	8,981,754.60	
COGNEX CORP	7,020	86.13	604,632.60	
CORNING INC	32,828	38.61	1,267,489.08	
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	112.29	1,142,213.88	
F5 NETWORKS INC	2,385	208.28	496,747.80	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,655	15.41	780,593.55	
HP INC	47,315	30.63	1,449,258.45	
IPG PHOTONICS CORP	1,310	159.64	209,128.40	
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	27.64	350,005.32	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,230	177.60	1,284,048.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,675	245.91	1,641,449.25	
NETAPP INC	8,146	93.10	758,392.60	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,924	89.16	706,503.84	
TE CONNECTIVITY LTD	12,555	147.69	1,854,247.95	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	445.07	778,872.50	
TRIMBLE INC	8,960	86.95	779,072.00	
WESTERN DIGITAL CORP	12,428	56.83	706,283.24	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,175	532.46	1,158,100.50	
AT&T INC	275,687	25.64	7,068,614.68	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,285	29.62	156,541.70	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,241	29.74	453,267.34	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	12.22	420,196.92	
T-MOBILE US INC	24,149	115.93	2,799,593.57	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	159,457	52.58	8,384,249.06	
AES CORP	27,718	25.17	697,662.06	
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	56.50	466,690.00	
AMEREN CORPORATION	10,942	84.73	927,115.66	
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,868	84.67	1,682,223.56	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	174.85	1,172,369.25	
ATMOS ENERGY CORP	4,880	94.20	459,696.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	22,262	26.77	595,953.74	
CMS ENERGY CORP	12,240	60.25	737,460.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	75.88	978,548.48	

DOMINION ENERGY INC	31,511	76.50	2,410,591.50	
DTE ENERGY COMPANY	8,018	115.65	927,281.70	
DUKE ENERGY CORP	29,786	102.84	3,063,192.24	
EDISON INTERNATIONAL	14,869	61.10	908,495.90	
ENTERGY CORP	7,127	103.79	739,711.33	
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	47.02	432,113.80	
EVERGY INC	8,720	64.23	560,085.60	
EVERSOURCE ENERGY	13,430	86.01	1,155,114.30	
EXELON CORP	38,386	51.59	1,980,333.74	
FIRSTENERGY CORP	22,345	37.37	835,032.65	
NEXTERA ENERGY INC	75,890	84.29	6,396,768.10	
NISOURCE INC	15,050	24.97	375,798.50	
NRG ENERGY INC	10,000	41.52	415,200.00	
P G & E CORP	60,460	11.66	704,963.60	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	67.07	297,053.03	
PPL CORP	29,828	29.00	865,012.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,888	63.93	1,207,509.84	
SEMPRA ENERGY	12,237	130.36	1,595,215.32	
SOUTHERN CO	40,925	62.81	2,570,499.25	
UGI CORP	7,720	44.66	344,775.20	
VISTRA CORP	18,240	19.50	355,680.00	
WEC ENERGY GROUP INC	12,040	90.38	1,088,175.20	
XCEL ENERGY INC	20,004	64.66	1,293,458.64	
ADVANCED MICRO DEVICES	47,180	122.36	5,772,944.80	
ANALOG DEVICES INC	20,847	180.52	3,763,300.44	
APPLIED MATERIALS INC	35,293	135.76	4,791,377.68	
BROADCOM INC	15,765	522.07	8,230,433.55	
ENPHASE ENERGY INC	4,930	179.43	884,589.90	
INTEL CORP	156,092	49.41	7,712,505.72	
KLA CORP	6,039	343.23	2,072,765.97	
LAM RESEARCH CORP	5,527	551.97	3,050,738.19	
MARVELL TECHNOLOGY INC	30,984	67.67	2,096,687.28	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,668	75.80	1,566,634.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	43,327	68.76	2,979,164.52	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,825	522.81	954,128.25	

	NVIDIA CORP	96,460	231.66	22,345,923.60	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,667	200.29	2,136,493.43	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,640	46.22	769,100.80	
	QORVO INC	4,600	167.32	769,672.00	
	QUALCOMM INC	43,822	131.93	5,781,436.46	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,210	165.18	1,025,767.80	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	311.92	625,399.60	
	TERADYNE INC	6,540	117.28	767,011.20	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	35,902	200.20	7,187,580.40	
	XILINX INC	9,455	175.31	1,657,556.05	
米ドル小計		12,199,158		1,570,599,896.68 (178,781,386,239)	
加ドル	CAMECO CORP	14,272	32.84	468,692.48	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	47,004	52.84	2,483,691.36	
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	14.81	817,260.23	
	ENBRIDGE INC	78,467	52.86	4,147,765.62	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	44.68	429,910.96	
	KEYERA CORP	8,460	31.94	270,212.40	
	PARKLAND CORP	6,170	37.11	228,968.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	22,402	41.88	938,195.76	
	SUNCOR ENERGY INC	59,939	29.12	1,745,423.68	
	TC ENERGY CORP	38,733	67.90	2,629,970.70	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	9,775	71.66	700,476.50	
	B2GOLD CORP	42,000	5.51	231,420.00	
	BARRICK GOLD CORP	66,724	24.23	1,616,722.52	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	67.79	389,792.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	30.75	696,487.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,635	178.93	1,366,130.55	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	21,000	9.80	205,800.00	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	8.00	368,200.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	10,600	56.93	603,458.00	
	LUNDIN MINING CORP	21,150	10.63	224,824.50	
	NUTRIEN LTD	21,648	87.46	1,893,334.08	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	8,780	32.89	288,774.20	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	35.34	635,236.50	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,700	105.31	389,647.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18,535	51.56	955,664.60	
YAMANA GOLD INC	32,800	5.44	178,432.00	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	8,330	20.42	170,098.60	
CAE INC	10,265	38.13	391,404.45	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,710	109.54	406,393.40	
WSP GLOBAL INC	4,030	171.60	691,548.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	5,730	51.21	293,433.30	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	84.91	343,036.40	
THOMSON REUTERS CORP	6,546	147.39	964,814.94	
AIR CANADA	7,190	23.06	165,801.40	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,538	165.42	4,555,335.96	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,835	92.93	2,400,846.55	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,858	99.77	1,183,072.66	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,420	45.37	291,275.40	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,318	72.88	897,735.84	
QUEBECOR INC -CL B	6,110	31.44	192,098.40	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	34.72	606,384.80	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	183.47	361,435.90	
DOLLARAMA INC	11,780	56.75	668,515.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	32,680	49.01	1,601,646.80	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	37.50	260,625.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	94.91	522,859.19	
METRO INC	7,760	63.03	489,112.80	
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	138.56	465,284.48	
SAPUTO INC	9,620	30.86	296,873.20	
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	35.93	455,736.12	
CANOPY GROWTH CORP	9,140	16.82	153,734.80	
BANK OF MONTREAL	24,181	137.26	3,319,084.06	
BANK OF NOVA SCOTIA	46,939	82.36	3,865,896.04	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	17,915	150.63	2,698,536.45	
NATIONAL BANK OF CANADA	12,680	103.60	1,313,648.00	
ROYAL BANK OF CANADA	55,479	132.45	7,348,193.55	
TORONTO-DOMINION BANK	70,510	89.54	6,313,465.40	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	49,649	76.17	3,781,764.33	

	IGM FINANCIAL INC	3,335	48.65	162,247.75	
	ONEX CORPORATION	2,765	97.75	270,278.75	
	TMX GROUP LTD	1,810	134.86	244,096.60	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,110	510.54	566,699.40	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	37.18	331,050.72	
	IA FINANCIAL CORP INC	3,895	75.25	293,098.75	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,995	169.54	1,185,932.30	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	79,501	25.12	1,997,065.12	
	POWER CORP OF CANADA	23,289	42.47	989,083.83	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,214	70.75	1,642,390.50	
	FIRSTSERVICE CORP	1,770	249.80	442,146.00	
	BLACKBERRY LTD	22,208	13.69	304,027.52	
	CGI INC	8,930	114.32	1,020,877.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	780	2,246.08	1,751,942.40	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	120.56	529,258.40	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	159.97	359,932.50	
	OPEN TEXT CORP	10,940	62.54	684,187.60	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	4,380	1,765.85	7,734,423.00	
	BCE INC	3,000	63.17	189,510.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,575	56.55	654,566.25	
	TELUS CORP	12,662	28.04	355,042.48	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	18.61	503,958.80	
	ALTAGAS LTD	9,000	26.48	238,320.00	
	ATCO LTD -CLASS I	2,300	40.76	93,748.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	49.48	269,418.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	34.99	159,554.40	
	EMERA INC	7,570	59.07	447,159.90	
	FORTIS INC	19,615	55.13	1,081,374.95	
	HYDRO ONE LTD	11,790	29.99	353,582.10	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	40.00	344,000.00	
加ドル小計		1,566,851		97,573,157.78 (8,968,924,663)	
ユーロ	ENI SPA	96,856	12.27	1,189,197.96	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	9.45	201,237.75	
	NESTE OYJ	16,390	51.06	836,873.40	

OMV AG	5,480	54.96	301,180.80	
REPSOL SA	57,649	11.67	673,225.02	
TENARIS SA	19,915	10.06	200,444.47	
TOTALENERGIES SE	96,487	43.92	4,238,191.47	
VOPAK	2,510	34.59	86,820.90	
AIR LIQUIDE SA	18,340	142.92	2,621,152.80	
AKZO NOBEL	6,827	96.74	660,443.98	
ARCELORMITTAL	28,822	28.42	819,265.35	
ARKEMA	2,205	117.80	259,749.00	
BASF SE	35,355	63.20	2,234,436.00	
COVESTRO AG	7,410	56.04	415,256.40	
CRH PLC	29,850	41.39	1,235,491.50	
EVONIK INDUSTRIES AG	8,540	28.40	242,536.00	
FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	42.82	124,178.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	64.08	366,217.20	
KONINKLIJKE DSM NV	6,552	187.15	1,226,206.80	
LANXESS AG	3,115	59.04	183,909.60	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,460	43.80	370,548.00	
SOLVAY SA	3,231	105.45	340,708.95	
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,305	14.41	278,281.57	
SYMRISE AG	5,370	117.15	629,095.50	
UMICORE	7,960	49.79	396,328.40	
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	30.92	605,042.56	
VOESTALPINE AG	4,249	32.16	136,647.84	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	22.80	239,080.80	
AIRBUS GROUP SE	22,688	108.08	2,452,119.04	
ALSTOM	11,635	30.90	359,521.50	
BOUYGUES SA	9,460	34.31	324,572.60	
BRENNTAG SE	6,075	82.30	499,972.50	
CNH INDUSTRIAL NV	42,250	15.22	643,045.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,596	59.88	1,173,408.48	
DASSAULT AVIATION SA	900	89.70	80,730.00	
EIFFAGE	3,250	87.82	285,415.00	
FERROVIAL SA	18,485	27.15	501,867.75	
GEA GROUP AG	6,680	40.63	271,408.40	

KINGSPAN GROUP PLC	6,260	96.18	602,086.80	
KION GROUP AG	2,284	87.92	200,809.28	
KNORR-BREMSE AG	2,970	91.80	272,646.00	
KONE OYJ-B	13,654	58.18	794,389.72	
LEGRAND SA	10,528	93.18	980,999.04	
MTU AERO ENGINES AG	2,020	181.15	365,923.00	
PRYSMIAN SPA	9,565	32.56	311,436.40	
RATIONAL AG	230	854.80	196,604.00	
SAFRAN SA	13,550	107.76	1,460,148.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,878	140.60	2,935,446.80	
SIEMENS AG-REG	29,506	139.02	4,101,924.12	
SIEMENS ENERGY AG	15,843	23.70	375,479.10	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	10,210	21.71	221,659.10	
THALES SA	3,745	81.32	304,543.40	
VINCI SA	20,460	89.95	1,840,377.00	
WARTSILA OYJ ABP	21,180	10.67	225,990.60	
BUREAU VERITAS SA	10,920	27.03	295,167.60	
RANDSTAD NV	4,965	61.94	307,532.10	
TELEPERFORMANCE	2,420	357.10	864,182.00	
WOLTERS KLUWER	10,377	92.00	954,684.00	
ADP	1,090	109.65	119,518.50	
AENA SA	2,870	139.60	400,652.00	
ATLANTIA SPA	18,740	16.20	303,588.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	5.47	130,719.12	
DEUTSCHE POST AG-REG	38,353	53.20	2,040,379.60	
GETLINK	14,730	13.22	194,804.25	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,235	87.54	1,158,591.90	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	72.55	124,786.00	
CONTINENTAL AG	4,385	97.55	427,756.75	
DAIMLER AG	33,212	82.89	2,752,942.68	
FAURECIA	4,256	42.33	180,156.48	
FERRARI NV	4,944	199.50	986,328.00	
MICHELIN (CGDE)-B	6,669	134.10	894,312.90	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	92.58	524,928.60	
RENAULT SA	6,837	30.97	211,776.07	

STELLANTIS NV	75,346	17.51	1,319,609.84	
VALEO SA	8,060	24.23	195,293.80	
VOLKSWAGEN AG	1,261	283.80	357,871.80	
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,183	205.25	1,474,310.75	
ADIDAS AG	7,331	277.35	2,033,252.85	
ESSILORLUXOTTICA	11,115	170.94	1,899,998.10	
HERMES INTERNATIONAL	1,232	1,344.00	1,655,808.00	
KERING	2,957	640.00	1,892,480.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,799	659.80	7,125,180.20	
MONCLER SPA	8,860	61.10	541,346.00	
PUMA SE	4,530	102.05	462,286.50	
SEB SA	847	124.50	105,451.50	
ACCOR SA	7,646	29.74	227,392.04	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,706	167.80	1,125,266.80	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	43.48	169,572.00	
SODEXO	4,090	75.88	310,349.20	
BOLLORE	33,530	5.07	170,164.75	
PUBLICIS GROUPE	8,645	56.54	488,788.30	
SCOUT24 SE	3,880	61.24	237,611.20	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	46.43	162,969.30	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	24.93	691,308.90	
VIVENDI SE	27,730	11.25	311,962.50	
DELIVERY HERO SE	6,050	112.35	679,717.50	
HELLOFRESH SE	6,070	79.62	483,293.40	
INDITEX	42,185	30.71	1,295,501.35	
JUST EAT TAKEAWAY	6,520	66.70	434,884.00	
PROSUS	36,130	76.64	2,769,003.20	
ZALANDO SE	8,260	80.00	660,800.00	
CARREFOUR SA	24,723	15.35	379,498.05	
COLRUYT SA	2,305	43.07	99,276.35	
JERONIMO MARTINS	9,035	19.30	174,420.67	
KESKO OYJ-B SHS	10,930	30.12	329,211.60	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	42,228	28.35	1,197,374.94	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	29,501	48.53	1,431,831.03	
DANONE	25,254	56.20	1,419,274.80	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,980	12.94	297,361.20	
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	77.10	310,327.50	
HEINEKEN NV	10,453	92.08	962,512.24	
JDE PEET'S NV	2,400	25.76	61,824.00	
KERRY GROUP PLC-A	5,880	117.90	693,252.00	
PERNOD-RICARD SA	8,076	199.70	1,612,777.20	
REMY COINTREAU	810	175.70	142,317.00	
BEIERSDORF AG	3,805	95.46	363,225.30	
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	70.80	317,892.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	75.96	487,131.48	
L'OREAL	9,916	383.85	3,806,256.60	
AMPLIFON SPA	5,620	44.54	250,314.80	
BIOMERIEUX	1,310	107.80	141,218.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	172.25	277,322.50	
DIASORIN SPA	930	191.05	177,676.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,273	61.90	512,098.70	
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,655	41.40	689,517.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,020	41.29	1,487,265.80	
ORPEA	1,790	90.92	162,746.80	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,080	567.80	613,224.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	59.76	671,104.80	
ARGENX SE	1,840	249.60	459,264.00	
BAYER AG-REG	36,384	48.45	1,762,986.72	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,460	102.90	561,834.00	
GRIFOLS SA	9,910	20.44	202,560.40	
IPSEN	1,350	89.00	120,150.00	
MERCK KGAA	5,130	203.20	1,042,416.00	
ORION OYJ-CLASS B	4,010	37.00	148,370.00	
QIAGEN N.V.	9,614	47.00	451,858.00	
RECORDATI SPA	3,920	52.72	206,662.40	
SANOFI	43,776	85.53	3,744,161.28	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,160	483.00	560,280.00	
UCB SA	4,928	101.30	499,206.40	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,360	12.90	172,397.44	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,873	5.70	1,487,236.97	

BANCO SANTANDER SA	682,749	3.31	2,265,702.55	
BNP PARIBAS	43,402	58.21	2,526,430.42	
CAIXABANK S.A	163,050	2.60	424,745.25	
COMMERZBANK AG	38,844	6.47	251,476.05	
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	13.05	531,927.55	
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	37.64	431,279.12	
FINECOBANK SPA	26,120	16.78	438,424.20	
ING GROEP NV-CVA	151,675	13.14	1,993,919.55	
INTESA SANPAOLO	643,893	2.46	1,585,908.45	
KBC GROEP NV	9,719	80.58	783,157.02	
MEDIOBANCA SPA	20,050	10.39	208,419.75	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,370	25.56	137,257.20	
SOCIETE GENERALE	31,389	28.71	901,178.19	
UNICREDIT SPA	83,846	11.33	950,310.56	
AMUNDI SA	2,140	77.70	166,278.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,855	11.64	953,283.33	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,250	144.25	1,045,812.50	
EURAZEO SE	1,877	81.45	152,881.65	
EXOR NV	3,424	79.42	271,934.08	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	99.18	402,869.16	
SOFINA	480	378.80	181,824.00	
WENDEL	1,000	113.20	113,200.00	
AEGON NV	77,949	4.53	353,420.76	
AGEAS	6,794	42.24	286,978.56	
ALLIANZ SE-REG	15,858	198.46	3,147,178.68	
ASSICURAZIONI GENERALI	38,748	18.69	724,200.12	
AXA SA	74,212	23.93	1,775,893.16	
CNP ASSURANCES	6,040	15.69	94,767.60	
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	154.35	351,146.25	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,566	246.90	1,374,245.40	
NN GROUP NV	9,940	46.00	457,240.00	
POSTE ITALIANE SPA	19,560	12.51	244,695.60	
SAMPO OYJ-A SHS	20,209	46.42	938,101.78	
SCOR SE	7,452	24.73	184,287.96	
AROUNDTOWN SA	33,520	6.00	201,321.12	

DEUTSCHE WOHNEN SE	12,300	51.90	638,370.00	
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	133.95	330,856.50	
VONOVIA SE	22,148	53.54	1,185,803.92	
ADYEN NV	775	2,679.00	2,076,225.00	
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	55.12	942,000.80	
ATOS SE	3,890	46.00	178,940.00	
BECHTLE AG	3,690	64.94	239,628.60	
CAP GEMINI SA	6,109	187.55	1,145,742.95	
DASSAULT SYSTEMES SE	25,890	46.79	1,211,393.10	
EDENRED	9,626	48.65	468,304.90	
NEMETSCHEK SE	1,790	101.05	180,879.50	
NEXI SPA	17,180	17.52	301,079.50	
SAP SE	40,272	123.74	4,983,257.28	
TEAMVIEWER AG	7,050	12.80	90,240.00	
WORLDLINE SA	8,950	66.50	595,175.00	
NOKIA OYJ	208,086	4.98	1,036,580.40	
CELLNEX TELECOM SA	20,330	53.98	1,097,413.40	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	129,336	16.28	2,105,848.75	
ELISA OYJ	5,465	53.06	289,972.90	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.67	146,724.24	
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	2.71	357,047.07	
ORANGE S.A.	76,994	9.60	739,527.37	
PROXIMUS	5,600	17.30	96,880.00	
TELECOM ITALIA SPA	317,713	0.33	106,815.11	
TELECOM ITALIA-RSP	198,057	0.34	68,290.05	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.29	74,388.77	
TELEFONICA SA	202,139	3.82	772,676.32	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	31.43	125,720.00	
E.ON SE	86,389	10.79	932,137.31	
EDF	16,905	12.83	216,975.67	
EDP RENOVAVEIS SA	10,400	23.78	247,312.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	113,771	4.89	556,909.04	
ELIA GROUP SA/NV	960	99.90	95,904.00	
ENAGAS SA	8,240	19.45	160,309.20	
ENDESA SA	10,710	19.01	203,650.65	

	ENEL SPA	315,597	7.06	2,228,430.41	
	ENGIE	70,164	12.08	848,002.10	
	FORTUM OYJ	16,415	27.12	445,174.80	
	IBERDROLA SA	228,062	9.65	2,200,798.30	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,072	21.94	199,039.68	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	17.69	340,001.80	
	RWE AG	24,615	32.59	802,202.85	
	SNAM SPA	79,380	4.89	388,565.10	
	SUEZ	13,289	19.76	262,590.64	
	TERNA SPA	49,057	6.45	316,417.65	
	UNIPER SE	3,530	38.41	135,587.30	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,600	28.23	694,458.00	
	VERBUND AG	2,780	95.90	266,602.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,840	359.50	661,480.00	
	ASML HOLDING NV	16,252	685.60	11,142,371.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	50,535	39.02	1,972,128.37	
	STMICROELECTRONICS NV	26,093	38.25	998,187.71	
ユーロ小計		7,262,167		190,288,900.23 (25,127,649,275)	
英ポンド	BP PLC	778,518	3.60	2,807,725.16	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	159,248	17.75	2,827,925.98	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	144,199	17.88	2,578,566.51	
	ANGLO AMERICAN PLC	50,684	28.12	1,425,487.50	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	14.81	212,227.30	
	BHP GROUP PLC	81,061	19.96	1,617,977.56	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	93.00	513,453.00	
	EVRAZ PLC	21,700	6.44	139,878.20	
	GLENCORE PLC	385,213	3.71	1,432,607.14	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,589	27.17	179,023.13	
	MONDI PLC	18,370	17.87	328,363.75	
	RIO TINTO PLC	43,185	47.66	2,058,413.02	
	ASHTEAD GROUP PLC	17,360	58.58	1,016,948.80	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	5.74	694,626.10	
	BUNZL PLC	13,836	25.86	357,798.96	
	DCC PLC	3,820	62.14	237,374.80	

