

## 【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2月8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】	DCインデックスバランス（株式20）
【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。



**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

**（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分











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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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







外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券

- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

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

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX(東証株価指数) <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

T O P I Xの指数値およびT O P I X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T O P I X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。

T O P I X（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 >

<b>運用の基本方針</b>	
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） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。



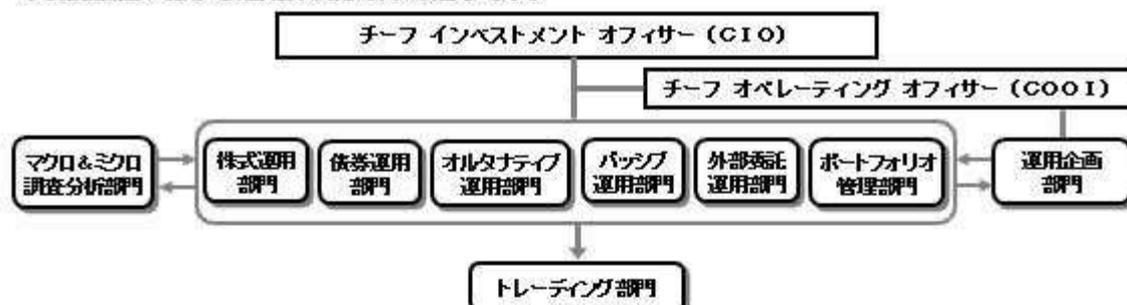


投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。</li> <li>運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。</li> <li>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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行いません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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、</li> <li>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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(1998年10月30日設定)
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)

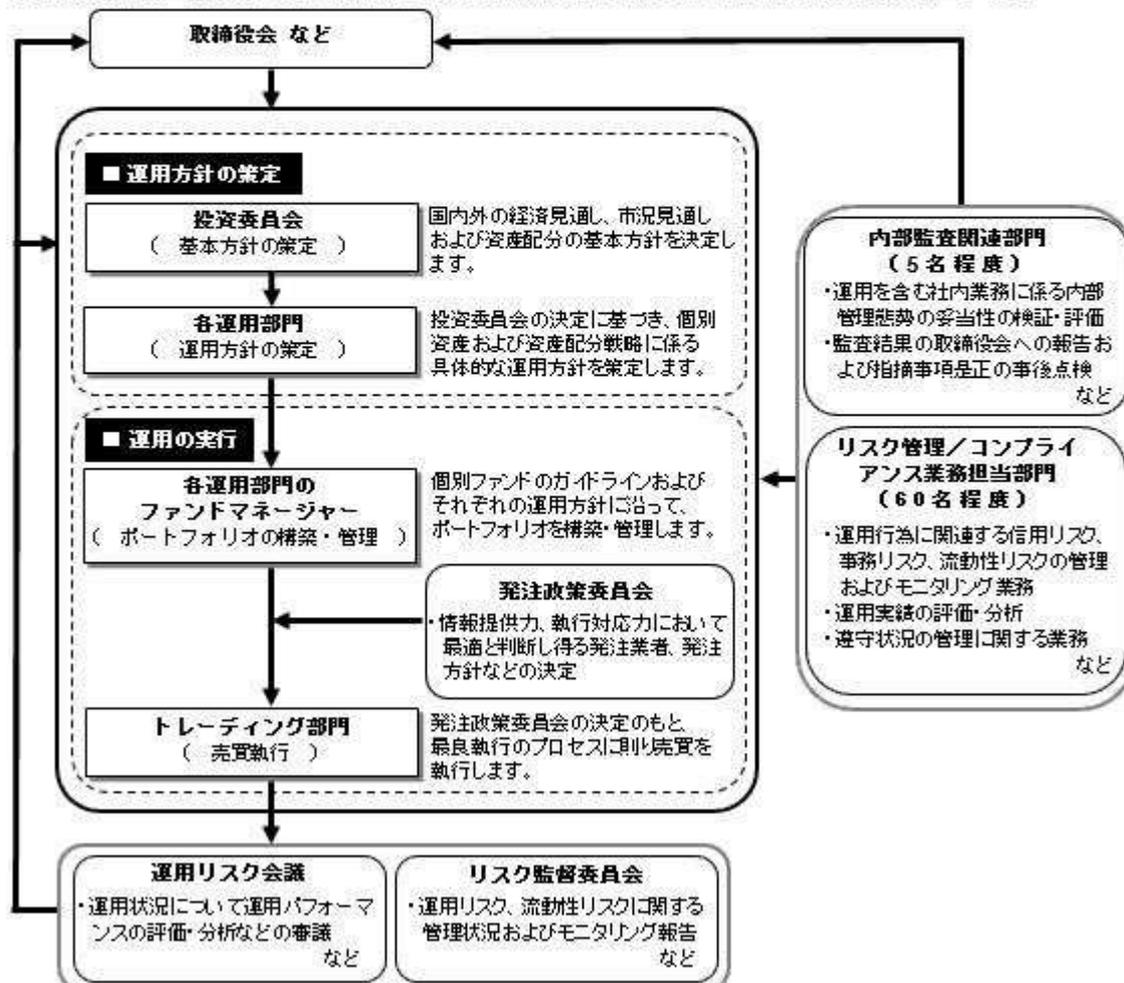
\* FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### (3)【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



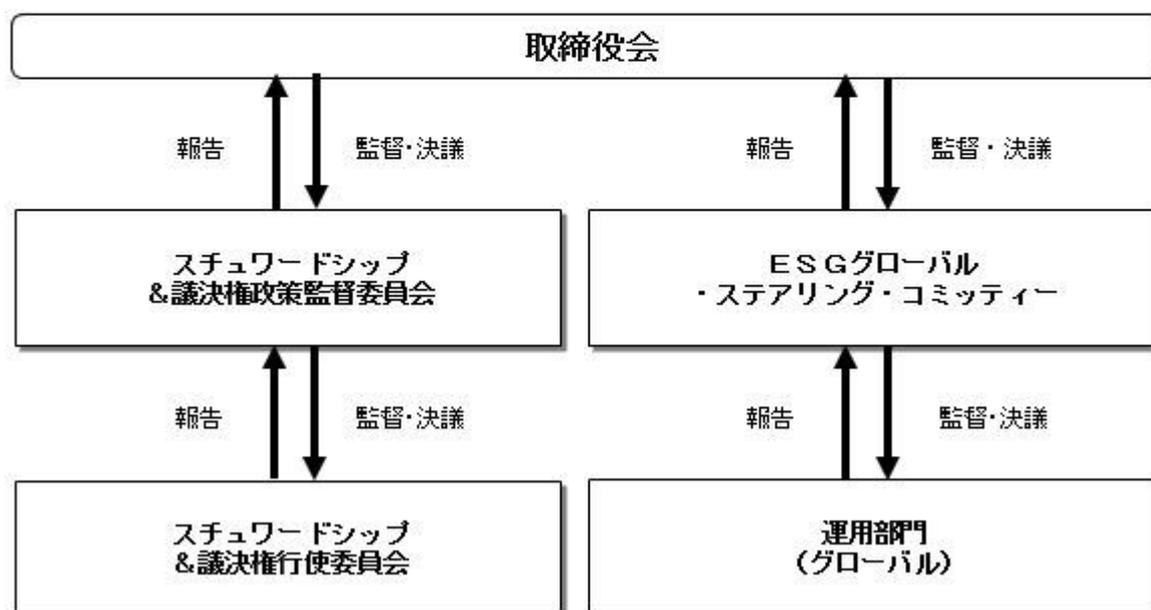
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2021年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針  
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針  
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