FERGUSON PLC	8,792	107.50	945,140.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.59	260,429.25	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	1.32	425,494.48	
SMITHS GROUP PLC	15,443	13.90	214,657.70	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	154.65	402,090.00	
EXPERIAN PLC	35,428	32.86	1,164,164.08	
INTERTEK GROUP PLC	6,025	49.06	295,586.50	
RELX PLC	74,005	22.27	1,648,091.35	
RENTOKIL INITIAL PLC	78,900	5.93	467,877.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	6.46	263,051.20	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	42.62	192,429.30	
BURBERRY GROUP PLC	14,144	18.89	267,250.88	
PERSIMMON PLC	13,570	26.29	356,755.30	
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.49	185,452.50	
COMPASS GROUP PLC	69,398	14.40	999,331.20	
ENTAIN PLC	21,400	21.37	457,318.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,893	48.58	383,441.94	
WHITBREAD PLC	8,260	31.55	260,603.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.00	219,098.88	
INFORMA PLC	56,580	5.17	292,971.24	
PEARSON PLC	26,259	6.29	165,274.14	
WPP PLC	50,104	9.43	472,681.13	
JD SPORTS FASHION PLC	19,470	10.64	207,258.15	
KINGFISHER PLC	88,337	3.43	303,437.59	
NEXT PLC	5,467	78.56	429,487.52	
OCADO GROUP PLC	20,060	18.27	366,496.20	
SAINSBURY (J) PLC	59,501	2.95	176,063.45	
TESCO PLC	304,518	2.73	833,465.76	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,945	17.51	261,686.95	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,407	25.83	2,180,232.81	
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	24.70	189,943.00	
DIAGEO PLC	90,042	36.20	3,259,970.61	
IMPERIAL BRANDS PLC	37,492	15.63	586,187.42	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,365	54.71	1,551,849.15	
UNILEVER PLC	100,962	38.79	3,916,820.79	

	NMC HEALTH PLC	8,090	—	—	
	SMITH & NEPHEW PLC	35,006	12.98	454,377.88	
	ASTRAZENECA PLC	59,792	89.42	5,346,600.64	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	193,531	14.24	2,757,042.62	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	24.59	189,097.10	
	BARCLAYS PLC	668,451	2.00	1,340,912.70	
	HSBC HOLDINGS PLC	787,061	4.43	3,487,073.76	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,737,436	0.48	1,335,184.40	
	NATWEST GROUP PLC	207,830	2.32	482,165.60	
	STANDARD CHARTERED PLC	109,730	4.89	536,689.43	
	3I GROUP PLC	36,819	13.26	488,404.03	
	ABRDN PLC	88,515	2.56	227,395.03	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	15.58	202,916.70	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,727	74.48	947,906.96	
	M&G PLC	99,522	1.96	195,710.01	
	SCHRODERS PLC	4,131	35.64	147,228.84	
	ST JAMES'S PLACE PLC	19,260	15.54	299,300.40	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,505	30.32	197,231.60	
	AVIVA PLC	158,565	3.96	629,185.92	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	51,053	2.82	144,020.51	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	237,501	2.82	670,465.32	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	6.59	163,547.52	
	PRUDENTIAL PLC	102,232	14.64	1,496,676.48	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	36.43	164,481.45	
	SAGE GROUP PLC/THE	42,810	7.17	307,118.94	
	HALMA PLC	14,690	29.42	432,179.80	
	BT GROUP PLC	355,852	1.35	481,111.90	
	VODAFONE GROUP PLC	1,097,428	1.10	1,215,072.28	
	NATIONAL GRID PLC	140,868	9.11	1,284,011.82	
	SEVERN TRENT PLC	11,503	26.65	306,554.95	
	SSE PLC	39,837	16.15	643,566.73	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.00	261,180.52	
英ポンド小計		11,307,399		69,864,897.22 (10,942,240,202)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	17.86	135,200.20	

EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	933.00	251,910.00	
GIVAUDAN-REG	373	4,326.00	1,613,598.00	
HOLCIM LTD	21,639	45.33	980,895.87	
SIKA AG-REG	5,550	311.40	1,728,270.00	
ABB LTD-REG	67,405	30.06	2,026,194.30	
GEBERIT AG-REG	1,455	716.00	1,041,780.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	590	237.80	140,302.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	242.30	358,604.00	
ADECCO GROUP AG-REG	5,477	47.22	258,623.94	
SGS SA-REG	258	2,765.00	713,370.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	292.10	581,279.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,209	112.15	2,266,439.35	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,000	244.00	244,000.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	47.24	87,394.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	125	2,098.00	262,250.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	10,720.00	471,680.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	109,400.00	437,600.00	
NESTLE SA-REG	111,133	116.80	12,980,334.40	
ALCON INC	18,824	75.72	1,425,353.28	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,231	379.70	847,110.70	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	425	1,881.00	799,425.00	
LONZA GROUP AG-REG	2,898	750.40	2,174,659.20	
NOVARTIS AG-REG	85,643	77.02	6,596,223.86	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,230	393.60	484,128.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,173	357.25	9,707,554.25	
VIFOR PHARMA AG	1,940	123.90	240,366.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	890	70.60	62,834.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,638	9.76	1,021,894.70	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,170	65.94	538,729.80	
PARTNERS GROUP HOLDIING AG	880	1,590.00	1,399,200.00	
UBS GROUP AG-REG	142,382	16.36	2,329,369.52	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,630	143.10	233,253.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,180	488.50	576,430.00	
SWISS RE AG	12,249	81.76	1,001,478.24	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,611	398.00	2,233,178.00	

	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	93.95	239,666.45	
	TEMENOS AG	2,640	117.40	309,936.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	81.88	545,320.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,094	550.40	602,137.60	
スイスフラン小計		679,361		59,947,973.46 (7,412,566,918)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,540	361.10	3,083,794.00	
	BOLIDEN AB	10,890	307.10	3,344,319.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,310	137.60	3,069,856.00	
	ALFA LAVAL AB	10,550	331.60	3,498,380.00	
	ASSA ABLOY AB-B	38,560	246.90	9,520,464.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,725	552.60	14,215,635.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,390	470.30	7,237,917.00	
	EPIROC AB-A	27,585	213.90	5,900,431.50	
	EPIROC AB-B	15,450	181.00	2,796,450.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	311.30	2,116,840.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,100	124.65	6,992,865.00	
	SANDVIK AB	45,770	220.70	10,101,439.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,410	220.00	2,510,200.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	216.90	3,053,735.10	
	VOLVO AB-A SHS	7,120	201.20	1,432,544.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	57,670	198.70	11,459,029.00	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	146.45	2,142,417.05	
	ELECTROLUX AB-B	8,095	198.30	1,605,238.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	113.90	1,708,500.00	
	EVOLUTION AB	6,800	1,510.00	10,268,000.00	
	EMBRACER GROUP AB	18,620	82.22	1,530,936.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,138	166.00	5,002,908.00	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	435.90	1,843,857.00	
	SWEDISH MATCH AB	63,200	80.18	5,067,376.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,065	277.00	5,835,005.00	
	NORDEA BANK ABP	128,442	111.30	14,295,594.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	138.60	8,655,570.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	47,710	99.66	4,754,778.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	36,220	195.38	7,076,663.60	

	EQT AB	10,680	446.60	4,769,688.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,250	282.20	1,199,350.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS(N)	734	282.20	207,134.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	276.50	1,653,470.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	199.02	13,802,037.00	
	KINNEVIK AB - B	10,215	339.00	3,462,885.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,370	497.40	1,178,838.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,570	617.40	2,821,518.00	
	SINCH AB	18,850	171.30	3,229,005.00	
	ERICSSON LM-B SHS	115,425	96.15	11,098,113.75	
	HEXAGON AB-B SHS	78,890	138.85	10,953,876.50	
	TELE2 AB-B SHS	18,705	122.85	2,297,909.25	
	TELIA CO AB	94,230	35.39	3,334,799.70	
スウェーデンクローナ小計		1,264,797		220,129,368.35 (2,912,311,543)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	37,444	235.25	8,808,701.00	
	NORSK HYDRO A S	53,840	66.02	3,554,516.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,660	429.40	3,289,204.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	152.75	1,741,350.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,830	397.20	1,521,276.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,420	456.00	1,103,520.00	
	MOWI ASA	15,340	247.70	3,799,718.00	
	ORKLA ASA	22,670	78.22	1,773,247.40	
	DNB BANK ASA	39,765	213.80	8,501,757.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,810	209.80	1,428,738.00	
	TELENOR ASA	23,915	137.00	3,276,355.00	
ノルウェークローネ小計		225,094		38,798,383.20 (528,821,963)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	507.80	1,949,952.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	459.20	3,634,568.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	385	2,927.00	1,126,895.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	39,180	269.90	10,574,682.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	140	17,520.00	2,452,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	223	18,495.00	4,124,385.00	
	DSV A/S	7,650	1,523.00	11,650,950.00	

	PANDORA A/S	4,080	888.20	3,623,856.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	1,054.00	4,163,300.00	
	AMBU A/S-B	6,780	186.40	1,263,792.00	
	COLOPLAST-B	4,275	1,086.00	4,642,650.00	
	DEMANT A/S	4,410	308.70	1,361,367.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	426.10	2,117,717.00	
	GENMAB A/S	2,560	2,985.00	7,641,600.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	65,265	681.30	44,465,044.50	
	DANSKE BANK A/S	20,705	116.35	2,409,026.75	
	TRYG A/S	15,435	154.15	2,379,305.25	
	ORSTED A/S	7,340	900.60	6,610,404.00	
デンマーククローネ小計		199,103		116,192,294.50 (2,062,413,227)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	31.26	274,306.50	
	OIL SEARCH LTD	77,602	4.48	347,656.96	
	SANTOS LTD	65,495	7.29	477,458.55	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,600	34.19	225,654.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,333	24.13	924,975.29	
	BHP GROUP LTD	114,106	37.93	4,328,040.58	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.94	383,411.40	
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	3.82	263,580.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,085	14.51	958,893.35	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	17,805	52.38	932,625.90	
	NEWCREST MINING LTD	30,209	25.31	764,589.79	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	9.66	407,555.40	
	ORICA LIMITED	12,135	15.01	182,146.35	
	RIO TINTO LTD	14,138	96.44	1,363,468.72	
	SOUTH32 LTD	205,747	3.80	781,838.60	
	REECE LTD	10,200	18.04	184,008.00	
	BRAMBLES LTD	62,498	10.28	642,479.44	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.52	258,966.40	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	5.55	244,200.00	
	SYDNEY AIRPORT	47,076	8.30	390,730.80	
	TRANSURBAN GROUP	127,076	13.74	1,746,024.24	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,290	47.33	1,196,975.70	

	ARISTOCRAT LEISURE LTD-RTS(N)	1,230	5.37	6,605.10	
	CROWN RESORTS LTD	11,395	9.66	110,075.70	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	132.22	281,628.60	
	TABCORP HOLDINGS LTD	70,974	5.03	356,999.22	
	REA GROUP LTD	1,820	163.60	297,752.00	
	SEEK LTD	10,700	32.82	351,174.00	
	WESFARMERS LTD	45,475	57.64	2,621,179.00	
	COLES GROUP LTD	52,085	17.83	928,675.55	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	6.80	343,141.60	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	50,462	40.79	2,058,344.98	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	25,746	11.82	304,317.72	
	COCHLEAR LTD	2,917	222.36	648,624.12	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,305	70.11	442,043.55	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	39.70	701,102.00	
	CSL LTD	17,552	295.59	5,188,195.68	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	105,769	28.32	2,995,378.08	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	68,907	105.46	7,266,932.22	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	129,523	28.74	3,722,491.02	
	WESTPAC BANKING CORP	144,571	25.71	3,716,920.41	
	ASX LTD	7,925	81.36	644,778.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	13,374	200.47	2,681,085.78	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,820	35.90	173,038.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.04	479,430.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	92,560	3.47	321,183.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	45,050	11.92	536,996.00	
	SUNCORP GROUP LTD	57,276	12.20	698,767.20	
	AFTERPAY LTD	8,240	122.60	1,010,224.00	
	COMPUTERSHARE LTD	15,880	18.06	286,792.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,130	54.08	277,430.40	
	XERO LTD	5,480	151.79	831,809.20	
	TELSTRA CORPORATION LTD	182,084	3.81	693,740.04	
	AGL ENERGY LTD	21,261	6.22	132,243.42	
	APA GROUP	45,818	8.55	391,743.90	
	AUSNET SERVICES	72,810	2.49	181,296.90	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,520	5.38	287,937.60	

豪ドル小計		2,718,276		59,249,662.96 (5,055,181,243)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	8.07	456,076.05	
	A2 MILK CO LTD	35,120	7.18	252,161.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,200	30.85	654,020.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,800	14.81	278,428.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.55	348,425.35	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.10	124,440.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	5.02	230,819.60	
ニュージーランドドル小計		274,592		2,344,370.60 (191,230,309)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,208	52.90	5,882,903.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	55,000	159.20	8,756,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	82,000	22.55	1,849,100.00	
	MTR CORP	57,500	42.05	2,417,875.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	26.00	1,352,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	92,000	41.90	3,854,800.00	
	SANDS CHINA LTD	111,400	17.18	1,913,852.00	
	SJM HOLDINGS LTD	91,000	5.83	530,530.00	
	WYNN MACAU LTD	63,000	7.10	447,300.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	18.58	1,261,582.00	
	WH GROUP LTD	339,394	5.27	1,788,606.38	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	24.90	3,735,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	145.90	4,245,690.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,300	484.20	22,418,460.00	
	AIA GROUP LTD	466,190	90.95	42,399,980.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	47.35	3,647,749.30	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	24.80	1,879,840.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	18.30	1,427,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	32.55	1,884,677.55	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	33.95	2,467,010.70	
	SINO LAND CO	143,050	10.84	1,550,662.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,980	102.80	5,446,344.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	49.75	871,470.75	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	21.15	879,840.00	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	42.60	2,717,880.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.56	1,584,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	44.80	1,120,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	74.90	4,456,550.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.68	729,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	384,237	11.72	4,503,257.64	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	45.70	2,513,500.00	
香港ドル小計		3,263,081		140,533,461.02 (2,057,409,869)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	5.48	292,412.80	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,900	3.87	200,853.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.27	284,053.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.77	163,602.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.37	323,205.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,715	31.49	2,258,305.35	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	137,740	11.99	1,651,502.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	26.88	1,123,584.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,700	9.66	286,902.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,500	3.42	405,270.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.45	128,885.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	7.25	112,737.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	19.31	191,169.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	369,180	2.55	941,409.00	
シンガポールドル小計		1,255,605		8,363,890.95 (706,832,424)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	27.70	722,693.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	474.60	569,520.00	
	BANK HAPOALIM BM	45,535	30.75	1,400,201.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	29.73	1,694,758.65	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	40,300	19.29	777,387.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	113.40	555,660.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	296.30	397,042.00	
	NICE LTD	2,565	905.60	2,322,864.00	
イスラエルシュケル小計		178,935		8,440,125.90 (300,174,765)	

合　　計	42,394,419		245,047,142,640 (245,047,142,640)	

(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	316,410.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	1,094,845.60	
		AMERICAN TOWER CORP	17,649	5,022,552.42	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	531,048.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	1,251,138.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,977	700,863.02	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	637,916.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	16,670	2,961,258.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,095	1,738,808.40	
		DUKE REALTY CORPORATION	14,585	812,384.50	
		EQUINIX INC	3,463	2,849,287.14	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	541,800.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	14,290	1,218,365.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	830,477.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	963,081.70	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	701,715.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	457,422.57	
		INVITATION HOMES INC	22,810	935,894.30	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	539,232.75	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	407,025.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	855,440.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	333,460.80	
		PROLOGIS INC	28,678	4,161,177.80	
		PUBLIC STORAGE	6,119	2,010,152.69	
		REALTY INCOME CORP	15,030	1,110,266.10	
		REGENCY CENTERS CORP	6,695	471,328.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,250	1,484,185.00	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,974	1,904,972.42	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	884,760.00	
		UDR INC	9,590	524,285.30	
		VENTAS INC	14,825	808,259.00	
		VEREIT INC	8,272	429,730.40	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	644,254.60	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	306,582.25	
		WELLTOWER INC	16,720	1,353,985.60	
		WEYERHAEUSER CO	28,918	1,091,076.14	
		WP CAREY INC	6,460	501,683.60	
米ドル小計			501,005	43,387,126.85 (4,938,756,649)	
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	171,500.00	
加ドル小計			2,800	171,500.00 (15,764,280)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	140,602.00	
		GECINA SA	1,950	235,170.00	
		KLEPIERRE	6,642	136,758.78	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,360	355,046.40	
ユーロ小計			15,877	867,577.18 (114,563,566)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	179,320.86	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	179,924.99	
		SEGRO PLC	45,033	580,025.04	
英ポンド小計			108,638	939,270.89 (147,108,606)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	35,587	395,371.57	
		GOODMAN GROUP	63,582	1,434,409.92	
		GPT GROUP	71,335	377,362.15	
		LENDLEASE GROUP	28,927	310,965.25	
		MIRVAC GROUP	135,075	399,822.00	
		SCENTRE GROUP	198,271	614,640.10	
		STOCKLAND	96,900	459,306.00	
		VICINITY CENTRES	178,802	321,843.60	
			808,479	4,313,720.59	

豪ドル小計				(368,046,640)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	87,500	5,998,125.00	
香港ドル小計			87,500	5,998,125.00 (87,812,550)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	356,866.01	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	444,258.72	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	155,230.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	277,404.01	
シンガポールドル小計			537,398	1,233,758.74 (104,264,951)	
合計				5,776,317,242 (5,776,317,242)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	598銘柄	97.3%	—	71.3%
	投資証券	37銘柄	—	2.7%	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	230銘柄	99.5%	—	10.0%
	投資証券	4銘柄	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式	83銘柄	98.7%	—	4.4%
	投資証券	3銘柄	—	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%	—	3.0%
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	57銘柄	93.2%	—	2.0%
	投資証券	8銘柄	—	6.8%	0.1%
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	31銘柄	95.9%	—	0.8%

	投資証券	1銘柄	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.1%	—	0.3%
	投資証券	4銘柄	—	12.9%	0.0%
イスラエルシュケル	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。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	33,915,362	49,665,611
コール・ローン	465,491,601	390,550,490
株式	10,325,179,492	16,780,154,292
投資証券	251,358,988	396,395,818
派生商品評価勘定	118,676,267	10,472,882
未収入金	2,071,276	3,355,763
未収配当金	7,424,886	10,209,550
差入委託証拠金	236,763,776	357,963,641
流動資産合計	11,440,881,648	17,998,768,047
資産合計	11,440,881,648	17,998,768,047
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,868,917	385,794,529
未払金	2,095,919	21,501,268
未払解約金	8,723,931	2,877,983
未払利息	129	156
流動負債合計	18,688,896	410,173,936
負債合計	18,688,896	410,173,936
純資産の部		
元本等		
元本	5,875,608,160	6,831,162,629
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	5,546,584,592	10,757,431,482
元本等合計	11,422,192,752	17,588,594,111
純資産合計	11,422,192,752	17,588,594,111
負債純資産合計	11,440,881,648	17,998,768,047

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	（1）デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 （2）為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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10月26日現在	2021年10月26日現在
１．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	4,930,561,728円	5,875,608,160円
	期首からの追加設定元本額	1,560,324,240円	1,363,175,797円
	期首からの一部解約元本額	615,277,808円	407,621,328円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（ＤＣ専用）	4,283,823,546円	5,349,584,556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）	379,820,199円	324,670,953円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	6,701,205円	5,734,203円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	5,505,090円	5,090,574円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	7,811,402円	6,210,213円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	7,110,060円	5,202,286円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	39,022,669円	31,207,983円

	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	106,946,295円	90,331,157円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	159,359,431円	138,338,781円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	149,373,199円	132,630,704円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	730,135,064円	742,161,219円
	計	5,875,608,160円	6,831,162,629円
２．	受益権の総数	5,875,608,160口	6,831,162,629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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	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。	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10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,023,581,654
投資証券	△29,867,689
合計	993,713,965

（2021年10月26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	3,639,777,594
投資証券	87,312,902
合計	3,727,090,496

(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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	852,350,843	－	864,239,328	11,888,485
合計		852,350,843	－	864,239,328	11,888,485

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	421,562,260	－	430,330,782	8,768,522
合計		421,562,260	－	430,330,782	8,768,522

（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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	10,952,181,945	－	10,853,263,080	98,918,865

	米ドル	7,981,314,102	—	7,911,144,170	70,169,932
	加ドル	357,329,338	—	355,062,580	2,266,758
	ユーロ	1,166,592,763	—	1,157,627,920	8,964,843
	英ポンド	461,934,734	—	454,309,570	7,625,164
	スイスフラン	354,965,133	—	353,526,460	1,438,673
	スウェーデンクローナ	113,689,006	—	112,818,680	870,326
	ノルウェークローネ	18,455,613	—	17,731,820	723,793
	デンマーククローネ	89,286,932	—	88,639,280	647,652
	豪ドル	245,163,983	—	240,189,470	4,974,513
	ニュージーランドドル	9,866,552	—	9,800,270	66,282
	香港ドル	109,495,816	—	108,604,680	891,136
	シンガポールドル	35,262,440	—	35,063,360	199,080
	イスラエルシュケル	8,825,533	—	8,744,820	80,713
合計		10,952,181,945	—	10,853,263,080	98,918,865

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	17,203,273,601	—	17,587,363,770	△384,090,169
	米ドル	12,625,971,820	—	12,898,626,326	△272,654,506
	加ドル	596,310,418	—	619,065,088	△22,754,670
	ユーロ	1,779,281,817	—	1,802,957,143	△23,675,326
	英ポンド	747,819,472	—	768,630,405	△20,810,933
	スイスフラン	500,474,879	—	510,759,785	△10,284,906
	スウェーデンクローナ	194,700,246	—	200,963,700	△6,263,454
	ノルウェークローネ	34,615,995	—	37,133,538	△2,517,543
	デンマーククローネ	140,710,687	—	142,559,187	△1,848,500
	豪ドル	359,651,044	—	376,188,313	△16,537,269

	ニュージーランドドル	10,509,414	－	11,080,465	△571,051
	香港ドル	143,595,010	－	148,022,037	△4,427,027
	シンガポールドル	52,432,965	－	53,524,336	△1,091,371
	イスラエルシュケル	17,199,834	－	17,853,447	△653,613
合計		17,203,273,601	－	17,587,363,770	△384,090,169

（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。

①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。

②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10月26日現在		2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.9440円	1口当たり純資産額	2.5748円
(1万口当たり純資産額)	(19,440円)	(1万口当たり純資産額)	(25,748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	1,970	25.16	49,565.20	
	CHENIERE ENERGY INC	686	108.00	74,088.00	

CHEVRON CORP	5,165	113.85	588,035.25	
CONOCOPHILLIPS	3,495	76.52	267,437.40	
COTERRA ENERGY INC	2,100	22.56	47,376.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	1,400	40.66	56,924.00	
EOG RESOURCES INC	1,654	94.04	155,542.16	
EXXON MOBIL CORP	11,227	64.35	722,457.45	
HALLIBURTON CO	2,829	26.22	74,176.38	
HESS CORP	813	88.50	71,950.50	
KINDER MORGAN INC	5,393	17.85	96,265.05	
MARATHON PETROLEUM CORP	1,726	68.20	117,713.20	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,457	35.22	86,535.54	
ONEOK INC	1,197	65.87	78,846.39	
PHILLIPS 66	1,179	83.73	98,717.67	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	629	192.69	121,202.01	
SCHLUMBERGER LTD	3,600	34.36	123,696.00	
VALERO ENERGY CORP	1,042	82.69	86,162.98	
WILLIAMS COS INC	3,189	28.80	91,843.20	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	585	293.92	171,943.20	
ALBEMARLE CORP	307	239.44	73,508.08	
AMCOR PLC	4,230	12.08	51,098.40	
AVERY DENNISON CORP	247	218.02	53,850.94	
BALL CORP	855	87.48	74,795.40	
CELANESE CORP	251	171.41	43,023.91	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	763	59.13	45,116.19	
CORTEVA INC	1,796	42.52	76,365.92	
CROWN HOLDINGS INC	390	101.06	39,413.40	
DOW INC	1,917	58.71	112,547.07	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,451	71.93	104,370.43	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	427	108.79	46,453.33	
ECOLAB INC	665	221.56	147,337.40	
FMC CORP	441	93.24	41,118.84	
FREEPORT-MCMORAN INC	3,655	39.34	143,787.70	
INTERNATIONAL PAPER CO	1,070	52.98	56,688.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	609	146.34	89,121.06	
LINDE PLC	1,396	316.68	442,085.28	

LYONDELLBASELL INDU-CL A	728	97.61	71,060.08	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	144	393.79	56,705.76	
MOSAIC CO/THE	882	42.43	37,423.26	
NEWMONT CORP	2,063	57.91	119,468.33	
NUCOR CORP	732	109.42	80,095.44	
PACKAGING CORP OF AMERICA	274	133.92	36,694.08	
PPG INDUSTRIES INC	632	160.07	101,164.24	
RPM INTERNATIONAL INC	385	87.93	33,853.05	
SEALED AIR CORP	300	59.29	17,787.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	682	309.72	211,229.04	
STEEL DYNAMICS INC	583	67.09	39,113.47	
VULCAN MATERIALS CO	335	190.87	63,941.45	
WESTROCK CO	562	48.57	27,296.34	
3M CO	1,550	182.40	282,720.00	
ALLEGION PLC	231	131.11	30,286.41	
AMETEK INC	674	130.49	87,950.26	
BOEING CO/THE	1,478	212.87	314,621.86	
CARRIER GLOBAL CORP	2,126	54.60	116,079.60	
CATERPILLAR INC	1,440	202.21	291,182.40	
CUMMINS INC	417	241.36	100,647.12	
DEERE & CO	788	352.72	277,943.36	
DOVER CORP	354	168.64	59,698.56	
EATON CORP PLC	1,038	162.51	168,685.38	
EMERSON ELECTRIC CO	1,540	96.55	148,687.00	
FASTENAL CO	1,443	56.15	81,024.45	
FORTIVE CORP	784	74.38	58,313.92	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	347	97.25	33,745.75	
GENERAC HOLDINGS INC	147	470.12	69,107.64	
GENERAL DYNAMICS CORP	657	207.91	136,596.87	
GENERAL ELECTRIC CO	2,902	105.30	305,580.60	
HEICO CORP-CLASS A	253	124.59	31,521.27	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,851	217.54	402,666.54	
HOWMET AEROSPACE INC	1,146	30.37	34,804.02	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	212.48	24,860.16	
IDEX CORP	206	221.19	45,565.14	

ILLINOIS TOOL WORKS	808	225.51	182,212.08	
INGERSOLL-RAND INC	944	54.55	51,495.20	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	600	56.82	34,092.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,885	73.95	139,395.75	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	577	244.27	140,943.79	
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	304.29	24,343.20	
LOCKHEED MARTIN CORP	666	376.33	250,635.78	
MASCO CORP	681	61.51	41,888.31	
NORDSON CORP	120	256.13	30,735.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	412	406.62	167,527.44	
OTIS WORLDWIDE CORP	1,077	81.86	88,163.22	
OWENS CORNING	340	91.55	31,127.00	
PACCAR INC	966	87.23	84,264.18	
PARKER HANNIFIN CORP	349	303.90	106,061.10	
PENTAIR PLC	520	76.93	40,003.60	
PLUG POWER INC	1,148	34.88	40,042.24	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	4,040	91.30	368,852.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	283	315.68	89,337.44	
ROPER TECHNOLOGIES INC	284	487.92	138,569.28	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	56.70	20,298.60	
SMITH (A.O.) CORP	475	66.82	31,739.50	
SNAP-ON INC	152	210.16	31,944.32	
STANLEY BLACK & DECKER INC	421	189.09	79,606.89	
SUNRUN INC	280	54.23	15,184.40	
TEXTRON INC	508	74.26	37,724.08	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	619	180.07	111,463.33	
TRANSDIGM GROUP INC	143	636.10	90,962.30	
UNITED RENTALS INC	194	366.26	71,054.44	
WABTEC CORP	412	92.91	38,278.92	
WW GRAINGER INC	132	435.83	57,529.56	
XYLEM INC	529	129.05	68,267.45	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	83.66	30,535.90	
CINTAS CORP	240	428.59	102,861.60	
CLARIVATE PLC	1,013	22.88	23,177.44	
COPART INC	577	153.28	88,442.56	

COSTAR GROUP INC	1,070	99.19	106,133.30	
EQUIFAX INC	335	274.78	92,051.30	
IHS MARKIT LTD	1,040	123.93	128,887.20	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	300	139.14	41,742.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	309	101.85	31,471.65	
REPUBLIC SERVICES INC	633	131.26	83,087.58	
ROBERT HALF INTL INC	290	112.53	32,633.70	
ROLLINS INC	763	39.25	29,947.75	
TRANSUNION	455	118.18	53,771.90	
VERISK ANALYTICS INC	433	212.02	91,804.66	
WASTE CONNECTIONS INC	752	131.99	99,256.48	
WASTE MANAGEMENT INC	1,104	161.15	177,909.60	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	378	98.19	37,115.82	
CSX CORP	6,102	35.73	218,024.46	
DELTA AIR LINES INC	602	39.51	23,785.02	
EXPEDITORS INTL WASH INC	427	123.36	52,674.72	
FEDEX CORP	672	235.40	158,188.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	259	197.73	51,212.07	
KANSAS CITY SOUTHERN	248	302.38	74,990.24	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	463	55.48	25,687.24	
LYFT INC-A	641	48.12	30,844.92	
NORFOLK SOUTHERN CORP	638	287.33	183,316.54	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	290	324.70	94,163.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	47.48	22,125.68	
UBER TECHNOLOGIES INC	3,247	45.72	148,452.84	
UNION PACIFIC CORP	1,766	240.28	424,334.48	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,897	203.90	386,798.30	
APTIV PLC	693	170.29	118,010.97	
AUTOLIV INC	307	93.63	28,744.41	
BORGWARNER INC	614	45.49	27,930.86	
FORD MOTOR COMPANY	10,382	16.00	166,112.00	
GENERAL MOTORS CORP	3,301	57.76	190,665.76	
LEAR CORP	167	168.85	28,197.95	
TESLA INC	2,174	1,024.86	2,228,045.64	
DR HORTON INC	927	88.57	82,104.39	

GARMIN LTD	466	164.06	76,451.96	
HASBRO INC	280	88.50	24,780.00	
LENNAR CORP-CL A	783	100.31	78,542.73	
LULULEMON ATHLETICA INC	307	427.94	131,377.58	
MOHAWK INDUSTRIES INC	184	193.59	35,620.56	
NEWELL BRANDS INC	1,116	22.47	25,076.52	
NIKE INC -CL B	3,351	164.22	550,301.22	
NVR INC	10	4,878.42	48,784.20	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	640	96.60	61,824.00	
PULTE GROUP INC	707	49.86	35,251.02	
VF CORP	800	70.73	56,584.00	
WHIRLPOOL CORP	176	208.37	36,673.12	
AIRBNB INC-CLASS A	341	169.24	57,710.84	
ARAMARK	646	36.74	23,734.04	
BOOKING HOLDINGS INC	110	2,412.98	265,427.80	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	521	111.94	58,320.74	
CARNIVAL CORP	2,298	22.05	50,670.90	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	74	1,774.98	131,348.52	
DARDEN RESTAURANTS INC	311	143.48	44,622.28	
DOMINO'S PIZZA INC	93	466.24	43,360.32	
DRAFTKINGS INC - CL A	877	46.82	41,061.14	
EXPEDIA GROUP INC	397	161.44	64,091.68	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	755	142.17	107,338.35	
LAS VEGAS SANDS CORP	909	37.99	34,532.91	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	723	154.79	111,913.17	
MCDONALD'S CORP	1,969	237.34	467,322.46	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	641	11.21	7,185.61	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,153	48.15	55,516.95	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	521	84.91	44,238.11	
STARBUCKS CORP	3,143	114.71	360,533.53	
VAIL RESORTS INC	122	352.16	42,963.52	
WYNN RESORTS LTD	353	90.42	31,918.26	
YUM! BRANDS INC	798	125.94	100,500.12	
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,002	81.19	162,542.38	
ALPHABET INC-CL A	794	2,748.94	2,182,658.36	

ALPHABET INC-CL C	778	2,775.46	2,159,307.88	
ALTICE USA INC- A	740	18.04	13,349.60	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	1,331	36.83	49,020.73	
CABLE ONE INC	17	1,786.49	30,370.33	
CHARTER COMMUNICATION-A	351	731.01	256,584.51	
COMCAST CORP-CLASS A	12,180	54.08	658,694.40	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	374	25.29	9,458.46	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	998	24.40	24,351.20	
DISH NETWORK CORP-A	595	43.59	25,936.05	
ELECTRONIC ARTS INC	779	142.19	110,766.01	
FACEBOOK INC-CLASS A	6,361	328.69	2,090,797.09	
FOX CORP - CLASS A	1,253	41.83	52,412.99	
IAC/INTERACTIVECORP	168	156.76	26,335.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,244	36.15	44,970.60	
LIBERTY BROADBAND-C	505	175.69	88,723.45	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	623	48.96	30,502.08	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	514	55.50	28,527.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	338	100.52	33,975.76	
MATCH GROUP INC	682	167.65	114,337.30	
NETFLIX INC	1,162	671.66	780,468.92	
NEWS CORP - CLASS A	1,331	24.16	32,156.96	
OMNICOM GROUP	510	70.18	35,791.80	
PINTEREST INC- CLASS A	1,316	50.68	66,694.88	
ROKU INC	306	323.19	98,896.14	
SEA LTD-ADR	184	348.32	64,090.88	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,371	6.04	20,360.84	
SNAP INC - A	2,536	54.50	138,212.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	287	182.99	52,518.13	
THE WALT DISNEY CO.	4,831	172.01	830,980.31	
TWITTER INC	2,116	62.11	131,424.76	
VIACOMCBS INC - CLASS B	1,604	37.61	60,326.44	
ZILLOW GROUP INC - A	124	96.36	11,948.64	
ZILLOW GROUP INC - C	478	95.43	45,615.54	
ADVANCE AUTO PARTS INC	206	230.13	47,406.78	
AMAZON.COM INC	1,205	3,320.37	4,001,045.85	

AUTOZONE INC	58	1,821.09	105,623.22	
BATH & BODY WORKS INC	593	70.94	42,067.42	
BEST BUY CO INC	559	120.48	67,348.32	
BURLINGTON STORES INC	158	276.99	43,764.42	
CARMAX INC	443	139.97	62,006.71	
CARVANA CO	192	292.23	56,108.16	
CHEWY INC - CLASS A	225	67.95	15,288.75	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	605	222.49	134,606.45	
DOLLAR TREE INC	576	105.02	60,491.52	
DOORDASH INC - A	200	216.33	43,266.00	
EBAY INC	1,767	80.57	142,367.19	
ETSY INC	348	252.57	87,894.36	
GENUINE PARTS CO	445	133.54	59,425.30	
HOME DEPOT INC	2,833	371.26	1,051,779.58	
LKQ CORP	715	56.59	40,461.85	
LOWE'S COS INC	1,894	231.82	439,067.08	
MERCADOLIBRE INC	120	1,536.51	184,381.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	178	661.34	117,718.52	
POOL CORP	94	508.62	47,810.28	
ROSS STORES INC	935	113.12	105,767.20	
TARGET CORP	1,321	260.35	343,922.35	
TJX COMPANIES INC	3,233	65.26	210,985.58	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	211.03	60,776.64	
ULTA BEAUTY INC	115	371.00	42,665.00	
WAYFAIR INC- CLASS A	198	235.13	46,555.74	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,181	490.10	578,808.10	
KROGER CO	2,119	40.33	85,459.27	
SYSCO CORP	1,339	78.05	104,508.95	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,101	49.22	103,411.22	
WALMART INC	4,122	150.06	618,547.32	
ALTRIA GROUP INC	4,823	47.95	231,262.85	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,548	66.63	103,143.24	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	28	506.38	14,178.64	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	887	69.36	61,522.32	
BUNGE LTD	384	88.32	33,914.88	

CAMPBELL SOUP CO	618	40.20	24,843.60	
COCA-COLA CO/THE	10,923	54.23	592,354.29	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	578	52.12	30,125.36	
CONAGRA BRANDS INC	1,140	32.89	37,494.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	430	217.69	93,606.70	
GENERAL MILLS INC	1,678	61.89	103,851.42	
HERSHEY CO/THE	418	180.23	75,336.14	
HORMEL FOODS CORP	696	41.95	29,197.20	
JM SMUCKER CO/THE	281	123.14	34,602.34	
KELLOGG CO	581	61.73	35,865.13	
KEURIG DR PEPPER INC	2,054	34.44	70,739.76	
KRAFT HEINZ CO/THE	1,765	36.22	63,928.30	
LAMB WESTON HOLDING INC	369	58.40	21,549.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	716	80.68	57,766.88	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	389	43.76	17,022.64	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,711	60.34	223,921.74	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,082	84.38	91,299.16	
PEPSICO INC	3,679	159.22	585,770.38	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,103	96.54	396,103.62	
TYSON FOODS INC-CL A	829	83.29	69,047.41	
CHURCH & DWIGHT CO INC	719	83.76	60,223.44	
CLOROX COMPANY	311	161.64	50,270.04	
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,187	75.14	164,331.18	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	609	330.06	201,006.54	
KIMBERLY-CLARK CORP	872	130.11	113,455.92	
PROCTER & GAMBLE CO	6,531	140.85	919,891.35	
ABBOTT LABORATORIES	4,659	126.58	589,736.22	
ABIOMED INC	101	354.02	35,756.02	
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	589.81	111,474.09	
AMERISOURCEBERGEN CORP	353	122.60	43,277.80	
ANTHEM INC	653	434.56	283,767.68	
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,263	81.36	102,757.68	
BECTON DICKINSON AND CO	775	246.41	190,967.75	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,813	44.49	169,640.37	
CARDINAL HEALTH INC	878	48.73	42,784.94	

CENTENE CORP	1,485	67.97	100,935.45	
CERNER CORP	882	71.63	63,177.66	
CIGNA CORP	909	215.62	195,998.58	
COOPER COS INC/THE	138	414.95	57,263.10	
CVS HEALTH CORP	3,523	87.68	308,896.64	
DANAHER CORP	1,706	306.10	522,206.60	
DAVITA INC	195	113.86	22,202.70	
DENTSPLY SIRONA INC	651	57.27	37,282.77	
DEXCOM INC	259	568.34	147,200.06	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,652	117.30	193,779.60	
HCA HEALTHCARE INC	729	241.81	176,279.49	
HENRY SCHEIN INC	414	76.21	31,550.94	
HOLOGIC INC	727	73.03	53,092.81	
HUMANA INC	328	463.42	152,001.76	
IDEXX LABORATORIES INC	232	652.52	151,384.64	
INSULET CORP	183	302.20	55,302.60	
INTUITIVE SURGICAL INC	924	343.59	317,477.16	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	260	281.07	73,078.20	
MASIMO CORP	158	285.47	45,104.26	
MCKESSON CORP	399	207.45	82,772.55	
MEDTRONIC PLC	3,588	123.56	443,333.28	
MOLINA HEALTHCARE INC	130	297.60	38,688.00	
NOVOCURE LTD	202	119.29	24,096.58	
OAK STREET HEALTH INC	314	46.27	14,528.78	
QUEST DIAGNOSTICS	309	145.01	44,808.09	
RESMED INC	402	267.98	107,727.96	
STERIS PLC	289	235.37	68,021.93	
STRYKER CORP	878	273.05	239,737.90	
TELADOC HEALTH INC	390	141.98	55,372.20	
TELEFLEX INC	138	376.90	52,012.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,499	449.49	1,123,275.51	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	133.69	24,598.96	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	354	321.65	113,864.10	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	199	417.43	83,068.57	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	542	151.03	81,858.26	

10X GENOMICS INC-CLASS A	200	168.75	33,750.00	
ABBVIE INC	4,652	108.50	504,742.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	774	158.34	122,555.16	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	289	199.67	57,704.63	
AMGEN INC	1,513	207.63	314,144.19	
AVANTOR INC	1,461	37.90	55,371.90	
BIO-RAD LABORATORIES-A	64	770.48	49,310.72	
BIO-TECHNE CORP	97	510.83	49,550.51	
BIOGEN INC	398	269.94	107,436.12	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	73.51	35,872.88	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,001	57.81	346,917.81	
CATALENT INC	498	130.89	65,183.22	
CHARLES RIVER LABORATORIES	125	423.82	52,977.50	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	880	33.97	29,893.60	
ELI LILLY & CO	2,145	245.05	525,632.25	
EXACT SCIENCES CORP	426	93.67	39,903.42	
GILEAD SCIENCES INC	3,254	67.67	220,198.18	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	519	116.07	60,240.33	
ILLUMINA INC	387	420.78	162,841.86	
INCYTE CORP	431	66.75	28,769.25	
IQVIA HOLDINGS INC	490	257.25	126,052.50	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	125	142.68	17,835.00	
JOHNSON & JOHNSON	7,016	164.08	1,151,185.28	
MERCK & CO. INC.	6,678	81.66	545,325.48	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	65	1,470.72	95,596.80	
MODERNA INC	907	349.56	317,050.92	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	102.55	22,561.00	
NOVAVAX INC	198	135.35	26,799.30	
PERKINELMER INC	293	177.19	51,916.67	
PFIZER INC	14,911	43.15	643,409.65	
PPD INC	384	46.98	18,040.32	
REGENERON PHARMACEUTICALS	282	576.20	162,488.40	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	573	37.67	21,584.91	
SEAGEN INC	386	175.52	67,750.72	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	3,353	10.12	33,932.36	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,035	607.75	629,021.25	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	693	184.99	128,198.07	
VIATRIS INC	3,111	13.80	42,931.80	
WATERS CORP	172	366.58	63,051.76	
ZOETIS INC	1,236	211.52	261,438.72	
BANK OF AMERICA CORP	20,367	47.51	967,636.17	
CITIGROUP INC	5,485	70.83	388,502.55	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,172	50.31	58,963.32	
FIFTH THIRD BANCORP	2,097	45.58	95,581.26	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	438	215.58	94,424.04	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,359	16.64	72,533.76	
JPMORGAN CHASE & CO	7,991	170.94	1,365,981.54	
KEYCORP	2,531	24.07	60,921.17	
M & T BANK CORP	362	159.00	57,558.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,132	216.56	245,145.92	
REGIONS FINANCIAL CORP	2,726	24.22	66,023.72	
SVB FINANCIAL GROUP	143	746.01	106,679.43	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,636	64.57	234,776.52	
US BANCORP	3,739	62.52	233,762.28	
WELLS FARGO & CO	10,948	50.62	554,187.76	
ALLY FINANCIAL INC	1,012	51.36	51,976.32	
AMERICAN EXPRESS CO	1,815	182.31	330,892.65	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	327	298.00	97,446.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	380	79.96	30,384.80	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,310	59.40	137,214.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,531	290.26	1,024,908.06	
BLACKROCK INC	401	924.74	370,820.74	
BLACKSTONE INC	1,824	139.57	254,575.68	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,161	168.68	195,837.48	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	129.40	39,596.40	
CME GROUP INC	928	217.69	202,016.32	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	856	123.86	106,024.16	
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	33.78	32,428.80	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	86	432.77	37,218.22	
FRANKLIN RESOURCES INC	1,042	31.11	32,416.62	

FUTU HOLDINGS LTD-ADR	139	73.51	10,217.89	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	893	414.75	370,371.75	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,475	133.04	196,234.00	
INVESCO LTD	990	24.75	24,502.50	
KKR & CO INC -A	1,463	74.86	109,520.18	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	407.25	38,281.50	
MOODY'S CORP	462	385.10	177,916.20	
MORGAN STANLEY	3,652	101.91	372,175.32	
MSCI INC	222	652.03	144,750.66	
NASDAQ INC	338	201.50	68,107.00	
NORTHERN TRUST CORP	579	123.39	71,442.81	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	498	102.00	50,796.00	
S&P GLOBAL INC	647	447.37	289,448.39	
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,749	82.89	310,754.61	
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	63.99	22,204.53	
STATE STREET CORP	955	98.60	94,163.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,571	48.89	76,806.19	
T ROWE PRICE GROUP INC	621	206.69	128,354.49	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	333	86.40	28,771.20	
VOYA FINANCIAL INC	316	68.72	21,715.52	
AFLAC INC	1,805	56.98	102,848.90	
ALLEGHANY CORP	50	678.82	33,941.00	
ALLSTATE CORP	799	129.00	103,071.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	204	137.71	28,092.84	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,227	59.64	132,818.28	
AON PLC	569	320.11	182,142.59	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,194	43.34	51,747.96	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	544	164.25	89,352.00	
ASSURANT INC	167	164.58	27,484.86	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	463	90.11	41,720.93	
BROWN & BROWN INC	595	66.46	39,543.70	
CHUBB LTD	1,216	188.07	228,693.12	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	123.44	47,154.08	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	87	200.87	17,475.69	
EVEREST RE GROUP LTD	83	282.64	23,459.12	

FNF GROUP	589	49.77	29,314.53	
GLOBE LIFE INC	215	92.75	19,941.25	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	959	73.80	70,774.20	
LINCOLN NATIONAL CORP	407	75.72	30,818.04	
LOEWS CORP	575	57.66	33,154.50	
MARKEL CORP	34	1,330.53	45,238.02	
MARSH & MCLENNAN COS	1,355	169.13	229,171.15	
METLIFE INC	2,066	65.64	135,612.24	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	796	69.64	55,433.44	
PROGRESSIVE CORP	1,483	96.35	142,887.05	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,094	113.81	124,508.14	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	119	149.78	17,823.82	
TRAVELERS COS INC/THE	627	161.58	101,310.66	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	338	244.81	82,745.78	
WR BERKLEY CORP	316	81.94	25,893.04	
CBRE GROUP INC - A	903	104.90	94,724.70	
ACCENTURE PLC-CL A	1,693	356.44	603,452.92	
ADOBE INC	1,269	646.97	821,004.93	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	466	107.57	50,127.62	
ANSYS INC	239	374.21	89,436.19	
AUTODESK INC	591	311.79	184,267.89	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,112	218.07	242,493.84	
AVALARA INC	240	181.11	43,466.40	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	519	58.41	30,314.79	
BLACK KNIGHT INC	380	73.17	27,804.60	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	279	183.43	51,176.97	
CADENCE DESIGN SYS INC	752	167.37	125,862.24	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	312	128.99	40,244.88	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	291	122.37	35,609.67	
CITRIX SYSTEMS INC	318	98.58	31,348.44	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	549	189.41	103,986.09	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,308	78.96	103,279.68	
COUPA SOFTWARE INC	188	243.47	45,772.36	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	502	280.10	140,610.20	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	121	182.43	22,074.03	