## 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

- < DCインデックスバランス（株式20） >
- 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30%以下とします。
  - 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、当該取引の契約期間が、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、公社債の借入の指図をすることができます。公社債の借入の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
  - 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
    - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
    - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。



















益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

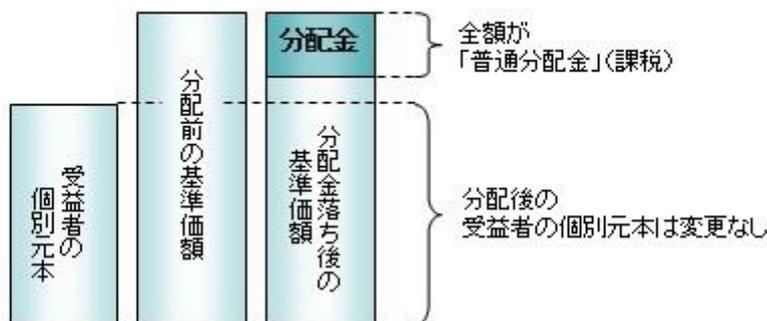
- 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

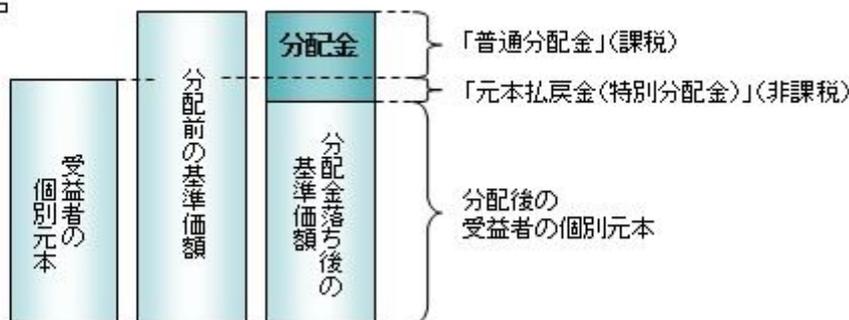
- 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 受益者が収益分配金を受け取る際
  - 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- 収益分配金発生時に、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2月8日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【DCインデックスバランス(株式20)】

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

- 投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】









## 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	0.22
		建設業	2.15
		食料品	3.20
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.68
		医薬品	4.74
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.64
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.70
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.63
		機械	5.28
		電気機器	19.48
		輸送用機器	7.94
		精密機器	2.97
		その他製品	2.15
		電気・ガス業	1.06
		陸運業	2.94
		海運業	0.42
		空運業	0.37
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	8.48
		卸売業	5.01
		小売業	4.12
		銀行業	4.58
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	1.88
		その他金融業	1.11
不動産業	1.84		
サービス業	6.31		
合 計			98.35

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	37	日本円	734,950,400	701,520,000	1.74

(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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	173,823,370,082	67.70
	カナダ	8,789,221,953	3.42
	ドイツ	6,420,481,277	2.50
	イタリア	1,307,058,777	0.51
	フランス	7,665,967,953	2.99
	オランダ	4,732,771,237	1.84
	スペイン	1,677,809,821	0.65
	ベルギー	582,963,260	0.23
	オーストリア	156,012,679	0.06
	ルクセンブルク	212,506,853	0.08
	フィンランド	912,558,656	0.36
	アイルランド	4,764,087,020	1.86
	ポルトガル	116,654,993	0.05
	イギリス	9,750,426,147	3.80
	スイス	8,259,707,076	3.22
	スウェーデン	2,546,056,876	0.99
	ノルウェー	459,801,987	0.18
	デンマーク	1,963,247,300	0.76
	ケイマン	402,110,565	0.16
	オーストラリア	4,485,018,738	1.75
	バミューダ	377,893,167	0.15
ニュージーランド	236,887,941	0.09	
パプアニューギニア	24,665,322	0.01	
香港	1,731,949,137	0.67	
シンガポール	665,903,814	0.26	
イスラエル	548,309,953	0.21	















## 投資不動産物件

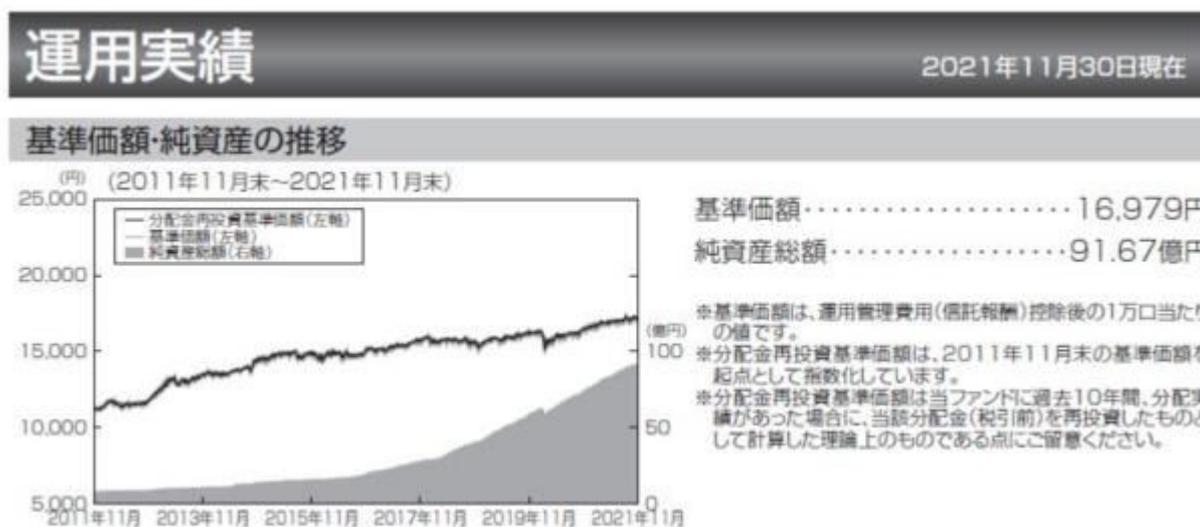
該当事項はありません。

## 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	940,000.00	106,941,600	106,940,638	0.07
	ユーロ	買建	126,000.00	16,179,660	16,179,949	0.01
	英ポンド	買建	67,000.00	10,161,220	10,154,520	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報







取り消すことができます。

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

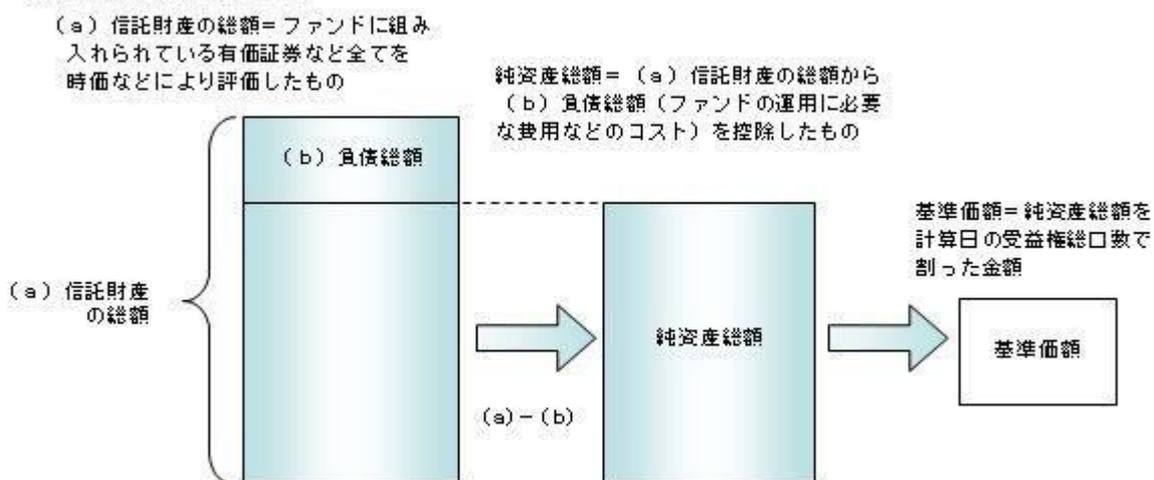
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

##### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### 国内上場株式

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

##### 外国株式

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

##### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

##### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。





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19期計算期間(2020年11月7日から2021年11月8日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DCインデックスバランス（株式20）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2020年11月 6日現在	第19期 2021年11月 8日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	389,242,667	470,276,113
親投資信託受益証券	6,900,060,700	8,726,344,633
未収入金	13,443,800	17,243,579
流動資産合計	7,302,747,167	9,213,864,325
<b>資産合計</b>	7,302,747,167	9,213,864,325
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	4,488,027	5,350,070
未払解約金	37,608,238	23,972,468
未払受託者報酬	748,656	980,236
未払委託者報酬	4,492,274	5,881,832
未払利息	269	252
その他未払費用	149,683	195,993
流動負債合計	47,487,147	36,380,851
<b>負債合計</b>	47,487,147	36,380,851
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	4,488,027,175	5,350,070,697
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,767,232,845	3,827,412,777
（分配準備積立金）	355,876,517	716,454,208
元本等合計	7,255,260,020	9,177,483,474
<b>純資産合計</b>	7,255,260,020	9,177,483,474
<b>負債純資産合計</b>	7,302,747,167	9,213,864,325





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

## 金融商品の時価等に関する事項

	第18期 2020年11月 6日現在	第19期 2021年11月 8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18期(2020年11月 6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	75,515,812
合計	75,515,812

第19期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	448,089,162
合計	448,089,162

(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18期 2020年11月 6日現在		第19期 2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	1.6166円	1口当たり純資産額	1.7154円
(1万口当たり純資産額)	(16,166円)	(1万口当たり純資産額)	(17,154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
----	----	------	-----	----





アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	49,485,768円	44,030,108円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	40,124,492円	38,883,261円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	59,041,463円	46,611,073円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	53,396,078円	40,515,547円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,753,508,024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）	294,227,367円	244,544,060円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	804,213,731円	691,834,956円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,181,735,058円	1,051,047,841円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,117,792,381円	1,018,109,068円
計	22,074,085,898円	21,399,374,592円
2. 受益権の総数	22,074,085,898口	21,399,374,592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	370,645,000円	650,280,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8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11月 6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	820,501,596
合計	820,501,596

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	374,075,000	-	381,915,000	7,840,000
合計		374,075,000	-	381,915,000	7,840,000

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

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

(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11月 6日現在		2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	1.5762円	1口当たり純資産額	1.9762円
(1万口当たり純資産額)	(15,762円)	(1万口当たり純資産額)	(19,762円)









不二製油グループ本社	3,300	2,716.00	8,962,800
J - オイルミルズ	1,400	1,760.00	2,464,000
キッコーマン	10,800	9,440.00	101,952,000
味の素	33,200	3,406.00	113,079,200
ブルドックソース	600	2,165.00	1,299,000
キューピー	7,900	2,517.00	19,884,300
ハウス食品グループ本社	5,600	3,110.00	17,416,000
カゴメ	5,700	2,970.00	16,929,000
焼津水産化学工業	800	987.00	789,600
アリアケジャパン	1,400	7,150.00	10,010,000
ピエトロ	200	1,779.00	355,800
エバラ食品工業	300	2,479.00	743,700
やまみ	200	2,111.00	422,200
ニチレイ	7,100	2,722.00	19,326,200
東洋水産	7,200	4,895.00	35,244,000
イートアンドホールディングス	600	2,184.00	1,310,400
大冷	200	1,925.00	385,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	793.00	634,400
日清食品ホールディングス	5,900	8,960.00	52,864,000
永谷園ホールディングス	700	2,050.00	1,435,000
一正蒲鉾	600	910.00	546,000
フジッコ	1,600	1,905.00	3,048,000
ロック・フィールド	1,600	1,766.00	2,825,600
日本たばこ産業	80,500	2,344.00	188,692,000
ケンコーマヨネーズ	800	1,499.00	1,199,200
わらべや日洋ホールディングス	1,000	2,156.00	2,156,000
なとり	800	1,958.00	1,566,400
イフジ産業	300	962.00	288,600
ピクルスコーポレーション	700	1,818.00	1,272,600
ファーマフーズ	1,400	2,636.00	3,690,400
ユーグレナ	7,600	858.00	6,520,800
紀文食品	900	1,186.00	1,067,400
ミヨシ油脂	600	1,311.00	786,600
理研ビタミン	1,600	1,801.00	2,881,600
片倉工業	1,600	1,822.00	2,915,200
ゲンゼ	1,000	4,335.00	4,335,000
東洋紡	5,800	1,371.00	7,951,800
ユニチカ	4,000	357.00	1,428,000
富士紡ホールディングス	700	4,120.00	2,884,000
倉敷紡績	1,200	1,905.00	2,286,000
シキボウ	800	921.00	736,800
日本毛織	4,400	916.00	4,030,400

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	436.00	218,000	
ダイドーリミテッド	1,900	170.00	323,000	
帝国繊維	1,700	2,083.00	3,541,100	
帝人	13,800	1,495.00	20,631,000	
東レ	106,000	757.40	80,284,400	
サカイオーベックス	100	3,800.00	380,000	
住江織物	300	1,770.00	531,000	
日本フェルト	800	442.00	353,600	
イチカワ	200	1,390.00	278,000	
日東製網	200	1,473.00	294,600	
アツギ	1,200	646.00	775,200	
ダイニック	600	762.00	457,200	
セーレン	3,000	2,383.00	7,149,000	
ソトー	500	827.00	413,500	
東海染工	200	1,124.00	224,800	
小松マテーレ	2,400	1,082.00	2,596,800	
ワコールホールディングス	3,600	2,218.00	7,984,800	
ホギメディカル	2,000	3,095.00	6,190,000	
クラウディアホールディングス	400	285.00	114,000	
T S Iホールディングス	4,800	379.00	1,819,200	
マツオカコーポレーション	500	1,403.00	701,500	
ワールド	1,900	1,512.00	2,872,800	
三陽商会	700	903.00	632,100	
ナイガイ	500	326.00	163,000	
オンワードホールディングス	8,800	370.00	3,256,000	
ルックホールディングス	500	1,432.00	716,000	
ゴールドウイン	2,600	7,270.00	18,902,000	
デサント	2,900	4,435.00	12,861,500	
キング	700	540.00	378,000	
ヤマトインターナショナル	1,300	311.00	404,300	
特種東海製紙	900	4,380.00	3,942,000	
王子ホールディングス	61,200	572.00	35,006,400	
日本製紙	7,000	1,172.00	8,204,000	
三菱製紙	2,200	350.00	770,000	
北越コーポレーション	9,600	748.00	7,180,800	
中越パルプ工業	600	1,150.00	690,000	
巴川製紙所	400	834.00	333,600	
大王製紙	7,100	2,079.00	14,760,900	
阿波製紙	400	380.00	152,000	
レンゴー	13,800	828.00	11,426,400	
トーモク	900	1,870.00	1,683,000	