DATADOG INC-CLASS A	505	161.58	81,597.90	
DOCUSIGN INC	501	277.86	139,207.86	
DROPBOX INC-CLASS A	1,045	30.93	32,321.85	
DYNATRACE INC	565	77.81	43,962.65	
EPAM SYSTEMS INC	159	652.26	103,709.34	
FAIR ISAAC CORP	86	413.99	35,603.14	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,590	122.44	194,679.60	
FISERV INC	1,609	111.11	178,775.99	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	192	280.97	53,946.24	
FORTINET INC	343	331.91	113,845.13	
GARTNER INC	246	323.19	79,504.74	
GLOBAL PAYMENTS INC	756	157.78	119,281.68	
GODADDY INC-CLASS A	443	69.99	31,005.57	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	175	125.31	21,929.25	
HUBSPOT INC	123	805.70	99,101.10	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,401	127.64	306,463.64	
INTUIT INC	713	602.56	429,625.28	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	174.05	34,984.05	
MASTERCARD INC	2,355	360.86	849,825.30	
MICROSOFT CORP	18,988	308.13	5,850,772.44	
MONGODB INC	145	518.87	75,236.15	
NORTONLIFELOCK INC	1,407	26.67	37,524.69	
OKTA INC	317	261.05	82,752.85	
ORACLE CORP	4,972	97.89	486,709.08	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	4,101	25.41	104,206.41	
PALO ALTO NETWORKS INC	237	497.77	117,971.49	
PAYCHEX INC	872	123.18	107,412.96	
PAYCOM SOFTWARE INC	143	538.93	77,066.99	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,961	246.88	731,011.68	
PTC INC	326	129.36	42,171.36	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	201	244.69	49,182.69	
SALESFORCE.COM INC	2,551	293.92	749,789.92	
SERVICENOW INC	514	688.85	354,068.90	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	516	341.50	176,214.00	
SPLUNK INC	451	168.36	75,930.36	

SQUARE INC - A	1,032	262.00	270,384.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	74.99	45,218.97	
SYNOPSYS INC	423	324.00	137,052.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,090	76.11	82,959.90	
TWILIO INC - A	437	358.17	156,520.29	
TYLER TECHNOLOGIES INC	99	532.41	52,708.59	
UNITY SOFTWARE INC	199	145.99	29,052.01	
VERISIGN INC	250	219.52	54,880.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,497	233.88	1,051,758.36	
VMWARE INC	236	163.25	38,527.00	
WESTERN UNION CO	1,045	19.57	20,450.65	
WIX.COM LTD	150	199.45	29,917.50	
WORKDAY INC-CLASS A	513	282.15	144,742.95	
ZENDESK INC	271	132.22	35,831.62	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	567	279.79	158,640.93	
ZSCALER INC	227	311.20	70,642.40	
AMPHENOL CORP-CL A	1,538	79.12	121,686.56	
APPLE INC	44,278	148.64	6,581,481.92	
ARISTA NETWORKS INC	154	386.04	59,450.16	
ARROW ELECTRONICS INC	287	120.40	34,554.80	
CDW CORP/DE	335	191.54	64,165.90	
CISCO SYSTEMS INC	11,212	55.14	618,229.68	
COGNEX CORP	423	86.13	36,432.99	
CORNING INC	2,001	38.61	77,258.61	
DELL TECHNOLOGIES -C	750	112.29	84,217.50	
F5 NETWORKS INC	167	208.28	34,782.76	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,827	15.41	58,974.07	
HP INC	3,231	30.63	98,965.53	
IPG PHOTONICS CORP	120	159.64	19,156.80	
JUNIPER NETWORKS INC	802	27.64	22,167.28	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	513	177.60	91,108.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	466	245.91	114,594.06	
NETAPP INC	614	93.10	57,163.40	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	608	89.16	54,209.28	
TE CONNECTIVITY LTD	866	147.69	127,899.54	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	445.07	53,408.40	
TRIMBLE INC	734	86.95	63,821.30	
WESTERN DIGITAL CORP	807	56.83	45,861.81	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	146	532.46	77,739.16	
AT&T INC	18,880	25.64	484,083.20	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,319	29.74	39,227.06	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	2,399	12.22	29,315.78	
T-MOBILE US INC	1,656	115.93	191,980.08	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,938	52.58	575,120.04	
AES CORP	1,948	25.17	49,031.16	
ALLIANT ENERGY CORP	779	56.50	44,013.50	
AMEREN CORPORATION	730	84.73	61,852.90	
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,261	84.67	106,768.87	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	475	174.85	83,053.75	
ATMOS ENERGY CORP	294	94.20	27,694.80	
CENTERPOINT ENERGY INC	1,225	26.77	32,793.25	
CMS ENERGY CORP	656	60.25	39,524.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	822	75.88	62,373.36	
DOMINION ENERGY INC	2,132	76.50	163,098.00	
DTE ENERGY COMPANY	525	115.65	60,716.25	
DUKE ENERGY CORP	2,016	102.84	207,325.44	
EDISON INTERNATIONAL	1,059	61.10	64,704.90	
ENTERGY CORP	596	103.79	61,858.84	
ESSENTIAL UTILITIES INC	765	47.02	35,970.30	
EVERGY INC	717	64.23	46,052.91	
EVERSOURCE ENERGY	990	86.01	85,149.90	
EXELON CORP	2,485	51.59	128,201.15	
FIRSTENERGY CORP	1,481	37.37	55,344.97	
NEXTERA ENERGY INC	5,175	84.29	436,200.75	
NISOURCE INC	1,151	24.97	28,740.47	
NRG ENERGY INC	676	41.52	28,067.52	
P G & E CORP	4,032	11.66	47,013.12	
PINNACLE WEST CAPITAL	319	67.07	21,395.33	
PPL CORP	2,208	29.00	64,032.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,371	63.93	87,648.03	

	SEMPRA ENERGY	852	130.36	111,066.72	
	SOUTHERN CO	2,684	62.81	168,582.04	
	UGI CORP	547	44.66	24,429.02	
	VISTRA CORP	921	19.50	17,959.50	
	WEC ENERGY GROUP INC	858	90.38	77,546.04	
	XCEL ENERGY INC	1,401	64.66	90,588.66	
	ADVANCED MICRO DEVICES	3,183	122.36	389,471.88	
	ANALOG DEVICES INC	1,423	180.52	256,879.96	
	APPLIED MATERIALS INC	2,477	135.76	336,277.52	
	BROADCOM INC	1,076	522.07	561,747.32	
	ENPHASE ENERGY INC	348	179.43	62,441.64	
	INTEL CORP	10,646	49.41	526,018.86	
	KLA CORP	400	343.23	137,292.00	
	LAM RESEARCH CORP	382	551.97	210,852.54	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,109	67.67	142,716.03	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,600	75.80	121,280.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,973	68.76	204,423.48	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	100	522.81	52,281.00	
	NVIDIA CORP	6,630	231.66	1,535,905.80	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	713	200.29	142,806.77	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,060	46.22	48,993.20	
	QORVO INC	316	167.32	52,873.12	
	QUALCOMM INC	2,977	131.93	392,755.61	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	437	165.18	72,183.66	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	118	311.92	36,806.56	
	TERADYNE INC	480	117.28	56,294.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,416	200.20	483,683.20	
	XILINX INC	651	175.31	114,126.81	
米ドル小計		834,194		107,582,063.78 (12,246,066,320)	
加ドル	CAMECO CORP	1,260	32.84	41,378.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,103	52.84	163,962.52	
	CENOVUS ENERGY INC	3,855	14.81	57,092.55	
	ENBRIDGE INC	5,242	52.86	277,092.12	
	IMPERIAL OIL LTD	773	44.68	34,537.64	

KEYERA CORP	660	31.94	21,080.40	
PARKLAND CORP	500	37.11	18,555.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	1,595	41.88	66,798.60	
SUNCOR ENERGY INC	4,124	29.12	120,090.88	
TC ENERGY CORP	2,664	67.90	180,885.60	
AGNICO EAGLE MINES LTD	725	71.66	51,953.50	
BARRICK GOLD CORP	5,316	24.23	128,806.68	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	530	67.79	35,928.70	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,389	30.75	42,711.75	
FRANCO-NEVADA CORP	507	178.93	90,717.51	
IVANHOE MINES LTD-CL A	1,881	9.80	18,433.80	
KINROSS GOLD CORP	4,540	8.00	36,320.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	856	56.93	48,732.08	
LUNDIN MINING CORP	1,990	10.63	21,153.70	
NUTRIEN LTD	1,495	87.46	130,752.70	
PAN AMERICAN SILVER CORP	611	32.89	20,095.79	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,299	35.34	45,906.66	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	233	105.31	24,537.23	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,081	51.56	55,736.36	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	660	20.42	13,477.20	
CAE INC	753	38.13	28,711.89	
WSP GLOBAL INC	385	171.60	66,066.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	503	51.21	25,758.63	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	382	84.91	32,435.62	
THOMSON REUTERS CORP	543	147.39	80,032.77	
AIR CANADA	550	23.06	12,683.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,834	165.42	303,380.28	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,810	92.93	168,203.30	
MAGNA INTERNATIONAL INC	674	99.77	67,244.98	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	660	45.37	29,944.20	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	708	72.88	51,599.04	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,223	34.72	42,462.56	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	183.47	25,502.33	
DOLLARAMA INC	672	56.75	38,136.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	2,407	49.01	117,967.07	

	LOBLAW COMPANIES LTD	589	94.91	55,901.99	
	METRO INC	776	63.03	48,911.28	
	SAPUTO INC	748	30.86	23,083.28	
	BAUSCH HEALTH COS INC	975	35.93	35,031.75	
	CANOPY GROWTH CORP	656	16.82	11,033.92	
	BANK OF MONTREAL	1,787	137.26	245,283.62	
	BANK OF NOVA SCOTIA	3,294	82.36	271,293.84	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,267	150.63	190,848.21	
	NATIONAL BANK OF CANADA	855	103.60	88,578.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	3,783	132.45	501,058.35	
	TORONTO-DOMINION BANK	4,834	89.54	432,836.36	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	3,329	76.17	253,569.93	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	78	510.54	39,822.12	
	GREAT-WEST LIFECO INC	917	37.18	34,094.06	
	INTACT FINANCIAL CORP	473	169.54	80,192.42	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	5,669	25.12	142,405.28	
	POWER CORP OF CANADA	1,536	42.47	65,233.92	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,716	70.75	121,407.00	
	FIRSTSERVICE CORP	137	249.80	34,222.60	
	BLACKBERRY LTD	1,625	13.69	22,246.25	
	CGI INC	605	114.32	69,163.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	57	2,246.08	128,026.56	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	310	120.56	37,373.60	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	150	159.97	23,995.50	
	OPEN TEXT CORP	973	62.54	60,851.42	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	297	1,765.85	524,457.45	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	56.55	54,910.05	
	TELUS CORP	1,220	28.04	34,208.80	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,915	18.61	35,638.15	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	411	49.48	20,336.28	
	EMERA INC	675	59.07	39,872.25	
	FORTIS INC	1,363	55.13	75,142.19	
	HYDRO ONE LTD	950	29.99	28,490.50	
	NORTHLAND POWER INC	703	40.00	28,120.00	
		105,776		6,694,505.57	

加ドル小計				(615,358,951)	
ユーロ	ENI SPA	6,446	12.27	79,143.98	
	NESTE OYJ	1,076	51.06	54,940.56	
	OMV AG	556	54.96	30,557.76	
	REPSOL SA	4,038	11.67	47,155.76	
	TOTALENERGIES SE	6,724	43.92	295,351.70	
	AIR LIQUIDE SA	1,232	142.92	176,077.44	
	AKZO NOBEL	468	96.74	45,274.32	
	ARCELORMITTAL	1,679	28.42	47,725.57	
	ARKEMA	208	117.80	24,502.40	
	BASF SE	2,348	63.20	148,393.60	
	COVESTRO AG	543	56.04	30,429.72	
	CRH PLC	1,988	41.39	82,283.32	
	EVONIK INDUSTRIES AG	670	28.40	19,028.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	333	64.08	21,338.64	
	KONINKLIJKE DSM NV	480	187.15	89,832.00	
	LANXESS AG	314	59.04	18,538.56	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	739	43.80	32,368.20	
	SOLVAY SA	192	105.45	20,246.40	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,558	14.41	22,458.57	
	SYMRISE AG	407	117.15	47,680.05	
	UMICORE	604	49.79	30,073.16	
	UPM-KYMMENE OYJ	1,438	30.92	44,462.96	
	VOESTALPINE AG	348	32.16	11,191.68	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	774	22.80	17,647.20	
	AIRBUS GROUP SE	1,586	108.08	171,414.88	
	ALSTOM	875	30.90	27,037.50	
	BOUYGUES SA	502	34.31	17,223.62	
	BRENNTAG SE	402	82.30	33,084.60	
	CNH INDUSTRIAL NV	2,756	15.22	41,946.32	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,267	59.88	75,867.96	
	EIFFAGE	260	87.82	22,833.20	
	FERROVIAL SA	1,472	27.15	39,964.80	
	GEA GROUP AG	486	40.63	19,746.18	
	KINGSPAN GROUP PLC	450	96.18	43,281.00	

KION GROUP AG	261	87.92	22,947.12	
KNORR-BREMSE AG	225	91.80	20,655.00	
KONE OYJ-B	899	58.18	52,303.82	
LEGRAND SA	782	93.18	72,866.76	
MTU AERO ENGINES AG	116	181.15	21,013.40	
PRYSMIAN SPA	690	32.56	22,466.40	
RATIONAL AG	15	854.80	12,822.00	
SAFRAN SA	876	107.76	94,397.76	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,463	140.60	205,697.80	
SIEMENS AG-REG	2,052	139.02	285,269.04	
SIEMENS ENERGY AG	891	23.70	21,116.70	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	758	21.71	16,456.18	
THALES SA	393	81.32	31,958.76	
VINCI SA	1,486	89.95	133,665.70	
WARTSILA OYJ ABP	1,289	10.67	13,753.63	
BUREAU VERITAS SA	1,035	27.03	27,976.05	
RANDSTAD NV	417	61.94	25,828.98	
TELEPERFORMANCE	160	357.10	57,136.00	
WOLTERS KLUWER	669	92.00	61,548.00	
ADP	93	109.65	10,197.45	
AENA SA	247	139.60	34,481.20	
ATLANTIA SPA	1,458	16.20	23,619.60	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,970	5.47	10,783.78	
DEUTSCHE POST AG-REG	2,682	53.20	142,682.40	
GETLINK	1,605	13.22	21,226.12	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	930	87.54	81,412.20	
CONTINENTAL AG	268	97.55	26,143.40	
DAIMLER AG	2,359	82.89	195,537.51	
FAURECIA	300	42.33	12,699.00	
FERRARI NV	325	199.50	64,837.50	
MICHELIN (CGDE)-B	424	134.10	56,858.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	404	92.58	37,402.32	
RENAULT SA	379	30.97	11,739.52	
STELLANTIS NV	5,309	17.51	92,981.82	
VALEO SA	686	24.23	16,621.78	

VOLKSWAGEN AG	84	283.80	23,839.20	
VOLKSWAGEN AG-PFD	509	205.25	104,472.25	
ADIDAS AG	513	277.35	142,280.55	
ESSILORLUXOTTICA	772	170.94	131,965.68	
HERMES INTERNATIONAL	87	1,344.00	116,928.00	
KERING	203	640.00	129,920.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	738	659.80	486,932.40	
MONCLER SPA	532	61.10	32,505.20	
PUMA SE	260	102.05	26,533.00	
ACCOR SA	541	29.74	16,089.34	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	443	167.80	74,335.40	
SODEXO	273	75.88	20,715.24	
PUBLICIS GROUPE	562	56.54	31,775.48	
SCOUT24 SE	240	61.24	14,697.60	
UBISOFT ENTERTAINMENT	247	46.43	11,468.21	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	2,083	24.93	51,929.19	
VIVENDI SE	2,083	11.25	23,433.75	
DELIVERY HERO SE	387	112.35	43,479.45	
HELLOFRESH SE	442	79.62	35,192.04	
INDITEX	3,074	30.71	94,402.54	
JUST EAT TAKEAWAY	537	66.70	35,817.90	
PROSUS	2,491	76.64	190,910.24	
ZALANDO SE	601	80.00	48,080.00	
CARREFOUR SA	1,713	15.35	26,294.55	
KESKO OYJ-B SHS	643	30.12	19,367.16	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	3,047	28.35	86,397.68	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,102	48.53	102,020.57	
DANONE	1,686	56.20	94,753.20	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	2,001	12.94	25,892.94	
HEINEKEN HOLDING NV	292	77.10	22,513.20	
HEINEKEN NV	750	92.08	69,060.00	
KERRY GROUP PLC-A	390	117.90	45,981.00	
PERNOD-RICARD SA	532	199.70	106,240.40	
BEIERSDORF AG	244	95.46	23,292.24	
HENKEL AG & CO KGAA	373	70.80	26,408.40	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	404	75.96	30,687.84	
L'OREAL	669	383.85	256,795.65	
AMPLIFON SPA	380	44.54	16,925.20	
BIOMERIEUX	146	107.80	15,738.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	135	172.25	23,253.75	
DIASORIN SPA	90	191.05	17,194.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	585	61.90	36,211.50	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,254	41.40	51,915.60	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,379	41.29	98,228.91	
ORPEA	190	90.92	17,274.80	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	79	567.80	44,856.20	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	723	59.76	43,206.48	
ARGENX SE	100	249.60	24,960.00	
BAYER AG-REG	2,732	48.45	132,379.06	
EUROFINS SCIENTIFIC	362	102.90	37,249.80	
GRIFOLS SA	713	20.44	14,573.72	
IPSEN	120	89.00	10,680.00	
MERCK KGAA	308	203.20	62,585.60	
QIAGEN N.V.	760	47.00	35,720.00	
SANOFI	3,053	85.53	261,123.09	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	76	483.00	36,708.00	
UCB SA	286	101.30	28,971.80	
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	12.90	10,439.33	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	18,331	5.70	104,505.03	
BANCO SANTANDER SA	45,704	3.31	151,668.72	
BNP PARIBAS	2,874	58.21	167,295.54	
CAIXABANK S.A	11,895	2.60	30,986.47	
COMMERZBANK AG	3,549	6.47	22,976.22	
CREDIT AGRICOLE SA	3,122	13.05	40,760.83	
ERSTE GROUP BANK AG	838	37.64	31,542.32	
FINECOBANK SPA	1,495	16.78	25,093.57	
ING GROEP NV-CVA	10,410	13.14	136,849.86	
INTESA SANPAOLO	45,214	2.46	111,362.08	
KBC GROEP NV	743	80.58	59,870.94	
MEDIOBANCA SPA	2,222	10.39	23,097.69	

SOCIETE GENERALE	2,059	28.71	59,113.89	
UNICREDIT SPA	5,231	11.33	59,288.15	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,491	11.64	63,948.18	
DEUTSCHE BOERSE AG	500	144.25	72,125.00	
EXOR NV	344	79.42	27,320.48	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	389	99.18	38,581.02	
AEGON NV	4,432	4.53	20,094.68	
AGEAS	414	42.24	17,487.36	
ALLIANZ SE-REG	1,130	198.46	224,259.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	3,542	18.69	66,199.98	
AXA SA	5,033	23.93	120,439.69	
HANNOVER RUECK SE-REG	148	154.35	22,843.80	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	381	246.90	94,068.90	
NN GROUP NV	906	46.00	41,676.00	
SAMPO OYJ-A SHS	1,336	46.42	62,017.12	
SCOR SE	541	24.73	13,378.93	
AROUNDTOWN SA	3,248	6.00	19,507.48	
DEUTSCHE WOHNEN SE	1,000	51.90	51,900.00	
LEG IMMOBILIEN SE	250	133.95	33,487.50	
VONOVIA SE	1,430	53.54	76,562.20	
ADYEN NV	54	2,679.00	144,666.00	
AMADEUS IT GROUP SA	1,169	55.12	64,435.28	
ATOS SE	214	46.00	9,844.00	
CAP GEMINI SA	449	187.55	84,209.95	
DASSAULT SYSTEMES SE	1,895	46.79	88,667.05	
EDENRED	658	48.65	32,011.70	
NEMETSCHEK SE	178	101.05	17,986.90	
NEXI SPA	1,336	17.52	23,413.40	
SAP SE	2,765	123.74	342,141.10	
TEAMVIEWER AG	462	12.80	5,913.60	
WORLDLINE SA	704	66.50	46,816.00	
NOKIA OYJ	15,108	4.98	75,260.50	
CELLNEX TELECOM SA	1,417	53.98	76,489.66	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,633	16.28	140,562.50	
ELISA OYJ	506	53.06	26,848.36	

	KONINKLIJKE KPN NV	9,792	2.71	26,565.69	
	ORANGE S.A.	5,254	9.60	50,464.67	
	TELECOM ITALIA SPA	22,100	0.33	7,430.02	
	TELECOM ITALIA-RSP	23,005	0.34	7,932.12	
	TELEFONICA SA	15,066	3.82	57,589.78	
	E.ON SE	5,959	10.79	64,297.61	
	EDF	1,761	12.83	22,602.43	
	EDP RENOVAVEIS SA	838	23.78	19,927.64	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	8,753	4.89	42,845.93	
	ENDESA SA	822	19.01	15,630.33	
	ENEL SPA	21,112	7.06	149,071.83	
	ENGIE	5,327	12.08	64,382.12	
	FORTUM OYJ	1,026	27.12	27,825.12	
	IBERDROLA SA	15,635	9.65	150,877.75	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	720	21.94	15,796.80	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	989	17.69	17,495.41	
	RWE AG	1,700	32.59	55,403.00	
	SNAM SPA	7,266	4.89	35,567.07	
	SUEZ	1,226	19.76	24,225.76	
	TERNA SPA	4,271	6.45	27,547.95	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,423	28.23	40,171.29	
	VERBUND AG	152	95.90	14,576.80	
	ASM INTERNATIONAL NV	116	359.50	41,702.00	
	ASML HOLDING NV	1,111	685.60	761,701.60	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,330	39.02	129,953.25	
	STMICROELECTRONICS NV	1,769	38.25	67,673.09	
ユーロ小計		507,236		13,020,640.83 (1,719,375,621)	
英ポンド	BP PLC	53,709	3.60	193,701.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,310	17.75	200,842.98	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	9,107	17.88	162,851.37	
	ANGLO AMERICAN PLC	3,283	28.12	92,334.37	
	ANTOFAGASTA PLC	1,183	14.81	17,520.23	
	BHP GROUP PLC	5,740	19.96	114,570.40	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	385	93.00	35,805.00	