ザ・バック	1,100	2,893.00	3,182,300
北の達人コーポレーション	5,200	417.00	2,168,400
クラレ	21,400	1,044.00	22,341,600
旭化成	97,100	1,171.00	113,704,100
共和レザー	1,000	662.00	662,000
昭和電工	12,700	2,819.00	35,801,300
住友化学	107,600	583.00	62,730,800
住友精化	600	3,300.00	1,980,000
日産化学	8,000	6,540.00	52,320,000
ラサ工業	500	1,914.00	957,000
クレハ	1,200	8,020.00	9,624,000
多木化学	600	6,080.00	3,648,000
テイカ	1,100	1,316.00	1,447,600
石原産業	2,500	1,286.00	3,215,000
片倉コープアグリ	300	1,175.00	352,500
日本曹達	1,900	3,320.00	6,308,000
東ソー	21,100	1,815.00	38,296,500
トクヤマ	4,700	2,022.00	9,503,400
セントラル硝子	2,400	2,119.00	5,085,600
東亜合成	8,300	1,255.00	10,416,500
大阪ソーダ	1,400	2,773.00	3,882,200
関東電化工業	3,200	1,040.00	3,328,000
デンカ	5,300	3,685.00	19,530,500
信越化学工業	25,100	20,230.00	507,773,000
日本カーバイド工業	500	1,384.00	692,000
堺化学工業	1,000	2,168.00	2,168,000
第一稀元素化学工業	1,400	1,475.00	2,065,000
エア・ウォーター	13,900	1,761.00	24,477,900
日本酸素ホールディングス	14,100	2,711.00	38,225,100
日本化学工業	500	2,915.00	1,457,500
東邦アセチレン	300	1,219.00	365,700
日本パーカライズিং	7,400	1,141.00	8,443,400
高压ガス工業	2,400	765.00	1,836,000
四国化成工業	1,900	1,417.00	2,692,300
戸田工業	300	3,370.00	1,011,000
ステラ ケミファ	700	2,826.00	1,978,200
保土谷化学工業	500	5,270.00	2,635,000
日本触媒	2,500	5,650.00	14,125,000
大日精化工業	1,200	2,622.00	3,146,400
カネカ	3,800	4,365.00	16,587,000
三菱瓦斯化学	13,600	2,195.00	29,852,000
三井化学	13,300	3,420.00	45,486,000

J S R	13,600	4,200.00	57,120,000
東京応化工業	2,500	7,490.00	18,725,000
大阪有機化学工業	1,200	3,460.00	4,152,000
三菱ケミカルホールディングス	98,000	945.30	92,639,400
K Hネオケム	2,400	3,330.00	7,992,000
ダイセル	21,100	841.00	17,745,100
住友ペークライト	2,300	5,360.00	12,328,000
積水化学工業	30,700	1,911.00	58,667,700
日本ゼオン	13,200	1,338.00	17,661,600
アイカ工業	4,100	3,415.00	14,001,500
宇部興産	6,900	2,119.00	14,621,100
積水樹脂	2,200	2,143.00	4,714,600
タキロンシーアイ	3,300	570.00	1,881,000
旭有機材	800	1,469.00	1,175,200
ニチバン	900	1,908.00	1,717,200
リケンテクノス	3,700	540.00	1,998,000
大倉工業	800	2,134.00	1,707,200
積水化成成品工業	2,000	534.00	1,068,000
群栄化学工業	300	3,245.00	973,500
タイガースポリマー	800	432.00	345,600
ミライアル	500	1,572.00	786,000
ダイキアクシス	600	920.00	552,000
ダイキョーニシカワ	3,100	700.00	2,170,000
竹本容器	500	864.00	432,000
森六ホールディングス	800	1,871.00	1,496,800
恵和	400	5,200.00	2,080,000
日本化薬	11,500	1,234.00	14,191,000
カーリットホールディングス	1,500	772.00	1,158,000
日本精化	1,200	2,036.00	2,443,200
扶桑化学工業	1,300	4,840.00	6,292,000
トリケミカル研究所	1,500	3,430.00	5,145,000
A D E K A	6,700	2,584.00	17,312,800
日油	5,000	5,890.00	29,450,000
新日本理化	2,500	302.00	755,000
ハリマ化成グループ	1,100	864.00	950,400
花王	33,100	6,310.00	208,861,000
第一工業製薬	600	3,435.00	2,061,000
石原ケミカル	800	1,449.00	1,159,200
日華化学	500	905.00	452,500
ニイタカ	300	2,340.00	702,000
三洋化成工業	900	5,480.00	4,932,000
有機合成薬品工業	1,100	304.00	334,400

大日本塗料	1,800	850.00	1,530,000
日本ペイントホールディングス	55,000	1,191.00	65,505,000
関西ペイント	15,200	2,620.00	39,824,000
神東塗料	1,200	189.00	226,800
中国塗料	3,500	844.00	2,954,000
日本特殊塗料	1,100	1,019.00	1,120,900
藤倉化成	1,900	529.00	1,005,100
太陽ホールディングス	2,200	3,075.00	6,765,000
D I C	6,200	3,050.00	18,910,000
サカティクス	2,900	1,091.00	3,163,900
東洋インキＳＣホールディングス	3,100	2,015.00	6,246,500
T & K T O K A	1,200	825.00	990,000
富士フィルムホールディングス	26,300	9,104.00	239,435,200
資生堂	27,900	7,825.00	218,317,500
ライオン	18,000	1,798.00	32,364,000
高砂香料工業	1,000	2,930.00	2,930,000
マンガム	3,100	1,712.00	5,307,200
ミルボン	1,800	6,840.00	12,312,000
ファンケル	6,100	3,665.00	22,356,500
コーセー	2,800	14,030.00	39,284,000
コタ	900	1,577.00	1,419,300
ポーラ・オルビスホールディングス	6,400	2,364.00	15,129,600
ノエビアホールディングス	1,300	5,690.00	7,397,000
アジュバンホールディングス	300	1,251.00	375,300
新日本製薬	400	1,671.00	668,400
エステー	1,000	1,604.00	1,604,000
アグロ カネショウ	500	1,335.00	667,500
コニシ	2,400	1,757.00	4,216,800
長谷川香料	2,600	2,786.00	7,243,600
星光ＰＭＣ	900	777.00	699,300
小林製薬	4,200	9,470.00	39,774,000
荒川化学工業	1,200	1,196.00	1,435,200
メック	1,100	3,310.00	3,641,000
日本高純度化学	400	2,823.00	1,129,200
タカラバイオ	3,900	3,005.00	11,719,500
J C U	1,700	4,655.00	7,913,500
新田ゼラチン	1,000	618.00	618,000
ＯＡＴアグリオ	300	2,050.00	615,000
デクセリアルズ	3,900	3,285.00	12,811,500
アース製薬	1,200	6,900.00	8,280,000
北興化学工業	1,400	988.00	1,383,200
大成ラミック	500	2,790.00	1,395,000

クミアイ化学工業	5,500	866.00	4,763,000	
日本農薬	2,700	545.00	1,471,500	
アキレス	1,000	1,330.00	1,330,000	
有沢製作所	2,200	954.00	2,098,800	
日東電工	9,000	8,800.00	79,200,000	
レック	1,900	993.00	1,886,700	
三光合成	1,700	417.00	708,900	
きもと	2,300	231.00	531,300	
藤森工業	1,300	4,730.00	6,149,000	
前澤化成工業	1,000	1,299.00	1,299,000	
未来工業	500	1,668.00	834,000	
ウェーブロックホールディングス	600	718.00	430,800	
J S P	900	1,596.00	1,436,400	
エフピコ	2,700	3,780.00	10,206,000	
天馬	1,200	2,714.00	3,256,800	
信越ポリマー	2,700	1,021.00	2,756,700	
東リ	3,800	232.00	881,600	
ニフコ	5,000	3,665.00	18,325,000	
バルカー	1,200	2,485.00	2,982,000	
ユニ・チャーム	28,800	4,649.00	133,891,200	
ショーエイコーポレーション	400	787.00	314,800	
協和キリン	17,500	3,790.00	66,325,000	
武田薬品工業	117,500	3,246.00	381,405,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	129,700	1,984.50	257,389,650	
大日本住友製薬	9,200	1,555.00	14,306,000	
塩野義製薬	18,800	7,087.00	133,235,600	
わかもと製薬	1,800	317.00	570,600	
日本新薬	3,900	9,060.00	35,334,000	
中外製薬	46,800	4,100.00	191,880,000	
科研製薬	2,300	4,200.00	9,660,000	
エーザイ	17,900	8,315.00	148,838,500	
ロート製薬	7,700	3,440.00	26,488,000	
小野薬品工業	34,400	2,441.50	83,987,600	
久光製薬	4,000	3,860.00	15,440,000	
持田製薬	1,900	3,310.00	6,289,000	
参天製薬	27,900	1,632.00	45,532,800	
扶桑薬品工業	500	2,557.00	1,278,500	
日本ケミファ	200	2,132.00	426,400	
ツムラ	4,600	3,605.00	16,583,000	
日医工	4,600	889.00	4,089,400	
キッセイ薬品工業	2,600	2,340.00	6,084,000	
生化学工業	2,600	1,005.00	2,613,000	

栄研化学	2,600	1,872.00	4,867,200	
日水製薬	500	967.00	483,500	
鳥居薬品	800	2,941.00	2,352,800	
JCRファーマ	4,200	2,839.00	11,923,800	
東和薬品	2,100	2,983.00	6,264,300	
富士製薬工業	900	1,159.00	1,043,100	
ゼリア新薬工業	2,700	2,083.00	5,624,100	
第一三共	117,500	2,791.00	327,942,500	
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	1,761.00	5,283,000	
大幸薬品	2,300	768.00	1,766,400	
ダイト	1,000	3,120.00	3,120,000	
大塚ホールディングス	31,100	4,499.00	139,918,900	
大正製薬ホールディングス	3,600	6,060.00	21,816,000	
ペプチドリーム	7,800	2,660.00	20,748,000	
あすか製薬ホールディングス	1,800	1,012.00	1,821,600	
サワイグループホールディングス	3,300	5,060.00	16,698,000	
日本コークス工業	12,900	138.00	1,780,200	
ニチレキ	1,900	1,321.00	2,509,900	
ユシロ化学工業	800	1,179.00	943,200	
ビービー・カストロール	500	1,406.00	703,000	
富士石油	4,000	268.00	1,072,000	
MORESCO	500	1,182.00	591,000	
出光興産	16,600	3,155.00	52,373,000	
ENEOSホールディングス	225,000	465.70	104,782,500	
コスモエネルギーホールディングス	4,300	2,305.00	9,911,500	
横浜ゴム	8,600	2,037.00	17,518,200	
TOYO TIRE	7,900	1,980.00	15,642,000	
ブリヂストン	43,100	5,158.00	222,309,800	
住友ゴム工業	13,400	1,493.00	20,006,200	
藤倉コンポジット	1,200	752.00	902,400	
オカモト	900	3,995.00	3,595,500	
フコク	700	1,015.00	710,500	
ニッタ	1,500	2,717.00	4,075,500	
住友理工	2,900	634.00	1,838,600	
三ツ星ベルト	1,800	2,006.00	3,610,800	
バンドー化学	2,400	890.00	2,136,000	
日東紡績	2,200	3,420.00	7,524,000	
AGC	13,700	5,800.00	79,460,000	
日本板硝子	7,100	607.00	4,309,700	
石塚硝子	300	2,115.00	634,500	
日本山村硝子	600	843.00	505,800	
日本電気硝子	6,000	2,737.00	16,422,000	

オハラ	600	1,402.00	841,200	
住友大阪セメント	2,800	3,365.00	9,422,000	
太平洋セメント	8,500	2,466.00	20,961,000	
日本ヒューム	1,500	744.00	1,116,000	
日本コンクリート工業	2,900	295.00	855,500	
三谷セキサン	700	8,120.00	5,684,000	
アジアパイルホールディングス	2,300	455.00	1,046,500	
東海カーボン	12,500	1,361.00	17,012,500	
日本カーボン	800	4,355.00	3,484,000	
東洋炭素	1,000	3,230.00	3,230,000	
ノリタケカンパニーリミテド	800	5,020.00	4,016,000	
TOTO	10,700	5,420.00	57,994,000	
日本碍子	16,200	1,961.00	31,768,200	
日本特殊陶業	11,400	1,936.00	22,070,400	
ダントーホールディングス	1,000	233.00	233,000	
MARUWA	500	13,330.00	6,665,000	
品川リフラクトリーズ	300	3,705.00	1,111,500	
黒崎播磨	300	4,245.00	1,273,500	
ヨータイ	900	1,270.00	1,143,000	
イソライト工業	600	853.00	511,800	
東京窯業	1,900	323.00	613,700	
ニッカトー	700	760.00	532,000	
フジミインコーポレーテッド	1,200	7,500.00	9,000,000	
クニミネ工業	500	1,112.00	556,000	
エーアンドエーマテリアル	200	953.00	190,600	
ニチアス	3,500	2,811.00	9,838,500	
ニチハ	2,100	3,200.00	6,720,000	
日本製鉄	66,200	1,918.00	126,971,600	
神戸製鋼所	25,300	609.00	15,407,700	
合同製鐵	800	1,435.00	1,148,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	40,000	1,500.00	60,000,000	
東京製鐵	5,000	1,195.00	5,975,000	
共英製鋼	1,700	1,351.00	2,296,700	
大和工業	2,800	3,560.00	9,968,000	
東京鐵鋼	700	1,463.00	1,024,100	
大阪製鐵	800	1,101.00	880,800	
淀川製鋼所	1,900	2,431.00	4,618,900	
丸一鋼管	5,200	2,602.00	13,530,400	
モリ工業	500	2,730.00	1,365,000	
大同特殊鋼	2,400	4,165.00	9,996,000	
日本高周波鋼業	700	385.00	269,500	
日本冶金工業	1,100	2,336.00	2,569,600	