EVRAZ PLC	1,917	6.44	12,356.98	
GLENCORE PLC	25,062	3.71	93,205.57	
JOHNSON MATTHEY PLC	515	27.17	13,992.55	
MONDI PLC	1,379	17.87	24,649.62	
RIO TINTO PLC	2,985	47.66	142,280.02	
ASHTEAD GROUP PLC	1,211	58.58	70,940.38	
BAE SYSTEMS PLC ORD	9,606	5.74	55,138.44	
BUNZL PLC	865	25.86	22,368.90	
DCC PLC	217	62.14	13,484.38	
FERGUSON PLC	633	107.50	68,047.50	
MELROSE INDUSTRIES PLC	10,179	1.59	16,266.04	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	23,501	1.32	31,148.22	
SMITHS GROUP PLC	845	13.90	11,745.50	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	235	154.65	36,342.75	
EXPERIAN PLC	2,432	32.86	79,915.52	
INTERTEK GROUP PLC	389	49.06	19,084.34	
RELX PLC	5,026	22.27	111,929.02	
RENTOKIL INITIAL PLC	4,172	5.93	24,739.96	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	6.46	15,219.76	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	290	42.62	12,359.80	
BURBERRY GROUP PLC	993	18.89	18,762.73	
PERSIMMON PLC	994	26.29	26,132.26	
TAYLOR WIMPEY PLC	6,807	1.49	10,173.06	
COMPASS GROUP PLC	4,794	14.40	69,033.60	
ENTAIN PLC	1,657	21.37	35,410.09	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	393	48.58	19,091.94	
WHITBREAD PLC	639	31.55	20,160.45	
AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	6.00	17,507.49	
INFORMA PLC	4,393	5.17	22,746.95	
PEARSON PLC	2,704	6.29	17,018.97	
WPP PLC	3,319	9.43	31,311.44	
JD SPORTS FASHION PLC	1,704	10.64	18,139.08	
KINGFISHER PLC	6,190	3.43	21,262.65	
NEXT PLC	424	78.56	33,309.44	
OCADO GROUP PLC	1,268	18.27	23,166.36	

TESCO PLC	24,357	2.73	66,665.10	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	17.51	15,006.07	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,793	25.83	149,633.19	
COCA-COLA HBC AG-CDI	556	24.70	13,733.20	
DIAGEO PLC	6,185	36.20	223,927.92	
IMPERIAL BRANDS PLC	2,590	15.63	40,494.65	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,944	54.71	106,356.24	
UNILEVER PLC	6,933	38.79	268,965.73	
SMITH & NEPHEW PLC	1,973	12.98	25,609.54	
ASTRAZENECA PLC	4,135	89.42	369,751.70	
GLAXOSMITHKLINE PLC	13,003	14.24	185,240.73	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	638	24.59	15,688.42	
BARCLAYS PLC	44,794	2.00	89,856.76	
HSBC HOLDINGS PLC	54,072	4.43	239,565.99	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	181,487	0.48	88,520.28	
NATWEST GROUP PLC	13,962	2.32	32,391.84	
STANDARD CHARTERED PLC	8,143	4.89	39,827.41	
3I GROUP PLC	2,819	13.26	37,394.03	
ABRDN PLC	6,446	2.56	16,559.77	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	913	15.58	14,229.10	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	827	74.48	61,594.96	
M&G PLC	9,216	1.96	18,123.26	
ST JAMES'S PLACE PLC	1,607	15.54	24,972.78	
ADMIRAL GROUP PLC	705	30.32	21,375.60	
AVIVA PLC	11,692	3.96	46,393.85	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	15,774	2.82	44,530.00	
PRUDENTIAL PLC	6,583	14.64	96,375.12	
AVEVA GROUP PLC	377	36.43	13,734.11	
SAGE GROUP PLC/THE	3,107	7.17	22,289.61	
HALMA PLC	1,095	29.42	32,214.90	
BT GROUP PLC	21,498	1.35	29,065.29	
VODAFONE GROUP PLC	70,788	1.10	78,376.47	
NATIONAL GRID PLC	9,671	9.11	88,151.16	
SEVERN TRENT PLC	682	26.65	18,175.30	
SSE PLC	3,064	16.15	49,498.92	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	10.00	16,288.14	
英ポンド小計		757,640		4,776,644.75 (748,118,100)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	22	933.00	20,526.00	
	GIVAUDAN-REG	26	4,326.00	112,476.00	
	HOLCIM LTD	1,360	45.33	61,648.80	
	SIKA AG-REG	389	311.40	121,134.60	
	ABB LTD-REG	4,562	30.06	137,133.72	
	GEBERIT AG-REG	96	716.00	68,736.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	242.30	35,133.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	47.22	19,785.18	
	SGS SA-REG	17	2,765.00	47,005.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	164	292.10	47,904.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,403	112.15	157,346.45	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	244.00	23,180.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	10	2,098.00	20,980.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4	10,720.00	42,880.00	
	NESTLE SA-REG	7,638	116.80	892,118.40	
	ALCON INC	1,263	75.72	95,634.36	
	SONOVA HOLDING AG-REG	153	379.70	58,094.10	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	29	1,881.00	54,549.00	
	LONZA GROUP AG-REG	203	750.40	152,331.20	
	NOVARTIS AG-REG	5,870	77.02	452,107.40	
	ROCHE HOLDING AG-BR	121	393.60	47,625.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,845	357.25	659,126.25	
	VIFOR PHARMA AG	141	123.90	17,469.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	7,329	9.76	71,575.01	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	65.94	38,179.26	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	63	1,590.00	100,170.00	
	UBS GROUP AG-REG	9,363	16.36	153,178.68	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	143.10	22,896.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	87	488.50	42,499.50	
	SWISS RE AG	770	81.76	62,955.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	414	398.00	164,772.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	215	93.95	20,199.25	

	TEMENOS AG	155	117.40	18,197.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	484	81.88	39,629.92	
	SWISSCOM AG-REG	80	550.40	44,032.00	
スイスフラン小計		45,674		4,123,209.68 (509,834,876)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	650	361.10	234,715.00	
	BOLIDEN AB	620	307.10	190,402.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,812	137.60	249,331.20	
	ALFA LAVAL AB	950	331.60	315,020.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	246.90	669,839.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,644	552.60	908,474.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,262	470.30	593,518.60	
	EPIROC AB-A	1,540	213.90	329,406.00	
	EPIROC AB-B	1,322	181.00	239,282.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	349	311.30	108,643.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,908	124.65	487,132.20	
	SANDVIK AB	3,052	220.70	673,576.40	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	220.00	232,320.00	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	216.90	244,012.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	4,355	198.70	865,338.50	
	ELECTROLUX AB-B	430	198.30	85,269.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,126	113.90	128,251.40	
	EVOLUTION AB	458	1,510.00	691,580.00	
	EMBRACER GROUP AB	1,820	82.22	149,640.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,248	166.00	373,168.00	
	SWEDISH MATCH AB	3,790	80.18	303,882.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,708	277.00	473,116.00	
	NORDEA BANK ABP	8,543	111.30	950,835.90	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,444	138.60	615,938.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,361	99.66	434,617.26	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,076	195.38	405,608.88	
	EQT AB	718	446.60	320,658.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,045	282.20	294,899.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS(N)	67	282.20	18,907.40	
	INVESTOR AB-B SHS	4,788	199.02	952,907.76	

	KINNEVIK AB - B	550	339.00	186,450.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	373	617.40	230,290.20	
	SINCH AB	1,430	171.30	244,959.00	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	96.15	744,297.15	
	HEXAGON AB-B SHS	5,313	138.85	737,710.05	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	122.85	179,361.00	
	TELIA CO AB	8,145	35.39	288,251.55	
スウェーデンクローナ小計		88,992		15,151,611.55 (200,455,820)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	2,431	235.25	571,892.75	
	NORSK HYDRO A S	4,055	66.02	267,711.10	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	429.40	184,212.60	
	ADEVINTA ASA	778	152.75	118,839.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	372	397.20	147,758.40	
	MOWI ASA	1,466	247.70	363,128.20	
	ORKLA ASA	1,924	78.22	150,495.28	
	DNB BANK ASA	2,870	213.80	613,606.00	
	TELENOR ASA	2,000	137.00	274,000.00	
ノルウェークローネ小計		16,325		2,691,643.83 (36,687,105)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	320	507.80	162,496.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	602	459.20	276,438.40	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	269.90	730,349.40	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	22	18,495.00	406,890.00	
	DSV A/S	564	1,523.00	858,972.00	
	PANDORA A/S	311	888.20	276,230.20	
	CARLSBERG AS-B	293	1,054.00	308,822.00	
	AMBU A/S-B	552	186.40	102,892.80	
	COLOPLAST-B	302	1,086.00	327,972.00	
	DEMANT A/S	302	308.70	93,227.40	
	GN STORE NORD A/S	290	426.10	123,569.00	
	GENMAB A/S	196	2,985.00	585,060.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	4,445	681.30	3,028,378.50	
	DANSKE BANK A/S	2,079	116.35	241,891.65	
	ORSTED A/S	528	900.60	475,516.80	

デンマーククローネ小計		13,512		7,998,706.15 (141,977,034)	
豪ドル	AMPOL LTD	730	31.26	22,819.80	
	OIL SEARCH LTD	5,893	4.48	26,400.64	
	SANTOS LTD	3,916	7.29	28,547.64	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,652	24.13	63,992.76	
	BHP GROUP LTD	7,879	37.93	298,850.47	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,660	20.94	34,760.40	
	EVOLUTION MINING LTD	4,205	3.82	16,063.10	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,520	14.51	65,585.20	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	52.38	68,408.28	
	NEWCREST MINING LTD	2,263	25.31	57,276.53	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,384	9.66	32,689.44	
	RIO TINTO LTD	956	96.44	92,196.64	
	SOUTH32 LTD	16,210	3.80	61,598.00	
	REECE LTD	895	18.04	16,145.80	
	BRAMBLES LTD	3,858	10.28	39,660.24	
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,319	3.52	18,722.88	
	SYDNEY AIRPORT	3,332	8.30	27,655.60	
	TRANSURBAN GROUP	7,835	13.74	107,652.90	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,588	47.33	75,160.04	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD-RTS(N)	77	5.37	413.49	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	169	132.22	22,345.18	
	TABCORP HOLDINGS LTD	7,922	5.03	39,847.66	
	REA GROUP LTD	199	163.60	32,556.40	
	SEEK LTD	1,090	32.82	35,773.80	
	WESFARMERS LTD	2,988	57.64	172,228.32	
	COLES GROUP LTD	4,142	17.83	73,851.86	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	3,626	40.79	147,904.54	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	2,315	11.82	27,363.30	
	COCHLEAR LTD	227	222.36	50,475.72	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	644	70.11	45,150.84	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	39.70	47,163.60	
	CSL LTD	1,207	295.59	356,777.13	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	7,819	28.32	221,434.08	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,698	105.46	495,451.08	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,454	28.74	242,967.96	
	WESTPAC BANKING CORP	9,954	25.71	255,917.34	
	ASX LTD	514	81.36	41,819.04	
	MACQUARIE GROUP LTD	911	200.47	182,628.17	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	330	35.90	11,847.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	5.04	41,111.28	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	11.92	46,178.08	
	SUNCORP GROUP LTD	4,089	12.20	49,885.80	
	AFTERPAY LTD	490	122.60	60,074.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	485	54.08	26,228.80	
	XERO LTD	286	151.79	43,411.94	
	TELSTRA CORPORATION LTD	10,933	3.81	41,654.73	
	AGL ENERGY LTD	2,231	6.22	13,876.82	
	APA GROUP	4,476	8.55	38,269.80	
	ORIGIN ENERGY LTD	6,145	5.38	33,060.10	
豪ドル小計		178,041		4,051,854.22 (345,704,202)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,190	8.07	25,743.30	
	A2 MILK CO LTD	2,139	7.18	15,358.02	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	30.85	45,904.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,124	14.81	16,646.44	
	MERCURY NZ LTD	2,262	6.10	13,798.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,409	5.02	17,113.18	
ニュージーランドドル小計		13,612		134,563.94 (10,976,380)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,598	52.90	401,934.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	159.20	636,800.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	6,000	22.55	135,300.00	
	MTR CORP	5,500	42.05	231,275.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,000	26.00	78,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	5,161	41.90	216,245.90	
	SANDS CHINA LTD	7,000	17.18	120,260.00	
	WYNN MACAU LTD	4,400	7.10	31,240.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	5,100	18.58	94,758.00	

	WH GROUP LTD	32,000	5.27	168,640.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	13,731	24.90	341,901.90	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	145.90	313,685.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,171	484.20	1,535,398.20	
	AIA GROUP LTD	32,063	90.95	2,916,129.85	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,073	47.35	240,206.55	
	ESR CAYMAN LTD	5,400	24.80	133,920.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	8,000	18.30	146,400.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	4,750	33.95	161,262.50	
	SINO LAND CO	8,000	10.84	86,720.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,433	102.80	455,712.40	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,000	49.75	49,750.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	42.60	213,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	74.90	351,580.60	
	HONG KONG & CHINA GAS	32,768	11.72	384,040.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	45.70	182,800.00	
香港ドル小計		213,992		9,626,961.06 (140,938,709)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	5,283	5.48	28,950.84	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,100	5.27	21,607.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	6,300	4.37	27,531.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,802	31.49	151,214.98	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,108	11.99	109,204.92	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,542	26.88	95,208.96	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,976	9.66	28,748.16	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,911	3.42	30,475.62	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	24,200	2.55	61,710.00	
シンガポールドル小計		69,222		554,651.48 (46,873,596)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	1,894	27.70	52,463.80	
	BANK HAPOALIM BM	4,308	30.75	132,471.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	5,363	29.73	159,441.99	
	NICE LTD	172	905.60	155,763.20	
イスラエルシュケル小計		11,737		500,139.99 (17,787,578)	

合　　計	2,855,953		16,780,154,292 (16,780,154,292)	

(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	1,361	22,510.94	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	409	85,456.46	
		AMERICAN TOWER CORP	1,212	344,910.96	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	4,653	40,574.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	382	88,918.14	
		BOSTON PROPERTIES INC	326	38,226.76	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	291	45,948.90	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,158	205,707.12	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	763	119,577.36	
		DUKE REALTY CORPORATION	1,063	59,209.10	
		EQUINIX INC	236	194,176.08	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	497	42,742.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	957	81,593.82	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	175	58,602.25	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	323	60,875.81	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,586	54,621.84	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	33,104.61	
		INVITATION HOMES INC	1,378	56,539.34	
		IRON MOUNTAIN INC	818	37,619.82	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,990	40,297.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	270	54,345.60	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	620	18,525.60	
		PROLOGIS INC	1,972	286,137.20	
		PUBLIC STORAGE	422	138,631.22	
		REALTY INCOME CORP	957	70,693.59	
		REGENCY CENTERS CORP	482	33,932.80	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	291	101,623.02	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	844	123,924.52	
		SUN COMMUNITIES INC	317	64,034.00	
		UDR INC	680	37,175.60	
		VENTAS INC	1,005	54,792.60	
		VEREIT INC	634	32,936.30	
		VICI PROPERTIES INC	1,527	46,100.13	
		VORNADO REALTY TRUST	436	19,511.00	
		WELLTOWER INC	1,068	86,486.64	
		WEYERHAEUSER CO	2,052	77,421.96	
		WP CAREY INC	594	46,130.04	
米ドル小計			35,716	3,003,614.79 (341,901,471)	
ユーロ	投資証券	GECINA SA	150	18,090.00	
		KLEPIERRE	588	12,106.92	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	23,250.24	
ユーロ小計			1,089	53,447.16 (7,057,697)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	3,140	15,225.86	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	11,448.05	
		SEGRO PLC	3,361	43,289.68	
英ポンド小計			8,195	69,963.59 (10,957,697)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	2,875	31,941.25	
		GOODMAN GROUP	4,311	97,256.16	
		GPT GROUP	5,900	31,211.00	
		LENDLEASE GROUP	1,550	16,662.50	
		MIRVAC GROUP	11,628	34,418.88	
		SCENTRE GROUP	11,481	35,591.10	
		STOCKLAND	5,114	24,240.36	
		VICINITY CENTRES	10,480	18,864.00	
豪ドル小計			53,339	290,185.25 (24,758,605)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	5,967	409,037.85	
香港ドル小計			5,967	409,037.85 (5,988,314)	

シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	10,162	31,197.34	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	17,278	36,629.36	
シンガポールドル小計			27,440	67,826.70 (5,732,034)	
合計				396,395,818 (396,395,818)	

(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	590銘柄	97.3%	—	71.3%
	投資証券	37銘柄	—	2.7%	2.0%
加ドル	株式	74銘柄	100.0%	—	3.6%
ユーロ	株式	200銘柄	99.6%	—	10.0%
	投資証券	3銘柄	—	0.4%	0.0%
英ポンド	株式	78銘柄	98.6%	—	4.4%
	投資証券	3銘柄	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式	35銘柄	100.0%	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式	37銘柄	100.0%	—	1.2%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%	—	0.8%
豪ドル	株式	49銘柄	93.3%	—	2.0%
	投資証券	8銘柄	—	6.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式	25銘柄	95.9%	—	0.8%
	投資証券	1銘柄	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	9銘柄	89.1%	—	0.3%
	投資証券	2銘柄	—	10.9%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	4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。

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10月26日現在	2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	211,983,356	71,007,193
国債証券	33,233,854,647	36,703,224,643
地方債証券	3,257,020,000	4,809,141,758
特殊債券	4,609,275,000	5,296,862,350
社債券	2,433,814,438	1,617,886,592
未収入金	-	57,033,800
未収利息	82,296,959	84,374,456
前払費用	1,250,848	2,584,908
流動資産合計	43,829,495,248	48,642,115,700
資産合計	43,829,495,248	48,642,115,700
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,272,541	24,088,484
未払利息	59	28
流動負債合計	22,272,600	24,088,512
負債合計	22,272,600	24,088,512
純資産の部		
元本等		
元本	31,007,104,895	34,479,945,047
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	12,800,117,753	14,138,082,141
元本等合計	43,807,222,648	48,618,027,188
純資産合計	43,807,222,648	48,618,027,188
負債純資産合計	43,829,495,248	48,642,115,700

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。

	（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
１．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	28,913,282,954円	31,007,104,895円
	期首からの追加設定元本額	6,276,681,341円	5,127,924,648円
	期首からの一部解約元本額	4,182,859,400円	1,655,084,496円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	3,299,809,640円	4,165,088,588円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	2,929,229,354円	3,824,408,447円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	2,061,514,447円	2,792,330,713円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	316,092,415円	453,495,710円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,146,139,820円	2,228,428,435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	3,542,424,372円	4,120,607,198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）	1,593,046,655円	1,703,336,062円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	4,546,069円	5,011,963円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	24,979,029円	30,178,231円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	96,410,954円	99,004,620円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	254,848,043円	244,385,579円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	4,110,973,037円	4,024,703,763円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,390,321,836円	1,457,917,809円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,314,190,148円	1,449,114,415円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	714,039,343円	816,461,795円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	102,165,160円	116,490,805円
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	6,790,875,434円	6,607,446,677円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	315,499,139円	341,534,237円
	計	31,007,104,895円	34,479,945,047円
２．	受益権の総数	31,007,104,895口	34,479,945,047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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年10月26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10月26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	△846,332,693
地方債証券	△15,749,000
特殊債券	△27,205,000
社債券	△17,321,562
合計	△906,608,255

（2021年10月26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	△421,073,277
地方債証券	△20,961,242
特殊債券	△31,174,650
社債券	△7,985,408
合計	△481,194,577

(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10月26日現在		2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4128円	1口当たり純資産額	1.4100円
(1万口当たり純資産額)	(14,128円)	(1万口当たり純資産額)	(14,100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	99,962,800	
	第２回利付国債（４０年）	140,000,000	193,841,200	
	第３回利付国債（４０年）	85,000,000	118,425,400	
	第４回利付国債（４０年）	95,000,000	133,313,500	
	第５回利付国債（４０年）	75,000,000	101,599,500	
	第６回利付国債（４０年）	110,000,000	146,808,200	
	第７回利付国債（４０年）	80,000,000	102,752,800	
	第８回利付国債（４０年）	95,000,000	114,235,600	
	第９回利付国債（４０年）	130,000,000	117,399,100	
	第１０回利付国債（４０年）	125,000,000	131,903,750	
	第１１回利付国債（４０年）	140,000,000	143,229,800	
	第１２回利付国債（４０年）	175,000,000	161,750,750	
	第１３回利付国債（４０年）	180,000,000	165,843,000	
	第１４回利付国債（４０年）	90,000,000	88,631,100	
	第３２３回利付国債（１０年）	45,000,000	45,295,278	
	第３２５回利付国債（１０年）	210,000,000	211,729,350	
	第３２６回利付国債（１０年）	30,000,000	30,277,500	
	第３２７回利付国債（１０年）	65,000,000	65,676,000	
	第３２８回利付国債（１０年）	115,000,000	116,131,600	
	第３２９回利付国債（１０年）	230,000,000	233,431,600	
	第３３０回利付国債（１０年）	210,000,000	213,614,100	

第３３１回利付国債（１０年）	80,000,000	81,072,800	
第３３３回利付国債（１０年）	210,000,000	213,500,700	
第３３４回利付国債（１０年）	120,000,000	122,212,800	
第３３５回利付国債（１０年）	490,000,000	498,472,100	
第３３６回利付国債（１０年）	80,000,000	81,489,600	
第３３７回利付国債（１０年）	30,000,000	30,369,300	
第３３８回利付国債（１０年）	390,000,000	396,438,900	
第３３９回利付国債（１０年）	370,000,000	376,563,800	
第３４０回利付国債（１０年）	420,000,000	428,051,400	
第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	711,214,000	
第３４２回利付国債（１０年）	130,000,000	131,002,300	
第３４３回利付国債（１０年）	245,000,000	246,940,400	
第３４４回利付国債（１０年）	50,000,000	50,405,000	
第３４５回利付国債（１０年）	610,000,000	615,197,200	
第３４６回利付国債（１０年）	690,000,000	696,161,700	
第３４７回利付国債（１０年）	160,000,000	161,449,600	
第３４８回利付国債（１０年）	90,000,000	90,825,300	
第３４９回利付国債（１０年）	590,000,000	595,457,500	
第３５０回利付国債（１０年）	680,000,000	686,099,600	
第３５１回利付国債（１０年）	535,000,000	539,627,750	
第３５２回利付国債（１０年）	590,000,000	595,091,700	
第３５３回利付国債（１０年）	300,000,000	302,466,000	
第３５４回利付国債（１０年）	325,000,000	327,642,250	
第３５５回利付国債（１０年）	250,000,000	251,910,000	
第３５６回利付国債（１０年）	200,000,000	201,420,000	
第３５７回利付国債（１０年）	720,000,000	724,975,200	
第３５８回利付国債（１０年）	660,000,000	664,144,800	
第３５９回利付国債（１０年）	550,000,000	553,080,000	
第３６０回利付国債（１０年）	200,000,000	200,974,000	
第３６１回利付国債（１０年）	70,000,000	70,254,100	
第３６２回利付国債（１０年）	250,000,000	250,582,500	
第３６３回利付国債（１０年）	200,000,000	200,190,000	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	60,961,500	
第３回利付国債（３０年）	70,000,000	83,569,500	
第５回利付国債（３０年）	80,000,000	96,092,800	
第６回利付国債（３０年）	50,000,000	61,460,000	