山陽特殊製鋼	1,500	2,049.00	3,073,500
愛知製鋼	800	2,663.00	2,130,400
日立金属	15,900	2,152.00	34,216,800
日本金属	400	1,019.00	407,600
大太平洋金属	1,000	2,130.00	2,130,000
新日本電工	9,700	357.00	3,462,900
栗本鐵工所	700	1,587.00	1,110,900
虹技	200	1,070.00	214,000
日本鑄鉄管	200	1,210.00	242,000
三菱製鋼	1,000	1,056.00	1,056,000
日亜鋼業	2,100	287.00	602,700
日本精線	300	4,650.00	1,395,000
エンビプロ・ホールディングス	600	2,471.00	1,482,600
シンニッタン	2,000	230.00	460,000
新家工業	400	1,721.00	688,400
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,610.00	3,703,000
日本軽金属ホールディングス	3,700	1,825.00	6,752,500
三井金属鉱業	4,000	3,205.00	12,820,000
東邦亜鉛	800	2,937.00	2,349,600
三菱マテリアル	9,800	2,212.00	21,677,600
住友金属鉱山	18,900	4,434.00	83,802,600
D O W A ホールディングス	4,000	4,795.00	19,180,000
古河機械金属	2,500	1,264.00	3,160,000
エス・サイエンス	8,500	30.00	255,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	865.00	1,557,000
東邦チタニウム	2,700	1,142.00	3,083,400
U A C J	2,200	2,807.00	6,175,400
C K サンエツ	300	3,380.00	1,014,000
古河電気工業	4,600	2,467.00	11,348,200
住友電気工業	55,400	1,524.00	84,429,600
フジクラ	16,500	620.00	10,230,000
昭和電線ホールディングス	1,300	1,969.00	2,559,700
タツタ電線	2,700	504.00	1,360,800
カナレ電気	300	1,720.00	516,000
平河ヒューテック	900	1,215.00	1,093,500
リヨービ	1,800	1,183.00	2,129,400
アーレスティ	1,800	395.00	711,000
アサヒホールディングス	5,900	2,061.00	12,159,900
稲葉製作所	800	1,357.00	1,085,600
宮地エンジニアリンググループ	400	2,631.00	1,052,400
トーカロ	3,800	1,355.00	5,149,000
アルファC o	600	1,238.00	742,800

SUMCO	22,800	2,427.00	55,335,600
川田テクノロジーズ	300	3,810.00	1,143,000
RS Technologies	500	6,590.00	3,295,000
ジェイテックコーポレーション	200	2,122.00	424,400
信和	900	790.00	711,000
東洋製罐グループホールディングス	9,400	1,465.00	13,771,000
ホッカンホールディングス	800	1,513.00	1,210,400
コロナ	800	903.00	722,400
横河ブリッジホールディングス	2,500	2,194.00	5,485,000
駒井ハルテック	300	1,614.00	484,200
高田機工	100	2,726.00	272,600
三和ホールディングス	13,900	1,299.00	18,056,100
文化シャッター	4,700	1,083.00	5,090,100
三協立山	1,900	746.00	1,417,400
アルインコ	1,100	959.00	1,054,900
東洋シャッター	300	647.00	194,100
LIXIL	23,300	2,959.00	68,944,700
日本フィルコン	1,000	546.00	546,000
ノーリツ	2,800	1,831.00	5,126,800
長府製作所	1,500	2,051.00	3,076,500
リンナイ	2,800	12,060.00	33,768,000
ダイニチ工業	700	784.00	548,800
日東精工	1,800	658.00	1,184,400
三洋工業	200	1,875.00	375,000
岡部	3,000	675.00	2,025,000
ジーテクト	1,800	1,437.00	2,586,600
東プレ	2,800	1,347.00	3,771,600
高周波熱錬	2,600	600.00	1,560,000
東京製網	900	872.00	784,800
サンコール	1,200	478.00	573,600
モリテック スチール	1,100	414.00	455,400
パイオラックス	2,200	1,667.00	3,667,400
エイチワン	1,400	703.00	984,200
日本発條	13,600	876.00	11,913,600
中央発條	700	919.00	643,300
アドバネクス	200	1,084.00	216,800
立川ブラインド工業	600	1,240.00	744,000
三益半導体工業	1,200	2,514.00	3,016,800
日本ドライケミカル	400	1,969.00	787,600
日本製鋼所	4,500	3,455.00	15,547,500
三浦工業	6,400	4,445.00	28,448,000
タクマ	5,000	1,505.00	7,525,000

ツガミ	3,600	1,547.00	5,569,200
オークマ	1,700	5,470.00	9,299,000
芝浦機械	1,700	2,707.00	4,601,900
アマダ	23,300	1,157.00	26,958,100
アイダエンジニアリング	3,900	1,045.00	4,075,500
滝澤鉄工所	400	1,133.00	453,200
F U J I	6,800	2,744.00	18,659,200
牧野フライス製作所	1,600	3,915.00	6,264,000
オーエスジー	6,800	1,890.00	12,852,000
ダイジェット工業	200	1,090.00	218,000
旭ダイヤモンド工業	3,900	714.00	2,784,600
D M G 森精機	8,800	2,041.00	17,960,800
ソディック	3,300	875.00	2,887,500
ディスコ	2,200	32,700.00	71,940,000
日東工器	800	1,857.00	1,485,600
日進工具	1,200	1,584.00	1,900,800
パンチ工業	1,300	583.00	757,900
富士ダイス	700	640.00	448,000
豊和工業	700	813.00	569,100
O K K	600	350.00	210,000
東洋機械金属	900	575.00	517,500
津田駒工業	300	810.00	243,000
島精機製作所	2,100	2,257.00	4,739,700
オプトラン	1,800	2,362.00	4,251,600
N C ホールディングス	400	1,602.00	640,800
イワキポンプ	900	1,077.00	969,300
フリーー	1,300	1,633.00	2,122,900
ヤマシンフィルタ	2,900	648.00	1,879,200
日阪製作所	1,800	861.00	1,549,800
やまびこ	2,900	1,284.00	3,723,600
野村マイクロ・サイエンス	400	5,100.00	2,040,000
平田機工	700	7,030.00	4,921,000
ペガサスミシン製造	1,600	517.00	827,200
マルマエ	600	2,422.00	1,453,200
タツモ	700	1,746.00	1,222,200
ナプテスコ	8,400	3,650.00	30,660,000
三井海洋開発	1,600	1,609.00	2,574,400
レオン自動機	1,600	1,395.00	2,232,000
S M C	4,400	71,400.00	314,160,000
ホソカワミクロン	1,000	3,165.00	3,165,000
ユニオンツール	500	3,900.00	1,950,000
オイレス工業	2,100	1,700.00	3,570,000