第８回利付国債（３０年）	80,000,000	94,529,600	
第１４回利付国債（３０年）	108,000,000	136,985,040	
第１５回利付国債（３０年）	147,000,000	188,936,160	
第１６回利付国債（３０年）	35,000,000	45,122,000	
第１７回利付国債（３０年）	50,000,000	64,010,000	
第１８回利付国債（３０年）	110,000,000	139,769,300	
第１９回利付国債（３０年）	40,000,000	50,989,200	
第２０回利付国債（３０年）	40,000,000	52,228,800	
第２１回利付国債（３０年）	70,000,000	89,730,900	
第２２回利付国債（３０年）	70,000,000	91,947,100	
第２３回利付国債（３０年）	55,000,000	72,433,350	
第２４回利付国債（３０年）	68,000,000	89,782,440	
第２５回利付国債（３０年）	60,000,000	77,611,800	
第２６回利付国債（３０年）	170,000,000	223,023,000	
第２７回利付国債（３０年）	89,000,000	118,711,760	
第２８回利付国債（３０年）	144,000,000	193,049,280	
第２９回利付国債（３０年）	176,000,000	234,125,760	
第３０回利付国債（３０年）	147,000,000	193,840,080	
第３１回利付国債（３０年）	120,000,000	156,732,000	
第３２回利付国債（３０年）	160,000,000	212,449,600	
第３３回利付国債（３０年）	135,000,000	172,647,450	
第３４回利付国債（３０年）	180,000,000	237,457,800	
第３５回利付国債（３０年）	168,000,000	215,950,560	
第３６回利付国債（３０年）	135,000,000	174,087,900	
第３７回利付国債（３０年）	161,000,000	205,006,130	
第３８回利付国債（３０年）	95,000,000	119,445,400	
第３９回利付国債（３０年）	115,000,000	147,165,500	
第４０回利付国債（３０年）	90,000,000	113,540,400	
第４１回利付国債（３０年）	90,000,000	111,757,500	
第４２回利付国債（３０年）	135,000,000	167,794,200	
第４３回利付国債（３０年）	155,000,000	192,837,050	
第４４回利付国債（３０年）	150,000,000	186,790,500	
第４５回利付国債（３０年）	160,000,000	192,595,200	
第４６回利付国債（３０年）	160,000,000	192,704,000	
第４７回利付国債（３０年）	165,000,000	202,522,650	
第４８回利付国債（３０年）	85,000,000	100,685,900	

第４９回利付国債（３０年）	140,000,000	165,897,200	
第５０回利付国債（３０年）	95,000,000	99,678,750	
第５１回利付国債（３０年）	90,000,000	84,022,200	
第５２回利付国債（３０年）	130,000,000	127,045,100	
第５３回利付国債（３０年）	105,000,000	104,884,500	
第５４回利付国債（３０年）	110,000,000	114,847,700	
第５５回利付国債（３０年）	110,000,000	114,761,900	
第５６回利付国債（３０年）	90,000,000	93,824,100	
第５７回利付国債（３０年）	100,000,000	104,167,000	
第５８回利付国債（３０年）	100,000,000	103,964,000	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	172,517,700	
第６０回利付国債（３０年）	120,000,000	127,452,000	
第６１回利付国債（３０年）	100,000,000	101,153,000	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	115,144,800	
第６３回利付国債（３０年）	90,000,000	83,939,400	
第６４回利付国債（３０年）	100,000,000	93,106,000	
第６５回利付国債（３０年）	110,000,000	102,239,500	
第６６回利付国債（３０年）	180,000,000	167,209,200	
第６７回利付国債（３０年）	110,000,000	107,631,700	
第６８回利付国債（３０年）	140,000,000	136,963,400	
第６９回利付国債（３０年）	110,000,000	110,400,400	
第７０回利付国債（３０年）	110,000,000	110,403,700	
第７１回利付国債（３０年）	120,000,000	120,295,200	
第５８回利付国債（２０年）	135,000,000	137,448,505	
第５９回利付国債（２０年）	33,000,000	33,684,420	
第６０回利付国債（２０年）	295,000,000	300,100,550	
第６１回利付国債（２０年）	27,000,000	27,416,610	
第６３回利付国債（２０年）	31,000,000	31,974,020	
第６４回利付国債（２０年）	54,000,000	56,059,560	
第６５回利付国債（２０年）	100,000,000	104,293,000	
第６６回利付国債（２０年）	34,000,000	35,386,520	
第６７回利付国債（２０年）	34,000,000	35,623,500	
第６８回利付国債（２０年）	78,000,000	82,286,100	
第７０回利付国債（２０年）	104,000,000	110,883,760	
第７２回利付国債（２０年）	112,000,000	119,127,680	
第７３回利付国債（２０年）	113,000,000	120,436,530	

第７４回利付国債（２０年）	118,000,000	126,137,280	
第７５回利付国債（２０年）	10,000,000	10,742,000	
第７６回利付国債（２０年）	21,000,000	22,415,190	
第７７回利付国債（２０年）	40,000,000	42,831,600	
第７９回利付国債（２０年）	160,000,000	172,171,200	
第８２回利付国債（２０年）	60,000,000	65,115,000	
第８７回利付国債（２０年）	130,000,000	143,039,000	
第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	333,144,000	
第９０回利付国債（２０年）	16,000,000	17,785,280	
第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	279,122,500	
第９２回利付国債（２０年）	60,000,000	66,709,200	
第９３回利付国債（２０年）	60,000,000	66,706,800	
第９４回利付国債（２０年）	50,000,000	55,860,000	
第９５回利付国債（２０年）	82,000,000	92,964,220	
第９６回利付国債（２０年）	98,000,000	109,993,240	
第９７回利付国債（２０年）	45,000,000	50,989,950	
第９８回利付国債（２０年）	94,000,000	105,955,860	
第９９回利付国債（２０年）	117,000,000	132,470,910	
第１００回利付国債（２０年）	30,000,000	34,296,900	
第１０１回利付国債（２０年）	66,000,000	76,299,300	
第１０２回利付国債（２０年）	81,000,000	94,108,230	
第１０３回利付国債（２０年）	11,000,000	12,706,870	
第１０４回利付国債（２０年）	33,000,000	37,681,050	
第１０５回利付国債（２０年）	77,000,000	88,306,680	
第１０６回利付国債（２０年）	2,000,000	2,307,500	
第１０７回利付国債（２０年）	130,000,000	149,674,200	
第１０８回利付国債（２０年）	134,000,000	152,362,020	
第１０９回利付国債（２０年）	27,000,000	30,815,910	
第１１０回利付国債（２０年）	98,000,000	113,300,740	
第１１１回利付国債（２０年）	25,000,000	29,205,500	
第１１２回利付国債（２０年）	80,000,000	92,845,600	
第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	337,835,500	
第１１４回利付国債（２０年）	52,000,000	60,822,840	
第１１５回利付国債（２０年）	125,000,000	147,226,250	
第１１６回利付国債（２０年）	55,000,000	65,020,450	
第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	402,620,260	

第１１８回利付国債（２０年）	10,000,000	11,693,900	
第１１９回利付国債（２０年）	30,000,000	34,564,500	
第１２０回利付国債（２０年）	170,000,000	192,934,700	
第１２１回利付国債（２０年）	22,000,000	25,617,020	
第１２２回利付国債（２０年）	17,000,000	19,644,180	
第１２３回利付国債（２０年）	195,000,000	231,295,350	
第１２４回利付国債（２０年）	90,000,000	105,932,700	
第１２５回利付国債（２０年）	50,000,000	59,939,500	
第１２６回利付国債（２０年）	105,000,000	123,912,600	
第１２７回利付国債（２０年）	50,000,000	58,539,500	
第１２８回利付国債（２０年）	65,000,000	76,287,900	
第１２９回利付国債（２０年）	85,000,000	98,947,650	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	175,078,500	
第１３１回利付国債（２０年）	12,000,000	13,888,680	
第１３２回利付国債（２０年）	75,000,000	87,011,250	
第１３３回利付国債（２０年）	30,000,000	35,105,700	
第１３４回利付国債（２０年）	50,000,000	58,653,500	
第１３５回利付国債（２０年）	30,000,000	34,884,000	
第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	253,556,600	
第１３７回利付国債（２０年）	200,000,000	233,096,000	
第１３８回利付国債（２０年）	120,000,000	137,335,200	
第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	265,643,100	
第１４０回利付国債（２０年）	358,000,000	418,398,180	
第１４１回利付国債（２０年）	195,000,000	228,389,850	
第１４２回利付国債（２０年）	125,000,000	147,776,250	
第１４３回利付国債（２０年）	94,000,000	109,269,360	
第１４４回利付国債（２０年）	430,000,000	495,033,200	
第１４５回利付国債（２０年）	355,000,000	417,504,850	
第１４６回利付国債（２０年）	135,000,000	159,088,050	
第１４７回利付国債（２０年）	98,000,000	114,542,400	
第１４８回利付国債（２０年）	90,000,000	104,276,700	
第１４９回利付国債（２０年）	115,000,000	133,439,100	
第１５０回利付国債（２０年）	140,000,000	160,921,600	
第１５１回利付国債（２０年）	140,000,000	157,530,800	
第１５２回利付国債（２０年）	300,000,000	337,812,000	
第１５３回利付国債（２０年）	270,000,000	308,021,400	

	第１５４回利付国債（２０年）	160,000,000	180,537,600	
	第１５５回利付国債（２０年）	270,000,000	297,467,100	
	第１５６回利付国債（２０年）	160,000,000	162,768,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	150,000,000	148,102,500	
	第１５８回利付国債（２０年）	170,000,000	174,972,500	
	第１５９回利付国債（２０年）	150,000,000	156,406,500	
	第１６０回利付国債（２０年）	140,000,000	147,912,800	
	第１６１回利付国債（２０年）	120,000,000	124,912,800	
	第１６２回利付国債（２０年）	150,000,000	156,000,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	165,000,000	171,435,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	255,000,000	260,727,300	
	第１６５回利付国債（２０年）	170,000,000	173,600,600	
	第１６６回利付国債（２０年）	100,000,000	105,248,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	160,000,000	162,958,400	
	第１６８回利付国債（２０年）	100,000,000	100,000,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	160,000,000	156,974,400	
	第１７０回利付国債（２０年）	140,000,000	137,088,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	170,000,000	166,139,300	
	第１７２回利付国債（２０年）	230,000,000	228,433,700	
	第１７３回利付国債（２０年）	150,000,000	148,708,500	
	第１７４回利付国債（２０年）	200,000,000	197,912,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	140,000,000	140,861,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	160,000,000	160,708,800	
	第１７７回利付国債（２０年）	150,000,000	147,712,500	
国債証券 合計		33,789,000,000	36,703,224,643	
地方債証券	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,754,000	
	第７１２回東京都公募公債	200,000,000	201,381,875	
	第７３０回東京都公募公債	100,000,000	101,565,000	
	第７３１回東京都公募公債	100,000,000	101,496,000	
	第７３６回東京都公募公債	100,000,000	101,435,000	
	第７３９回東京都公募公債	100,000,000	100,882,000	
	第７４４回東京都公募公債	100,000,000	102,068,000	
	令和３年度第６回北海道公募公債（５年）	100,000,000	99,928,000	
	第２１４回神奈川県公募公債	100,000,000	102,017,000	
	平成２５年度第１０回静岡県公募公債	200,000,000	203,180,000	
	平成２７年度第１０回静岡県公募公債	200,000,000	203,554,000	

	平成２６年度第１２回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,026,000	
	平成２４年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	101,099,000	
	平成２６年度第３回埼玉県公募公債	200,000,000	203,384,000	
	平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	106,764,000	
	平成２４年度第９回福岡県公募公債	100,000,000	100,825,000	
	平成２６年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	101,399,000	
	第１０回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	101,383,000	
	平成２５年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	101,551,000	
	平成２６年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	101,593,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,694,000	
	第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,525,000	
	第１４２回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,174,000	
	第１４４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,568,000	
	第１４７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,971,000	
	第１６５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,134,000	
	平成２４年度第１回長崎県公募公債	100,000,000	100,753,868	
	平成２８年度第１回長崎県公募公債	100,000,000	100,446,000	
	平成２７年度第１回佐賀県公募公債	100,000,000	101,910,000	
	平成２９年度第１回滋賀県公募公債	100,000,000	100,759,000	
	平成２７年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	101,880,000	
	第２回名古屋市定時償還公募公債（１０年）	40,000,000	40,178,960	
	第４８６回名古屋市公募公債（１０年）	200,000,000	203,274,000	
	平成２７年度第５回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,813,000	
	第５１回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,014,055	
	第５３回川崎市公募公債（５年）	100,000,000	100,041,000	
	令和元年度第１回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	99,972,000	
	令和２年度第１回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	100,051,000	
	平成２５年度第２回福井県公募公債	200,000,000	202,698,000	
地方債証券 合計		4,740,000,000	4,809,141,758	
特殊債券	第１回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,687,175	
	第２回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,496,000	
	第５回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,568,000	
	第５回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,660,000	
	第１３回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,900,000	
	第１６回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,752,200	

第２２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,464,000	
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	100,695,975	
第３５回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,902,000	
第６０回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,821,000	
第１７回道路債券	100,000,000	101,762,000	
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	112,067,000	
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	113,481,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,985,000	
第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,591,000	
第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,334,000	
第１３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,377,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,419,000	
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,679,000	
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	100,012,000	
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	200,472,000	
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	100,464,000	
第１１回公営企業債券（２０年）	100,000,000	107,119,000	
第１３回公営企業債券（２０年）	100,000,000	107,804,000	
第４５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,098,000	
Ｆ５４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,753,000	
第５６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,724,000	
第６０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,833,000	
第６２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,678,000	
Ｆ６３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,686,000	
第７４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,879,000	
第８１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,737,000	
第９６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,776,000	
第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,505,000	
Ｆ１０１回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,662,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,696,000	
Ｆ２９０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,659,000	

	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	100,934,000	
	第５２回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,365,000	
	第３９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	101,718,000	
	第１９回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,415,000	
	第３５７回信金中金債（５年）	100,000,000	99,957,000	
	第３６３回信金中金債（５年）	100,000,000	99,899,000	
	第２９回国際協力機構債券	100,000,000	102,034,000	
	第３７回国際協力機構債券	100,000,000	100,342,000	
特殊債券 合計		5,200,000,000	5,296,862,350	
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	101,624,000	
	第２５回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付）	100,000,000	101,507,000	
	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	100,211,000	
	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	200,390,000	
	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	101,330,000	
	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	101,515,455	
	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	103,713,000	
	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	201,544,137	
	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	101,547,000	
	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	201,744,000	
	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	101,469,000	
	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	100,006,000	
	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	101,286,000	
社債券 合計		1,600,000,000	1,617,886,592	
合計		45,329,000,000	48,427,115,343	

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10月26日現在	2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	94,568,404	163,236,561
コール・ローン	18,168,132	21,345,245
国債証券	151,573,682,113	158,054,958,026
派生商品評価勘定	46,431	201,424
未収入金	165,967,376	94,274,239
未収利息	1,147,349,861	986,017,043
前払費用	29,999,629	25,797,561
流動資産合計	153,029,781,946	159,345,830,099
資産合計	153,029,781,946	159,345,830,099
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	163,507	76,670
未払解約金	194,737,553	129,447,656
未払利息	5	8
流動負債合計	194,901,065	129,524,334
負債合計	194,901,065	129,524,334
純資産の部		
元本等		
元本	62,305,294,771	61,672,878,643
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	90,529,586,110	97,543,427,122
元本等合計	152,834,880,881	159,216,305,765
純資産合計	152,834,880,881	159,216,305,765
負債純資産合計	153,029,781,946	159,345,830,099

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	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。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券

	金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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礎となる事項	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10月26日現在	2021年10月26日現在
1．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	66,014,655,688円	62,305,294,771円
	期首からの追加設定元本額	7,433,213,464円	5,092,447,058円
	期首からの一部解約元本額	11,142,574,381円	5,724,863,186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）	13,606,901,842円	14,821,148,270円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	290,429,905円	353,037,161円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	372,429,728円	470,603,500円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	471,286,049円	619,099,493円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	361,323,232円	500,890,063円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	22,100,204,303円	20,225,218,218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	2,032,710,032円	2,289,399,731円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	15,849,657,187円	14,500,797,808円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,006,742,263円	900,317,948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）	150,608,646円	157,019,480円
	財産３分法（適格機関投資家専用）	－円	24,920,544円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	2,599,441円	2,796,108円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	2,854,393円	3,295,953円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	6,124,228円	6,106,515円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	11,219,101円	10,297,506円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	792,945,418円	1,750,402,022円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	782,824,655円	741,844,896円

	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	61,105,570円	61,212,474円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	83,466,931円	88,314,261円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	81,761,903円	90,547,305円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	58,449,486円	64,570,825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	3,900,506,886円	3,711,173,590円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,143,572円	279,864,972円
	計	62,305,294,771円	61,672,878,643円
２．	受益権の総数	62,305,294,771口	61,672,878,643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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	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。	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10月26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	4,153,948,724
合計	4,153,948,724

（2021年10月26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	△7,532,287,116
合計	△7,532,287,116

(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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,634,190	－	23,635,495	1,305
	米ドル	23,634,190	－	23,635,495	1,305
	売建	215,564,043	－	215,682,424	△118,381
	米ドル	115,173,465	－	115,159,000	14,465
	ユーロ	76,756,388	－	76,892,400	△136,012
	豪ドル	23,634,190	－	23,631,024	3,166
合計		239,198,233	－	239,317,919	△117,076

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	162,163,552	－	162,038,798	124,754
	米ドル	62,529,500	－	62,606,170	△76,670
	ユーロ	90,359,624	－	90,192,107	167,517
	英ポンド	9,274,428	－	9,240,521	33,907
合計		162,163,552	－	162,038,798	124,754

（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。

①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。

②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10月26日現在		2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.4530円	1口当たり純資産額	2.5816円
(1万口当たり純資産額)	(24,530円)	(1万口当たり純資産額)	(25,816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-1.75%-22/09/30	3,550,000.00	3,603,971.36	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/09/30	2,040,000.00	2,073,405.20	
		US TREASURY N/B-1.375%-22/10/15	3,000,000.00	3,036,240.30	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,053,122.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,445,123.12	
		US TREASURY N/B-0.125%-22/10/31	8,000,000.00	8,000,092.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,031,278.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,478,998.96	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,073,388.88	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,988,587.72	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,047,636.70	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,038,398.40	
		US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,622,956.25	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/01/31	3,000,000.00	2,996,132.82	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,352,917.94	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,522,324.20	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,151,585.86	

		US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	907,981.18	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,006,250.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,034,687.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,196,811.92	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,497,128.91	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,182,860.12	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,731,695.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,708,486.29	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,960,950.76	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,530,527.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,349,841.74	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,495,507.80	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,525,400.25	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	2,350,000.00	2,438,446.24	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,667,960.93	
		US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,045,058.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,123,750.00	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/31	7,000,000.00	6,966,230.46	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,499,785.09	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	3,860,000.00	3,840,096.87	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	4,550,000.00	4,629,002.56	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,982,070.32	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,544,580.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	690,744.12	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,390,921.86	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,739,279.18	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	943,259.76	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,185,781.20	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	8,000,000.00	7,962,187.52	
		US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,771,234.97	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,899,757.53	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,975,390.64	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,074,804.60	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,582,066.37	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,076,992.00	

		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,630,692.76	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,466,611.06	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,554,462.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,698,160.73	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,959,375.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	4,001,281.79	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,069,101.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,121,699.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,540,417.84	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,600,000.00	2,574,101.55	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,004,467.02	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,648,410.16	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,381,622.86	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,736,007.37	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,588,481.24	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	2,640,000.00	2,717,498.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,836,021.03	
		US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,955,078.10	
		US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,466,843.24	
		US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,335,173.67	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	2,096,032.82	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,248,941.20	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,138,815.75	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,901,595.55	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	1,650,000.00	1,724,282.17	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,457,968.68	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,547,464.97	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,987,095.62	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,339,330.07	
		US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,581,767.55	
		US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,670,000.00	3,736,446.81	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,870,000.00	5,056,619.86	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,190,278.72	
		US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,554,467.53	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,662,452.96	

		US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,551,018.95	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,351,894.38	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,111,829.09	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,006,718.72	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,230,387.64	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	1,972,932.42	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,460,735.64	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,543,359.31	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,923,066.41	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,217,564.10	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,203,261.70	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,067,095.38	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	320,000.00	311,012.49	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,510,605.46	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	3,800,000.00	3,686,816.39	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,393,285.32	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,418,458.53	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,330,024.62	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,129,882.80	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,971,225.50	
		US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	5,000,000.00	4,854,882.80	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,175,539.04	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,387,125.31	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,898,553.65	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,559,534.16	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,173,459.42	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,363,390.61	
		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	6,100,000.00	6,441,099.19	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,695,421.48	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,948,332.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,863,353.43	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,067,695.20	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	2,960,000.00	3,060,188.89	
		US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	3,179,264.07	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,063,828.00	

		US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,941,054.68	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,655,658.95	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,503,545.73	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	3,160,768.56	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,931,548.01	
		US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,055,156.20	
		US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,029,140.60	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	360,000.00	378,850.75	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	994,433.59	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,170,344.13	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	959,003.91	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,738,835.15	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,532,218.75	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,500,000.00	3,349,335.92	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,897,500.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	3,115,457.72	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,100,000.00	2,002,875.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,590,000.00	4,341,315.22	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	5,000,000.00	4,756,445.30	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,662,810.86	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,178,550.00	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,785,203.13	
		US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	5,000,000.00	4,809,179.70	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,332,109.20	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,210,000.00	3,160,219.92	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	3,960,000.00	3,922,488.26	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,335,839.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,395,695.24	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	4,252,884.77	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	3,260,490.22	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	632,167.95	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,593,750.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,815,296.87	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,345,023.38	
		US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,014,820.08	

		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	1,870,000.00	2,018,358.13	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,122,500.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,140,000.00	3,167,229.45	
		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	2,890,000.00	2,941,985.89	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,326,946.10	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,462,344.51	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	4,245,032.81	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,692,741.38	
		US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	5,745,309.37	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	878,934.34	
		US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	8,400,000.00	8,057,437.50	
		US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	7,490,518.37	
		US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,650,000.00	4,489,066.38	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	1,086,234.32	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,077,831.97	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	909,472.60	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	992,109.31	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	989,031.20	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,960,218.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,977,876.82	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,031,220.67	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	964,391.36	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,195,504.27	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,171,232.40	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,872,787.39	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	1,700,000.00	1,451,474.60	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,375,888.25	
		US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,763,480.46	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,172,451.05	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,208,348.39	
		US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	3,000,000.00	3,095,156.10	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,234,762.46	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	592,285.15	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	894,968.72	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,236,054.60	