日精エー・エス・ピー機械	500	3,820.00	1,910,000
サトーホールディングス	1,900	2,611.00	4,960,900
技研製作所	1,300	4,420.00	5,746,000
日本エアージェット	700	1,262.00	883,400
カワタ	500	981.00	490,500
日精樹脂工業	1,000	1,119.00	1,119,000
オカダアイヨン	500	1,272.00	636,000
ワイエイシイホールディングス	600	951.00	570,600
小松製作所	67,800	3,103.00	210,383,400
住友重機械工業	8,500	2,950.00	25,075,000
日立建機	6,000	3,715.00	22,290,000
日工	2,000	661.00	1,322,000
巴工業	600	2,278.00	1,366,800
井関農機	1,400	1,671.00	2,339,400
TOWA	1,300	2,654.00	3,450,200
丸山製作所	300	1,531.00	459,300
北川鉄工所	700	1,582.00	1,107,400
ローツェ	700	12,120.00	8,484,000
タカキタ	500	663.00	331,500
クボタ	73,000	2,285.00	166,805,000
荏原実業	700	2,661.00	1,862,700
三菱化工機	500	2,489.00	1,244,500
月島機械	2,800	1,158.00	3,242,400
帝国電機製作所	1,000	1,440.00	1,440,000
新東工業	3,300	737.00	2,432,100
澁谷工業	1,300	3,005.00	3,906,500
アイチ コーポレーション	2,200	803.00	1,766,600
小森コーポレーション	3,800	729.00	2,770,200
鶴見製作所	1,200	1,851.00	2,221,200
住友精密工業	200	2,367.00	473,400
酒井重工業	300	2,547.00	764,100
荏原製作所	6,200	6,470.00	40,114,000
石井鐵工所	200	2,974.00	594,800
西島製作所	1,300	929.00	1,207,700
北越工業	1,400	1,001.00	1,401,400
ダイキン工業	19,100	25,550.00	488,005,000
オルガノ	400	6,820.00	2,728,000
トーヨーカネツ	600	2,621.00	1,572,600
栗田工業	8,100	5,850.00	47,385,000
椿本チエイン	1,900	3,195.00	6,070,500
大同工業	700	1,019.00	713,300
木村化工機	1,200	777.00	932,400

アネスト岩田	2,300	959.00	2,205,700
ダイフク	8,200	10,050.00	82,410,000
サムコ	400	2,854.00	1,141,600
加藤製作所	700	835.00	584,500
油研工業	200	1,742.00	348,400
タダノ	7,800	1,140.00	8,892,000
フジテック	5,500	2,545.00	13,997,500
C K D	4,400	2,415.00	10,626,000
キトー	1,300	1,742.00	2,264,600
平和	4,200	2,107.00	8,849,400
理想科学工業	1,300	2,039.00	2,650,700
S A N K Y O	3,200	2,858.00	9,145,600
日本金銭機械	1,500	808.00	1,212,000
マースグループホールディングス	900	1,639.00	1,475,100
フクシマガリレイ	1,000	4,575.00	4,575,000
オーイズミ	500	382.00	191,000
ダイコク電機	700	1,254.00	877,800
竹内製作所	2,300	3,010.00	6,923,000
アマノ	3,900	2,768.00	10,795,200
J U K I	2,100	805.00	1,690,500
サンデンホールディングス	2,000	272.00	544,000
ジャノメ	1,300	694.00	902,200
マックス	2,000	1,858.00	3,716,000
グローリー	3,800	2,405.00	9,139,000
新晃工業	1,400	2,099.00	2,938,600
大和冷機工業	2,200	1,294.00	2,846,800
セガサミーホールディングス	14,800	1,838.00	27,202,400
日本ピストンリング	600	1,328.00	796,800
リケン	700	2,776.00	1,943,200
T P R	2,000	1,473.00	2,946,000
ツバキ・ナカシマ	3,300	1,600.00	5,280,000
ホシザキ	4,400	9,680.00	42,592,000
大豊工業	1,200	808.00	969,600
日本精工	28,100	770.00	21,637,000
N T N	32,000	236.00	7,552,000
ジェイテクト	14,300	1,039.00	14,857,700
不二越	1,300	4,340.00	5,642,000
日本トムソン	4,100	603.00	2,472,300
T H K	8,700	2,434.00	21,175,800
ユースン精機	1,100	780.00	858,000
前澤給装工業	1,100	1,055.00	1,160,500
イーグル工業	1,800	1,233.00	2,219,400

前澤工業	900	665.00	598,500
日本ピラー工業	1,500	2,797.00	4,195,500
キッツ	5,000	787.00	3,935,000
マキタ	18,200	5,253.00	95,604,600
三井E & Sホールディングス	5,400	441.00	2,381,400
日立造船	12,600	875.00	11,025,000
三菱重工業	23,500	2,919.50	68,608,250
I H I	9,300	2,851.00	26,514,300
サノヤスホールディングス	1,800	132.00	237,600
スター精密	2,300	1,493.00	3,433,900
日清紡ホールディングス	9,100	901.00	8,199,100
イビデン	7,800	6,750.00	52,650,000
コニカミノルタ	32,700	515.00	16,840,500
ブラザー工業	18,300	2,171.00	39,729,300
ミネベアミツミ	25,800	3,140.00	81,012,000
日立製作所	71,900	7,111.00	511,280,900
東芝	26,100	4,975.00	129,847,500
三菱電機	149,600	1,534.00	229,486,400
富士電機	9,000	5,710.00	51,390,000
東洋電機製造	600	1,055.00	633,000
安川電機	16,100	5,130.00	82,593,000
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,374.00	2,473,200
明電舎	2,500	2,644.00	6,610,000
オリジン	400	1,290.00	516,000
山洋電気	700	6,250.00	4,375,000
デンヨー	1,300	1,978.00	2,571,400
東芝テック	1,600	4,580.00	7,328,000
芝浦メカトロニクス	300	7,780.00	2,334,000
マブチモーター	3,500	3,805.00	13,317,500
日本電産	38,800	13,025.00	505,370,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	650.00	455,000
トレックス・セミコンダクター	800	2,647.00	2,117,600
東光高岳	800	1,414.00	1,131,200
ダブル・スコープ	4,300	929.00	3,994,700
ダイヘン	1,600	4,700.00	7,520,000
ヤーマン	2,500	1,418.00	3,545,000
JVCケンウッド	12,200	182.00	2,220,400
ミマキエンジニアリング	1,400	1,029.00	1,440,600
I - P E X	700	2,113.00	1,479,100
日新電機	3,500	1,455.00	5,092,500
大崎電気工業	2,700	515.00	1,390,500
オムロン	12,500	11,495.00	143,687,500

日東工業	2,000	1,674.00	3,348,000	
I D E C	1,800	2,640.00	4,752,000	
正興電機製作所	500	1,219.00	609,500	
不二電機工業	300	1,281.00	384,300	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,000	2,264.00	11,320,000	
サクサホールディングス	400	1,427.00	570,800	
メルコホールディングス	400	4,260.00	1,704,000	
テクノメディカ	300	1,685.00	505,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	2,087.00	834,800	
日本電気	19,000	5,650.00	107,350,000	
富士通	13,500	20,680.00	279,180,000	
沖電気工業	6,100	990.00	6,039,000	
岩崎通信機	600	880.00	528,000	
電気興業	800	2,550.00	2,040,000	
サンケン電気	1,400	5,730.00	8,022,000	
ナカヨ	300	1,351.00	405,300	
アイホン	900	2,345.00	2,110,500	
ルネサスエレクトロニクス	81,000	1,473.00	119,313,000	
セイコーエプソン	18,600	1,983.00	36,883,800	
ワコム	11,600	826.00	9,581,600	
アルバック	2,700	6,790.00	18,333,000	
アクセル	600	758.00	454,800	
E I Z O	1,200	4,215.00	5,058,000	
日本信号	3,800	990.00	3,762,000	
京三製作所	3,200	481.00	1,539,200	
能美防災	2,000	2,059.00	4,118,000	
ホーチキ	1,100	1,287.00	1,415,700	
星和電機	700	521.00	364,700	
エレコム	3,400	1,710.00	5,814,000	
パナソニック	159,500	1,368.50	218,275,750	
シャープ	17,000	1,330.00	22,610,000	
アンリツ	9,600	1,959.00	18,806,400	
富士通ゼネラル	4,100	2,746.00	11,258,600	
ソニーグループ	93,700	13,985.00	1,310,394,500	代用有価証券 35,000株
T D K	21,700	4,435.00	96,239,500	
帝国通信工業	700	1,394.00	975,800	
タムラ製作所	5,700	703.00	4,007,100	
アルプスアルパイン	13,200	1,130.00	14,916,000	
池上通信機	500	775.00	387,500	
日本電波工業	1,400	930.00	1,302,000	
鈴木	700	908.00	635,600	