		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	2,090,973.43	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,339,322.24	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	2,489,372.92	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	2,719,530.78	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	1,382,990.54	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	2,968,218.72	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,561,355.41	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,688,933.45	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,550,722.45	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,641,500.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,400,000.00	3,907,875.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	2,700,000.00	3,172,500.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,019,406.04	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,697,753.75	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,215,507.70	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,310,859.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,309,413.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,171,926.32	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,265,000.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,219,350.72	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,262,670.67	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,914,265.52	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	4,874,435.47	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,749,323.15	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	3,936,732.36	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,503,027.10	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	3,054,229.40	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,295,142.52	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	3,631,564.46	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	2,004,166.98	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	2,168,487.69	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	2,693,144.52	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	4,526,601.56	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	4,370,023.13	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,962,812.50	

米ドル小計			621,190,000.00	645,875,941.85 (73,520,058,460)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/11/01	1,440,000.00	1,435,750.56	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/02/01	770,000.00	766,417.96	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,242,701.37	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/05/01	740,000.00	735,079.74	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,033,006.02	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/08/01	810,000.00	802,538.28	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,501,904.88	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	814,652.74	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	950,000.00	934,461.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,164,688.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	805,920.91	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	613,471.51	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	988,025.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,108,978.46	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	952,578.17	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	778,049.58	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,440,000.00	1,417,595.04	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	636,843.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	731,725.91	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	720,000.00	939,183.12	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	574,000.00	605,551.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	2,143,606.09	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,005,000.00	911,268.67	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	420,000.00	414,599.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,112,252.37	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	600,000.00	854,743.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	820,000.00	1,093,306.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	990,000.00	1,269,963.09	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	945,000.00	1,086,358.77	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,703,000.00	2,677,167.42	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	160,000.00	147,603.68	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	391,787.52	
			32,657,000.00	34,111,780.13	

加ドル小計				(3,135,554,829)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%-23/03/09	13,100,000.00	13,202,343.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,200,000.00	16,615,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	17,900,000.00	18,347,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	16,700,000.00	18,093,406.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	24,250,000.00	22,908,671.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,100,000.00	20,156,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	19,870,000.00	20,993,896.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	16,900,000.00	17,116,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,300,000.00	6,349,218.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,100,000.00	4,920,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	14,150,000.00	14,888,453.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	12,500,000.00	12,222,656.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	13,582,721.87	
メキシコペソ小計			195,640,000.00	199,397,056.23 (1,124,858,613)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	226,763.09	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	855,000.00	897,014.27	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	615,000.00	625,905.05	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	975,000.00	1,059,317.02	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	840,000.00	867,610.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,395,000.00	1,462,135.77	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	818,963.11	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,132,000.00	1,205,452.08	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	930,000.00	987,747.42	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	502,240.86	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,320,000.00	1,814,007.36	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,028,447.78	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,120,000.00	1,203,391.83	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	804,188.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	1,085,940.00	

		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	390,000.00	382,707.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	923,063.46	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	910,000.00	1,016,063.23	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	724,320.73	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,305,000.00	2,105,793.67	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	486,127.32	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	535,000.00	651,672.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	315,969.72	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,187,000.00	1,975,577.51	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	665,000.00	1,100,532.44	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	908,492.89	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	640,000.00	774,467.20	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	574,713.62	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	684,859.53	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	555,000.00	502,097.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%-22/10/31	1,420,000.00	1,435,256.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,533,041.64	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-23/04/30	1,313,000.00	1,325,094.04	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-23/07/30	1,290,000.00	1,311,357.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,540,000.00	1,695,035.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,185,000.00	1,328,687.41	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,340,000.00	1,484,824.52	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-24/05/31	1,000,000.00	1,010,735.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,180,000.00	1,202,106.12	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,520,000.00	1,667,123.84	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,430,000.00	1,447,611.88	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-	1,450,000.00	1,550,705.40	

		25/04/30			
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,490,000.00	1,771,389.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,745,000.00	1,917,084.92	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,270,000.00	1,281,724.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,335,000.00	1,465,281.31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,490,000.00	1,924,115.97	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,720,000.00	1,846,624.68	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,475,000.00	1,604,503.52	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,315,000.00	1,377,522.99	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,600,000.00	1,740,748.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	910,000.00	906,699.43	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,470,000.00	1,596,867.61	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,475,000.00	1,606,235.17	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,155,000.00	1,562,108.62	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,745,000.00	2,488,984.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,345,000.00	1,472,172.44	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,470,000.00	1,511,443.71	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,420,000.00	1,443,093.46	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,430,000.00	1,630,650.45	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,660,000.00	1,789,893.34	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,455,000.00	1,408,869.94	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-	730,000.00	729,221.09	

		31/10/31			
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,500,000.00	2,324,592.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,370,000.00	1,638,015.84	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,415,000.00	1,612,212.08	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,400,000.00	2,085,041.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	661,448.22	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,260,000.00	2,120,958.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	1,024,921.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,400,000.00	2,328,891.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	300,000.00	295,430.88	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	990,000.00	1,808,356.77	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,170,000.00	1,604,911.23	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	1,314,339.67	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	1,080,012.96	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	1,322,338.97	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-22/10/07	1,000,000.00	1,006,721.00	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,768,223.10	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,120,614.20	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,321,631.09	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,385,681.56	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/04/11	1,550,000.00	1,580,764.40	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	550,000.00	561,929.50	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,636,340.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	1,900,000.00	1,954,729.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	1,720,000.00	1,779,450.08	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	1,850,000.00	1,942,061.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	911,154.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,230,000.00	1,300,486.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,875,000.00	1,980,276.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,830,000.00	1,915,662.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,770,000.00	1,835,252.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	1,740,000.00	1,843,604.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	2,685,000.00	2,803,803.19	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,320,000.00	2,374,104.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,125,000.00	2,203,952.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	1,130,000.00	1,584,486.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	2,165,000.00	2,280,885.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,150,000.00	1,176,791.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,150,000.00	1,587,557.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,845,000.00	1,948,135.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,308,197.29	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,737,808.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,080,000.00	1,103,293.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	2,055,000.00	2,139,511.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,830,000.00	1,867,907.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	1,280,000.00	1,977,922.56	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,410,000.00	1,438,090.02	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,700,000.00	1,730,084.89	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	420,000.00	429,700.74	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,706,878.08	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	2,420,000.00	2,455,707.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	400,000.00	406,103.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,475,000.00	2,393,388.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	1,200,000.00	1,196,838.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-36/05/15	1,000,000.00	988,938.94	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,790,000.00	2,886,706.15	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,235,000.00	2,160,405.26	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,680,000.00	3,161,733.12	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	1,581,205.91	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	2,325,000.00	3,578,614.42	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	2,692,000.00	4,238,636.37	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	2,599,843.32	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,230,000.00	1,148,636.73	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	360,000.00	340,564.68	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/12/15	650,000.00	655,202.60	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/09/15	1,315,000.00	1,331,835.41	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	300,000.00	296,024.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/11/01	2,000,000.00	2,121,190.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%-23/01/15	600,000.00	603,837.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-23/03/01	910,000.00	927,096.17	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-23/03/15	1,200,000.00	1,223,094.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	1,025,000.00	1,101,955.97	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-23/06/15	1,000,000.00	1,017,040.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	1,700,000.00	1,854,851.81	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%-23/08/15	1,640,000.00	1,659,632.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-23/10/01	1,310,000.00	1,381,342.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%-23/10/15	1,160,000.00	1,182,500.63	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	860,000.00	1,021,176.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/01/15	1,110,000.00	1,116,088.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	1,650,000.00	1,833,524.55	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/04/15	1,360,000.00	1,366,249.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-24/05/15	1,075,000.00	1,130,959.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%-24/07/01	1,360,000.00	1,429,622.48	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/08/15	200,000.00	200,636.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	1,450,000.00	1,611,383.55	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-24/11/15	1,260,000.00	1,319,844.96	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	1,080,000.00	1,167,167.88	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-25/02/01	1,485,000.00	1,505,408.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	1,540,000.00	1,800,912.96	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-25/05/15	1,175,000.00	1,236,848.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	1,300,000.00	1,370,935.93	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01	1,000,000.00	1,067,708.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,300,000.00	1,428,908.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,480,000.00	1,597,295.92	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	1,150,000.00	1,168,343.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,730,000.00	2,059,635.93	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,220,000.00	1,211,777.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	1,230,000.00	1,310,658.48	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	1,220,000.00	1,329,987.88	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	973,139.04	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,565,000.00	1,644,606.85	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,180,000.00	1,214,456.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,280,588.96	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	1,395,000.00	1,529,104.14	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	1,145,000.00	1,182,367.07	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	2,060,000.00	2,805,007.24	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	1,785,000.00	1,957,388.16	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	1,230,000.00	1,212,428.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	500,000.00	498,845.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,706,573.54	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,255,000.00	1,450,889.18	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	1,380,000.00	1,626,554.94	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	2,050,000.00	2,790,218.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,740,000.00	2,132,968.56	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	1,200,000.00	1,259,520.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	1,167,000.00	1,181,914.26	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,452,000.00	1,554,888.72	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,375,000.00	1,377,681.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	2,230,000.00	3,284,357.38	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,245,000.00	1,208,628.15	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-31/12/01	780,000.00	778,658.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,610,000.00	1,717,027.97	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,630,000.00	2,448,087.22	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,140,000.00	1,308,481.74	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,580,000.00	2,296,643.76	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	1,050,000.00	1,323,252.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01	900,000.00	920,847.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	1,100,000.00	1,241,691.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	2,205,000.00	3,010,501.93	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	1,200,000.00	1,477,368.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,600,000.00	2,489,248.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	610,000.00	766,751.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,720,000.00	2,709,063.64	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	830,000.00	864,556.22	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	1,345,000.00	2,143,176.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	260,000.00	252,744.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	1,120,000.00	1,469,919.36	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	1,270,000.00	1,525,264.92	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,135,000.00	1,545,183.32	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	850,000.00	1,240,249.45	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	1,180,000.00	1,353,521.36	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	750,000.00	731,059.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	680,000.00	799,701.76	
		FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	330,000.00	340,825.98	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	370,000.00	374,597.62	
		FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	390,000.00	415,787.19	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	285,000.00	289,777.45	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	497,050.25	
		FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	337,046.72	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	557,305.22	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	101,788.60	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	418,686.40	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	456,471.58	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	282,555.54	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	480,864.22	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	112,000.00	111,757.85	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	525,000.00	559,914.60	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	405,235.77	

FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15		400,000.00	387,775.60	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15		220,000.00	212,872.44	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04		325,000.00	468,780.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15		260,000.00	317,693.22	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15		250,000.00	220,687.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25		515,000.00	404,733.86	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25		2,540,000.00	2,614,838.05	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25		2,830,000.00	2,857,325.91	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25		960,000.00	1,092,572.16	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25		3,160,000.00	3,281,438.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25		3,630,000.00	3,989,083.23	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25		1,140,000.00	1,156,056.32	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25		2,390,000.00	2,425,176.97	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25		2,824,000.00	3,033,665.05	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25		2,758,000.00	2,954,769.51	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25		2,475,000.00	2,516,537.92	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25		2,610,000.00	2,702,952.54	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25		2,550,000.00	3,215,786.13	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25		2,770,000.00	2,932,413.41	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25		1,800,000.00	1,829,734.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25		3,070,000.00	3,609,224.01	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25		2,275,000.00	2,365,456.27	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25		3,010,000.00	3,096,122.12	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25		360,000.00	364,906.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25		2,615,000.00	2,799,880.50	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25		3,350,000.00	3,956,376.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25		3,250,000.00	3,443,576.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25		3,030,000.00	3,212,527.20	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25		2,745,000.00	3,897,444.33	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25		2,780,000.00	2,893,293.34	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25		2,780,000.00	2,775,121.10	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25		3,175,000.00	3,845,782.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25		3,169,000.00	3,136,051.92	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25		3,560,000.00	4,017,449.31	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25		1,865,000.00	1,824,393.35	

FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,540,000.00	4,074,759.44	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,745,000.00	3,043,653.25	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,735,000.00	2,744,565.27	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,825,000.00	3,139,156.95	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,810,000.00	2,846,465.73	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,340,000.00	2,828,463.30	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,220,418.52	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	960,000.00	919,834.56	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,630,000.00	2,534,923.84	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,830,000.00	2,362,330.53	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	2,090,000.00	2,437,654.78	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	2,370,000.00	2,277,584.68	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,300,000.00	2,465,776.30	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,140,000.00	2,263,521.30	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,047,505.80	
IRISH TREASURY-0.0%-22/10/18	135,000.00	135,834.43	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	570,000.00	606,283.35	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	550,000.00	603,152.82	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	760,000.00	911,687.64	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	775,000.00	822,717.52	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	501,267.06	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	554,604.44	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	700,000.00	758,599.10	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	651,000.00	780,214.38	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	177,000.00	177,882.34	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	720,000.00	801,248.40	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	555,000.00	540,824.19	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	393,947.40	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	308,302.75	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	459,358.38	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	244,512.50	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	589,000.00	752,406.27	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	444,000.00	516,041.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	374,506.18	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	525,000.00	578,006.62	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,070,000.00	1,115,794.93	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	980,000.00	994,430.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,085,000.00	1,163,237.18	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,305,000.00	1,342,706.67	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,240,000.00	1,295,153.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	968,000.00	986,119.97	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,125,000.00	1,195,848.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	825,000.00	1,125,457.49	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	1,026,157.72	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	765,000.00	788,572.71	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	875,000.00	879,931.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	580,000.00	579,230.21	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,025,000.00	1,305,596.81	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,814,158.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	100,000.00	96,115.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	1,073,000.00	1,127,238.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,240,000.00	2,107,837.56	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,248,000.00	2,008,982.97	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	575,000.00	518,816.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	223,620.83	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	652,521.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	172,915.22	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	720,000.00	751,486.32	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	434,444.91	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	576,900.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	950,000.00	996,624.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	564,368.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	913,140.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	200,000.00	203,568.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	758,813.21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	600,000.00	742,138.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	1,003,000.00	1,059,629.38	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	715,843.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	938,946.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	700,379.46	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	640,000.00	667,665.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	740,000.00	738,954.38	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	658,364.09	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	610,000.00	773,082.09	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	215,000.00	209,668.21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,030,000.00	1,623,836.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	260,000.00	236,207.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	464,000.00	734,313.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	615,851.57	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	335,000.00	345,912.62	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	312,000.00	646,460.88	
ユーロ小計			411,096,000.00	477,947,905.60 (63,113,020,934)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	773,805.50	
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,710,000.00	1,701,364.50	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,310,000.00	1,350,257.34	
		UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,530,000.00	1,512,440.48	
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,130,000.00	1,141,028.80	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	927,500.00	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,378,646.76	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	811,975.62	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	1,110,000.00	1,081,232.35	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	849,189.70	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,590,000.00	1,628,939.10	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,094,462.46	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	845,000.00	806,364.39	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	890,000.00	934,072.97	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	958,606.50	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	848,958.54	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,220,000.00	1,147,078.16	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,419,644.14	
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,260,000.00	1,156,568.60	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,791,161.83	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	120,000.00	115,956.00	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,315,521.26	

		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,057,000.00	964,227.11	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	1,903,691.72	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,517,668.62	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,010,000.00	1,540,859.83	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,417,833.48	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	1,388,349.71	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	525,000.00	511,514.32	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,218,322.54	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,615,000.00	2,190,686.13	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,450,000.00	2,060,132.74	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	387,828.60	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,275,000.00	2,046,946.71	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,460,000.00	1,496,343.48	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	732,181.13	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	1,497,694.07	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	540,000.00	444,673.80	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,107,000.00	1,772,817.99	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	682,017.17	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,062,000.00	1,918,991.08	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,216,990.30	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	926,000.00	1,701,092.74	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	730,000.00	563,397.06	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	980,000.00	1,789,993.52	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,625,000.00	1,630,299.77	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	929,391.60	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,177,000.00	1,691,416.32	
英ポンド小計			50,207,000.00	60,960,136.54 (9,547,576,584)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,960,000.00	7,207,080.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,220,000.00	5,696,331.26	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,200,000.00	5,440,474.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	4,086,788.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	4,400,000.00	4,552,878.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,531,615.06	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	2,138,211.00	

		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,385,000.00	4,950,970.05	
スウェーデンクローナ小計			33,515,000.00	36,604,347.87 (484,275,522)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,520,000.00	5,604,146.88	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,513,877.76	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,390,000.00	3,424,398.33	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,746,264.95	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,640,000.00	2,663,152.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	2,802,965.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	2,784,002.35	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,550,000.00	3,459,652.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,959,318.00	
ノルウェークローネ小計			29,740,000.00	29,957,778.77 (408,324,524)	
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	4,440,139.87	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	4,240,000.00	4,424,389.12	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,260,000.00	1,278,610.20	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,310,000.00	5,773,540.16	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,510,000.00	4,696,339.67	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,830,000.00	2,952,241.85	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,150,000.00	1,135,110.20	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,180,000.00	19,567,600.46	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	1,223,209.00	
デンマーククローネ小計			36,180,000.00	45,491,180.53 (807,468,454)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,124,423.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-23/04/25	1,430,000.00	1,393,034.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,750,000.00	1,825,425.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	2,142,388.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,430,000.00	2,450,339.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,377,748.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,690,000.00	2,795,663.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,090,000.00	3,126,987.30	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,750,000.00	1,578,762.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,340,000.00	2,350,904.40	

		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,294,826.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	677,155.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	3,145,000.00	3,165,473.95	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,125,000.00	1,875,737.50	
ポーランドズロチ小計			29,215,000.00	29,178,869.85 (835,250,985)	
豪ドル	**国債証券**	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,360,000.00	1,391,039.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,650,000.00	1,781,274.49	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	855,000.00	910,468.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,685,000.00	1,660,000.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,220,000.00	1,318,676.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,230,000.00	1,191,955.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,280,000.00	1,456,632.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,340,000.00	1,296,491.39	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,270,000.00	1,505,457.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,160,000.00	1,254,585.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,050,000.00	1,104,901.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	840,000.00	912,436.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,130,000.00	1,268,780.49	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,200,000.00	1,305,999.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,850,000.00	1,976,555.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,900,000.00	1,785,385.36	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,678,000.00	1,641,635.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,920,000.00	1,781,582.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,494,193.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	790,000.00	782,279.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,320,731.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	576,344.63	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	905,160.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	749,751.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	890,000.00	933,211.99	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	870,000.00	942,700.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	848,512.07	
豪ドル小計			32,745,000.00	34,096,742.19 (2,909,134,043)	

シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	630,000.00	639,324.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	564,129.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	190,000.00	195,391.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	572,184.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	410,000.00	430,295.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	349,000.00	341,182.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	488,640.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	475,000.00	526,015.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	308,908.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	543,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	589,140.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	210,000.00	208,039.57	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	405,000.00	464,859.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	513,059.07	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	228,580.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	372,000.00	409,884.48	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	457,000.00	505,442.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	432,000.00	406,728.00	
シンガポールドル小計			7,536,000.00	7,935,551.47 (670,633,454)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.795%-22/09/30	760,000.00	773,639.64	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	645,088.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	700,000.00	720,265.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	791,468.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	862,370.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	320,000.00	330,879.04	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,650,000.00	1,711,050.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	804,414.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	750,000.00	775,875.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,132,450.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,343,100.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	780,000.00	719,160.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	739,829.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,064,800.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	850,000.00	865,725.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	890,000.00	943,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	637,417.47	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,270,000.00	1,191,895.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	610,858.56	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	741,598.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	840,044.84	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,010,000.00	956,028.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,130,000.00	1,151,074.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	977,318.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,070,000.00	1,125,419.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	464,601.46	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	958,075.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,220,000.00	1,239,520.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	966,529.83	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,073,423.54	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	967,813.03	
マレーシアリンギット小計			27,570,000.00	28,125,131.02 (771,357,030)	
イスラエルシュケル	**国債証券**	ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,012,948.60	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,320,000.00	1,398,559.00	
		ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	1,160,000.00	1,160,392.54	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,250,000.00	1,285,298.00	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,539,602.90	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,359,045.14	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,304,498.72	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	525,061.88	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,100,000.00	1,397,446.82	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,347,340.33	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,349,434.12	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,615,000.00	1,581,608.26	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,160,000.00	1,086,070.63	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,330,000.00	2,077,348.81	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,620,000.00	2,029,175.38	
イスラエルシュケル小計			18,625,000.00	20,453,831.13 (727,444,594)	

合計		158,054,958,026 (158,054,958,026)	

(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%	46.6%
加ドル	国債証券　32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　336銘柄	100.0%	39.9%
英ポンド	国債証券　48銘柄	100.0%	6.0%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券　27銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　31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

「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。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年10月26日現在	2021年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	80,664,456	94,822,487
コール・ローン	265,782,979	176,632,228
国債証券	24,438,089,823	25,084,499,464
派生商品評価勘定	328,393,143	5,845,123
未収入金	-	269,314,857
未収利息	234,079,598	205,713,414
前払費用	12,867,726	5,189,942
流動資産合計	25,359,877,725	25,842,017,515
資産合計	25,359,877,725	25,842,017,515
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,469,202	614,900,264
未払解約金	12,281,934	2,855,481
未払利息	74	70
流動負債合計	17,751,210	617,755,815
負債合計	17,751,210	617,755,815
純資産の部		
元本等		
元本	15,326,314,880	15,760,382,772
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	10,015,811,635	9,463,878,928
元本等合計	25,342,126,515	25,224,261,700
純資産合計	25,342,126,515	25,224,261,700
負債純資産合計	25,359,877,725	25,842,017,515

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	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。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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礎となる事項	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10月26日現在	2021年10月26日現在
１．	期首	2019年10月29日	2020年10月27日
	期首元本額	15,247,027,897円	15,326,314,880円
	期首からの追加設定元本額	3,146,539,886円	1,464,475,775円
	期首からの一部解約元本額	3,067,252,903円	1,030,407,883円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（ＤＣ専用）	3,833,097,916円	4,087,190,320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）	1,136,513,820円	1,238,549,893円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	3,874,458円	4,403,325円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	4,256,652円	5,297,362円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	9,124,934円	9,597,905円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	16,682,495円	16,573,076円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	9,335,627,641円	9,387,722,617円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	90,986,014円	98,744,927円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	124,325,198円	140,965,478円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	121,687,096円	142,979,875円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	87,021,402円	102,372,497円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）１年決算型	563,117,254円	525,985,497円
	計	15,326,314,880円	15,760,382,772円
２．	受益権の総数	15,326,314,880口	15,760,382,772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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年10月29日 至 2020年10月26日	自 2020年10月27日 至 2021年10月26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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年10月26日現在	2021年10月26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10月26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	611,292,964
合計	611,292,964

（2021年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△1,304,668,146
合計	△1,304,668,146

(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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,064,619,601	－	24,741,695,660	322,923,941
	米ドル	10,952,310,532	－	10,807,974,230	144,336,302
	加ドル	515,832,567	－	509,256,070	6,576,497
	メキシコペソ	190,817,894	－	194,779,200	△3,961,306
	ユーロ	10,180,865,945	－	10,067,752,040	113,113,905
	英ポンド	1,665,216,835	－	1,632,757,360	32,459,475
	スウェーデンクローナ	117,932,268	－	116,741,560	1,190,708
	ノルウェークローネ	66,912,852	－	64,308,700	2,604,152
	デンマーククローネ	128,076,286	－	127,055,840	1,020,446
	ポーランドズロチ	131,543,481	－	126,715,590	4,827,891
	豪ドル	667,172,388	－	650,114,680	17,057,708
	シンガポールドル	105,907,660	－	105,362,210	545,450

	マレーシアリンギット	250,760,018	－	248,111,910	2,648,108
	イスラエルシュケル	91,270,875	－	90,766,270	504,605
合計		25,064,619,601	－	24,741,695,660	322,923,941

（2021年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,132,848,047	－	25,741,903,188	△609,055,141
	米ドル	11,594,463,001	－	11,942,916,384	△348,453,383
	加ドル	471,156,657	－	494,758,896	△23,602,239
	メキシコペソ	192,913,775	－	197,272,283	△4,358,508
	ユーロ	9,962,497,839	－	10,111,686,771	△149,188,932
	英ポンド	1,535,343,385	－	1,576,508,117	△41,164,732
	スウェーデンクローナ	120,576,900	－	124,494,300	△3,917,400
	ノルウェークローネ	68,969,525	－	72,876,300	△3,906,775
	デンマーククローネ	82,713,604	－	82,996,250	△282,646
	ポーランドズロチ	160,471,648	－	161,254,720	△783,072
	豪ドル	478,090,634	－	493,618,719	△15,528,085
	シンガポールドル	105,685,309	－	107,989,902	△2,304,593
	マレーシアリンギット	256,755,119	－	267,948,028	△11,192,909
	イスラエルシュケル	103,210,651	－	107,582,518	△4,371,867
合計		25,132,848,047	－	25,741,903,188	△609,055,141

（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。

①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。

②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10月26日現在		2021年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6535円	1口当たり純資産額	1.6005円
(1万口当たり純資産額)	(16,535円)	(1万口当たり純資産額)	(16,005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%-22/09/30	1,000,000.00	1,016,375.10	
		US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	700,000.00	712,395.25	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	1,100,000.00	1,122,257.73	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	1,400,000.00	1,431,800.72	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	1,000,000.00	1,015,878.90	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	1,600,000.00	1,630,718.72	
		US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,500,000.00	1,540,781.25	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	700,000.00	716,105.46	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,400,000.00	2,441,624.88	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	3,550,000.00	3,628,349.56	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	600,000.00	610,160.10	

		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	800,000.00	830,109.36	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	580,000.00	641,239.82	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	2,000,000.00	2,075,390.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/08/31	300,000.00	312,785.13	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/31	500,000.00	497,265.62	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	1,000,000.00	1,046,582.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,440,000.00	1,506,881.23	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,000,000.00	1,049,589.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,080,000.00	1,134,527.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	1,300,000.00	1,347,581.95	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,256,953.08	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,400,000.00	2,485,171.68	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	3,830,000.00	4,009,082.37	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	1,000,000.00	1,022,246.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,800,000.00	3,971,074.10	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	1,650,000.00	1,713,228.49	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	1,500,000.00	1,564,599.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	700,000.00	746,361.28	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	2,300,000.00	2,390,517.42	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	2,000,000.00	2,098,554.60	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,460,537.11	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	900,000.00	958,447.26	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,637,281.12	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,400,000.00	2,453,718.72	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	914,361.30	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	505,107.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	4,000,000.00	4,158,906.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,157,599.52	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,000,000.00	2,853,867.18	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	678,772.64	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	2,900,000.00	3,052,250.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	989,863.28	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,000,000.00	988,027.34	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	400,000.00	388,375.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,640,625.00	

US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	1,400,000.00	1,369,593.75	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	263,976.55	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	900,000.00	971,402.31	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	600,000.00	605,203.08	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	500,000.00	508,994.10	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	1,200,000.00	1,196,390.62	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	2,700,000.00	2,538,843.75	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	532,687.48	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	600,000.00	600,843.72	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	1,000,000.00	965,390.62	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	529,539.23	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	230,761.70	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	482,152.71	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	137,496.09	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	317,588.66	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	455,191.38	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	277,781.24	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	257,242.18	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	414,011.71	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	335,408.19	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	118,468.75	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	285,283.20	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	178,724.21	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	260,242.18	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	550,000.00	704,300.74	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	148,410.93	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	600,000.00	701,460.90	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	1,400,000.00	1,506,367.10	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	527,625.00	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	804,562.50	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	235,000.00	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,350,000.00	1,455,785.05	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	161,865.22	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,750,000.00	2,833,788.92	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	346,628.88	

		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,550,000.00	1,755,375.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,050,000.00	1,190,252.91	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	1,035,332.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	3,100,000.00	2,535,884.75	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,800,000.00	1,518,785.15	
米ドル小計			99,110,000.00	102,698,570.38 (11,690,178,266)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/11/01	400,000.00	398,819.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	600,000.00	608,878.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	200,000.00	204,340.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	450,000.00	446,848.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	400,000.00	393,457.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	400,000.00	402,276.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	382,946.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	626,122.08	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	510,000.00	726,531.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	266,660.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	256,558.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	450,000.00	445,699.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	116,951.50	
加ドル小計			4,790,000.00	5,276,090.10 (484,978,201)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	7,000,000.00	7,179,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	5,000,000.00	5,417,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	5,000,000.00	5,014,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	6,339,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,500,000.00	2,532,031.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	4,734,843.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	3,000,000.00	2,933,437.50	
メキシコペソ小計			33,000,000.00	34,150,312.50 (192,652,157)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	170,000.00	178,353.71	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	200,000.00	217,295.80	

BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22		150,000.00	159,733.05	
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28		380,000.00	522,214.24	
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22		200,000.00	213,149.80	
BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22		400,000.00	402,094.00	
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22		1,000,000.00	1,085,940.00	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28		170,000.00	237,758.77	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28		260,000.00	419,545.10	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28		450,000.00	748,955.25	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22		220,000.00	364,085.92	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22		80,000.00	112,734.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31		300,000.00	330,201.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31		300,000.00	336,376.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30		500,000.00	534,726.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30		600,000.00	713,311.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30		900,000.00	987,830.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30		800,000.00	1,033,082.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30		300,000.00	325,891.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30		500,000.00	544,486.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31		650,000.00	879,108.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31		830,000.00	1,183,872.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31		500,000.00	514,096.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30		600,000.00	684,189.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31		300,000.00	323,474.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30		300,000.00	290,488.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31		430,000.00	640,405.45	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	400,000.00	665,397.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	150,000.00	273,993.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	400,000.00	548,687.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	333,588.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	155,936.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/02/15	300,000.00	308,641.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-23/05/15	500,000.00	517,282.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	200,000.00	209,952.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	570,000.00	657,415.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	500,000.00	528,073.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	250,000.00	261,702.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	500,000.00	518,433.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	500,000.00	529,771.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	650,000.00	678,760.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	400,000.00	414,861.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	560,000.00	773,071.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	200,000.00	269,731.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	350,000.00	540,838.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	470,000.00	722,732.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	300,000.00	486,790.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	900,000.00	897,628.50	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	260,000.00	419,298.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	150,000.00	262,397.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	470,000.00	884,532.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	650,000.00	1,076,213.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	350,000.00	538,716.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	550,000.00	865,991.83	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	200,000.00	186,770.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-23/05/01	850,000.00	913,817.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	600,000.00	654,653.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	430,000.00	510,588.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	700,000.00	777,858.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	200,000.00	222,259.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	450,000.00	526,240.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	500,000.00	549,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	950,000.00	1,131,013.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	700,000.00	946,107.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	500,000.00	548,066.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	600,000.00	816,992.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	550,000.00	705,725.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	750,000.00	1,020,811.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	900,000.00	1,103,259.60	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	700,000.00	701,365.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	650,000.00	957,323.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	375,473.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	250,000.00	363,393.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	560,000.00	764,571.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	450,000.00	700,101.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	472,511.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	239,016.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	800,000.00	1,049,942.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	400,000.00	544,558.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	294,008.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	103,280.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	233,906.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	300,000.00	360,372.30	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	166,535.25	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	144,240.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	400,000.00	411,785.52	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	200,000.00	227,619.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	850,000.00	882,665.50	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	750,000.00	824,190.75	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	650,000.00	698,258.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	750,000.00	803,508.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	414,245.60	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	950,000.00	1,198,037.97	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	600,000.00	635,179.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	470,257.20	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	350,000.00	413,352.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	500,000.00	530,120.00	

		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	695,718.66
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	700,000.00	728,527.10
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	950,000.00	1,150,706.50
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	800,000.00	902,797.60
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,300,000.00	2,085,506.80
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	1,000,000.00	1,108,799.00
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	180,000.00	284,738.76
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	500,000.00	555,603.00
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	723,411.18
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	181,311.75
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-40/05/25	670,000.00	654,754.37
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	430,018.00
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	450,000.00	699,825.60
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	300,000.00	387,267.30
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	606,960.32
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	694,940.75
		IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	200,000.00	212,731.00
		IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	300,000.00	359,876.70
		IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	300,000.00	318,471.30
		IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	359,545.80
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	200,000.00	235,568.40
		IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	200,000.00	255,486.00
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	270,000.00	284,835.69
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	150,000.00	156,419.85
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	100,000.00	107,210.80
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	154,334.10
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	200,000.00	208,895.68
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	470,000.00	641,169.72
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	600,000.00	764,251.80
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	700,000.00	1,104,270.30
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	210,109.60
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	321,952.40
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	250,000.00	262,269.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	100,000.00	106,800.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	200,000.00	247,379.48

		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	276,160.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	200,000.00	208,645.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	800,000.00	1,013,878.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	350,000.00	551,789.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	250,000.00	395,642.87	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	165,759.20	
ユーロ小計			59,500,000.00	74,731,745.95 (9,868,327,052)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-0.125%-23/01/31	300,000.00	298,485.00	
		UK TREASURY-0.125%-24/01/31	300,000.00	296,556.96	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	500,000.00	530,000.00	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	600,000.00	614,694.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	180,405.90	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	270,000.00	364,540.50	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	500,000.00	495,887.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	264,119.84	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	366,076.87	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	400,000.00	554,487.36	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	200,000.00	182,446.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	260,000.00	361,284.56	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	259,352.64	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	100,000.00	148,486.60	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	270,000.00	424,785.16	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	550,000.00	746,054.10	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	450,000.00	722,451.78	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	102,489.28	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	108,471.28	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	1,011,897.37	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	734,813.28	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	547,957.20	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	300,000.00	315,048.00	
英ポンド小計			7,260,000.00	9,630,790.68 (1,508,374,436)	
スウェーデンク	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	2,500,000.00	2,588,750.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	1,850,000.00	2,018,814.72	

ローナ		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,569,367.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	2,078,816.25	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	1,023,834.28	
スウェーデンクローナ小計			8,300,000.00	9,279,582.75 (122,768,879)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,421,341.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	468,028.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	1,010,147.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	998,641.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,329,874.00	
ノルウェークローネ小計			5,150,000.00	5,228,033.20 (71,258,092)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	543,647.85	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	4,025,534.98	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	4,569,182.83 (81,102,995)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,000,000.00	1,043,100.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	1,000,000.00	1,015,350.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	800,000.00	831,424.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	800,000.00	809,576.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	600,000.00	609,246.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	1,006,510.00	
ポーランドズロチ小計			5,200,000.00	5,315,206.00 (152,148,834)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	323,868.09	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	450,000.00	479,193.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	200,000.00	216,176.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	480,000.00	546,237.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	400,000.00	474,159.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	400,000.00	432,615.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	650,000.00	729,829.49	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	500,000.00	534,204.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	500,000.00	469,838.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	663,784.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	487,603.75	

豪ドル小計			4,880,000.00	5,357,510.55 (457,102,800)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	200,000.00	207,020.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	442,960.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	200,000.00	229,560.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	165,276.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	210,140.00	
シンガポールドル小計			1,140,000.00	1,254,956.00 (106,056,331)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,000,000.00	1,037,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,441,300.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	1,017,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	968,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	535,840.85	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	611,190.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	1,000,000.00	1,039,700.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,366,535.82	
マレーシアリンギット小計			8,750,000.00	9,017,066.67 (247,301,168)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,200,000.00	1,271,417.28	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	635,203.10	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	968,388.16	
イスラエルシュケル小計			2,320,000.00	2,875,008.54 (102,250,253)	
合計				25,084,499,464 (25,084,499,464)	

(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　86銘柄	100.0%	46.7%
加ドル	国債証券　13銘柄	100.0%	1.9%

メキシコペソ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	138銘柄	100.0%	39.3%
英ポンド	国債証券	23銘柄	100.0%	6.0%
スウェーデンクローナ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券	11銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券	5銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	8銘柄	100.0%	1.0%
イスラエルシュケル	国債証券	3銘柄	100.0%	0.4%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年10月29日現在です。

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	4,544,810,846円
Ⅱ　負債総額	8,805,918円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,536,004,928円
Ⅳ　発行済口数	2,437,466,581口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8610円

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	42,635,152,406円
Ⅱ　負債総額	1,075,117,036円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	41,560,035,370円
Ⅳ　発行済口数	21,393,460,096口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9427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

Ⅰ　資産総額	256,102,704,732円
Ⅱ　負債総額	139,740,247円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	255,962,964,485円
Ⅳ　発行済口数	61,838,770,543口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.1392円

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	18,149,503,101円
Ⅱ　負債総額	388,531,855円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,760,971,246円
Ⅳ　発行済口数	6,861,635,982口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5884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

Ⅰ　資産総額	48,882,824,947円
Ⅱ　負債総額	4,383,111円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,878,441,836円
Ⅳ　発行済口数	34,616,234,138口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4120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

Ⅰ　資産総額	160,485,432,780円
Ⅱ　負債総額	34,005,769円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	160,451,427,011円
Ⅳ　発行済口数	61,744,625,531口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5986円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	26,043,652,373円
Ⅱ　負債総額	648,948,744円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,394,703,629円
Ⅳ　発行済口数	15,782,553,532口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6090円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換

該当事項はありません。

（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

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

・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めた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。

③ 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ます。

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2021年10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10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10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や流動性リスクの管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理／コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

２【事業の内容及び営業の概況】

・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
・委託会社の運用する、2021年10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			870	268,881
	株式投資信託		801	233,590
		単位型	297	11,272
		追加型	504	222,317
	公社債投資信託		69	35,291
		単位型	56	2,155
		追加型	13	33,136

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。

　また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第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。

　また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第63期中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第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				
ソフトウエア		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	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　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 (2) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　３年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(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。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。

4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
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		オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	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－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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 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）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 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 売建 米ドル	投資有価証券	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 米ドル	投資有価証券	4,620	－	△273
	香港ドル		862	－	△57
	人民元		1,684	－	△117
	ユーロ		180	－	△5
合計			7,347	－	△453

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（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　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	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

①　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。

②　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　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
　　当事業年度末における本源的価値の合計額　　1,633百万円
　　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　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　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。

②　単価情報

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

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

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

(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	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

1　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。

2　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(米国ドル貸建)(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 (米国ドル貸建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注1)	―	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	配当の受取	1,783 (USD 17,000 千)	―	―
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750 千)	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　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。

2　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。

3　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。

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

(単位：百万円)

	第63期中間会計期間 (2021年９月30日)
資産の部	
流動資産	
現金・預金	29,614
有価証券	244
未収委託者報酬	24,429
未収収益	1,019
関係会社短期貸付金	1,846

その他	※２	2,556
流動資産合計		59,710
固定資産		
有形固定資産	※１	392
無形固定資産		295
投資その他の資産		
投資有価証券		24,330
関係会社株式		28,277
長期差入保証金		664
繰延税金資産		1,790
投資その他の資産合計		55,062
固定資産合計		55,749
資産合計		115,460

(単位：百万円)

		第63期中間会計期間 (2021年９月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		12,200
未払費用		4,648
未払法人税等		2,426
未払消費税等	※３	2,260
賞与引当金		2,224
役員賞与引当金		2
その他		1,090
流動負債合計		24,855
固定負債		
退職給付引当金		1,501
賞与引当金		261
その他		341
固定負債合計		2,104
負債合計		26,960
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		66,282
利益剰余金合計		66,282
自己株式		△2,067
株主資本合計		86,798
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	1,674
繰延ヘッジ損益	26
評価・換算差額等合計	1,701
純資産合計	88,500
負債純資産合計	115,460

（２）中間損益計算書

(単位：百万円)

		第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)
営業収益		
委託者報酬		50,001
その他営業収益		2,200
営業収益合計		52,202
営業費用及び一般管理費	※１	45,253
営業利益		6,948
営業外収益	※２	5,135
営業外費用	※３	275
経常利益		11,808
特別利益	※４	167
特別損失	※５	30
税引前中間純利益		11,945
法人税等	※６	2,428
中間純利益		9,517

（３）中間株主資本等変動計算書

第63期中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30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	61,956	61,956	△2,067	82,472
当中間期変動額							
剰余金の配当				△5,191	△5,191		△5,191
中間純利益				9,517	9,517		9,517
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	－	－	－	4,326	4,326	－	4,326
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	66,282	66,282	△2,067	86,798

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他	繰延ヘッジ	評価・換算	

	有価証券評価差額金	損益	差額等合計	
当期首残高	1,461	115	1,577	84,049
当中間期変動額				
剰余金の配当				△5,191
中間純利益				9,517
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	213	△89	124	124
当中間期変動額合計	213	△89	124	4,450
当中間期末残高	1,674	26	1,701	88,500

注記事項
（重要な会計方針）

項目	第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(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。
３　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。

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

(会計方針の変更)

第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)
(収益認識に関する会計基準の適用) 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年３月31日。以下、「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。 収益認識会計基準等の適用については、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。収益認識会計基準等の適用による、当中間財務諸表に与える影響はありません。 (時価の算定に関する会計基準の適用) 「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日）第44－２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、当中間財務諸表に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第63期中間会計期間 (2021年９月30日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 2,165百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※３　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※４　保証債務 日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッドが発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大５百万豪ドルを提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

（中間損益計算書関係）

第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)	
※１　減価償却実施額	
有形固定資産	52百万円
無形固定資産	30百万円
※２　営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	24百万円
受取配当金	5,072百万円
※３　営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	73百万円
デリバティブ費用	117百万円
※４　特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	167百万円
※５　特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	30百万円
※６　中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第63期中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2011年度ストックオプション（1）	普通株式	432,300	－	392,700	39,600	－
2016年度ストックオプション（1）	普通株式	1,016,000	－	928,000	88,000	－
2016年度ストックオプション（2）	普通株式	1,772,000	－	912,000	860,000	－
2017年度ストックオプション（1）	普通株式	2,607,000	－	983,000	1,624,000	－
合計		5,827,300	－	3,215,700	2,611,600	－

(注) 1　当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
2　2011年度ストックオプション(1)39,600株、2016年度ストックオプション(1)88,000株、2016年度ストックオプション(2)860,000株及び2017年度ストックオプション(1)935,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2017年度ストックオプション(1)689,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

４　配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

(リース取引関係)

第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	911百万円
１年超	4,780百万円
合計	5,692百万円

（金融商品関係）

第63期中間会計期間(2021年９月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2019年７月４日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託及び市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価

の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額(※３)			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
デリバティブ取引(※１、２)				
株式関連	33	－	－	33
通貨関連	－	△265	－	△265
デリバティブ取引計	33	△265	－	△232

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

（※２）株式関連のデリバティブ取引のうち33百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち0百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、266百万円は、流動負債のその他に含まれております。

（※３）時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に244百万円、投資有価証券に24,313百万円となります。

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	23,094
関連会社株式	5,183

（有価証券関係）

第63期中間会計期間(2021年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	17,930	15,256	2,674
	小計	17,930	15,256	2,674
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	6,627	6,888	△260
	小計	6,627	6,888	△260
合計		24,557	22,144	2,413

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

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

（デリバティブ取引関係）

第63期中間会計期間(2021年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,652	-	33	33
合計		2,652	-	33	33

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

（2）通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,811	－	△34	△34
合計		1,811	－	△34	△34

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

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券	4,973	－	△93
	ユーロ		1	－	0
	香港ドル		979	－	△17
	人民元		4,970	－	△120
合計			10,924	－	△230

（持分法損益等）

第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （1）関連会社に対する投資の金額　5,300百万円 （2）持分法を適用した場合の投資の金額　14,304百万円 （3）持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,421百万円

（収益認識関係）

第63期中間会計期間(2021年９月30日)

１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２　顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針　４．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第63期中間会計期間(自　2021年４月１日　至　2021年９月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

第63期中間会計期間(自　2021年４月１日　至　2021年９月30日)

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

［関連情報］

第63期中間会計期間(自　2021年４月１日　至　2021年９月30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63期中間会計期間(自　2021年４月１日　至　2021年９月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第63期中間会計期間(自　2021年４月１日　至　2021年９月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第63期中間会計期間(自　2021年４月１日　至　2021年９月30日)
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)
１株当たり純資産額	455円82銭
１株当たり中間純利益金額	49円02銭

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

２　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期中間会計期間 (自　2021年４月１日 至　2021年９月30日)
中間純利益（百万円）	9,517
普通株主に帰属しない金額（百万円）	－
普通株式に係る中間純利益（百万円）	9,517
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)39,600株、 2016年度ストックオプション(1)88,000株、 2016年度ストックオプション(2)860,000株、 2017年度ストックオプション(1)1,624,000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63期中間会計期間 (2021年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	88,500
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	88,500
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	194,152

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

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

（２）運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で

定めるものを除きます。）。

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

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

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （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
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社きらやか銀行	24,200百万円	
株式会社山陰合同銀行	20,705百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	

第一生命保険株式会社	60,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
信金中央金庫	690,998百万円 （出資の総額）	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（2）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

（1）受託会社
該当事項はありません。
（2）販売会社
該当事項はありません。

第3【その他】

（1）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
（2）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
① 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
② ファンドの基本的性格など
③ 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④ 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
⑤ 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。
① 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。
② 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。
③ 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。
④ 「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。
⑤ 「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。
⑥ 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。
⑦ 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。
⑧ 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨ 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。
⑩ 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。
⑪ 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。
⑫ 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。

① 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。
② 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。
③ ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。
④ 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 業務執行社員	公認会計士　貞 廣 篤 典
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　竹 内 知 明

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

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

ること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年12月１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 業務執行社員	公認会計士　佐々木　貴司
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

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」に掲げられている年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2020年10月27日から2021年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2021年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2021年12月３日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　貞 廣 篤 典

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2021年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。