メイコー	1,200	3,845.00	4,614,000
日本トリム	300	3,440.00	1,032,000
ローランド ディー・ジー	900	3,100.00	2,790,000
フォスター電機	1,500	809.00	1,213,500
S M K	400	2,403.00	961,200
ヨコオ	1,100	2,582.00	2,840,200
ホシデン	3,600	1,350.00	4,860,000
ヒロセ電機	2,300	18,950.00	43,585,000
日本航空電子工業	3,400	1,864.00	6,337,600
T O A	1,600	816.00	1,305,600
マクセル	3,000	1,361.00	4,083,000
古野電気	1,800	1,268.00	2,282,400
ユニデンホールディングス	300	3,275.00	982,500
スミダコーポレーション	1,400	1,306.00	1,828,400
アイコム	600	2,407.00	1,444,200
リオン	600	2,343.00	1,405,800
本多通信工業	1,200	448.00	537,600
横河電機	15,000	2,329.00	34,935,000
新電元工業	600	4,110.00	2,466,000
アズビル	8,800	5,110.00	44,968,000
東亜ディーケーケー	800	844.00	675,200
日本光電工業	6,200	3,620.00	22,444,000
チノー	500	1,427.00	713,500
共和電業	1,500	402.00	603,000
日本電子材料	700	1,927.00	1,348,900
堀場製作所	2,800	7,680.00	21,504,000
アドバンテスト	11,100	10,070.00	111,777,000
小野測器	700	504.00	352,800
エスベック	1,200	2,340.00	2,808,000
キーエンス	13,500	72,460.00	978,210,000
日置電機	700	8,310.00	5,817,000
シスメックス	12,600	13,950.00	175,770,000
日本マイクロニクス	2,600	1,549.00	4,027,400
メガチップス	1,400	4,090.00	5,726,000
O B A R A G R O U P	700	3,710.00	2,597,000
澤藤電機	200	1,984.00	396,800
原田工業	800	981.00	784,800
コーセル	1,900	932.00	1,770,800
イリソ電子工業	1,300	5,260.00	6,838,000
オブテックスグループ	2,500	1,511.00	3,777,500
千代田インテグレ	600	2,170.00	1,302,000
アイ・オー・データ機器	600	914.00	548,400

レーザーテック	6,600	27,475.00	181,335,000	
スタンレー電気	10,500	3,035.00	31,867,500	
岩崎電気	600	2,121.00	1,272,600	
ウシオ電機	7,700	2,323.00	17,887,100	
岡谷電機産業	1,100	345.00	379,500	
ハリオス テクノ ホールディング	1,300	309.00	401,700	
エノモト	400	1,767.00	706,800	
日本セラミック	1,400	2,927.00	4,097,800	
遠藤照明	700	1,141.00	798,700	
古河電池	1,100	1,526.00	1,678,600	
双信電機	700	654.00	457,800	
山一電機	1,100	2,033.00	2,236,300	
図研	1,000	4,665.00	4,665,000	
日本電子	3,100	9,290.00	28,799,000	
カシオ計算機	10,800	1,600.00	17,280,000	
ファナック	13,100	22,630.00	296,453,000	
日本シイエムケイ	3,000	470.00	1,410,000	
エンプラス	400	2,827.00	1,130,800	
大真空	2,000	1,043.00	2,086,000	
ローム	6,700	11,080.00	74,236,000	
浜松ホトニクス	10,700	6,880.00	73,616,000	
三井ハイテック	1,500	8,790.00	13,185,000	
新光電気工業	4,400	4,925.00	21,670,000	
京セラ	21,000	7,150.00	150,150,000	
太陽誘電	7,300	5,920.00	43,216,000	
村田製作所	43,900	8,461.00	371,437,900	
双葉電子工業	2,600	822.00	2,137,200	
北陸電気工業	600	1,020.00	612,000	
ニチコン	4,700	1,035.00	4,864,500	
日本ケミコン	1,400	1,968.00	2,755,200	
K O A	2,300	1,578.00	3,629,400	
市光工業	1,800	579.00	1,042,200	
小糸製作所	8,200	6,690.00	54,858,000	
ミツバ	2,800	626.00	1,752,800	
S C R E E Nホールディングス	2,600	11,360.00	29,536,000	
キャノン電子	1,400	1,576.00	2,206,400	
キャノン	74,300	2,605.50	193,588,650	代用有価証券 10,000株
リコー	41,500	1,082.00	44,903,000	
象印マホービン	4,000	1,580.00	6,320,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,608.00	321,600	
東京エレクトロン	9,500	57,310.00	544,445,000	
トヨタ紡織	6,100	2,273.00	13,865,300	

芦森工業	300	989.00	296,700
ユニプレス	2,300	909.00	2,090,700
豊田自動織機	12,100	9,850.00	119,185,000
モリタホールディングス	2,400	1,426.00	3,422,400
三櫻工業	2,100	1,013.00	2,127,300
デンソー	32,900	8,301.00	273,102,900
東海理化電機製作所	3,900	1,606.00	6,263,400
川崎重工業	10,900	2,327.00	25,364,300
名村造船所	4,700	227.00	1,066,900
日本車輛製造	600	2,113.00	1,267,800
三菱ロジスネクスト	2,000	1,017.00	2,034,000
近畿車輛	300	1,084.00	325,200
日産自動車	176,500	591.20	104,346,800
いすゞ自動車	47,000	1,593.00	74,871,000
トヨタ自動車	757,500	2,028.00	1,536,210,000
日野自動車	18,700	1,104.00	20,644,800
三菱自動車工業	55,400	370.00	20,498,000
エフテック	1,200	570.00	684,000
レシップホールディングス	700	589.00	412,300
G M B	300	770.00	231,000
ファルテック	300	699.00	209,700
武蔵精密工業	3,300	1,920.00	6,336,000
日産車体	2,300	788.00	1,812,400
新明和工業	4,300	919.00	3,951,700
極東開発工業	2,800	1,551.00	4,342,800
トピー工業	1,300	1,146.00	1,489,800
ティラド	400	3,130.00	1,252,000
タチエス	2,700	1,416.00	3,823,200
N O K	7,300	1,374.00	10,030,200
フタバ産業	3,900	440.00	1,716,000
K Y B	1,600	3,200.00	5,120,000
大同メタル工業	3,000	606.00	1,818,000
プレス工業	7,500	406.00	3,045,000
ミクニ	2,000	316.00	632,000
太平洋工業	3,200	1,231.00	3,939,200
河西工業	2,000	336.00	672,000
アイシン	11,000	4,150.00	45,650,000
マツダ	47,000	1,027.00	48,269,000
今仙電機製作所	1,100	655.00	720,500
本田技研工業	117,800	3,295.00	388,151,000
スズキ	34,200	5,446.00	186,253,200
S U B A R U	42,900	2,213.00	94,937,700

安永	800	1,083.00	866,400
ヤマハ発動機	19,500	3,050.00	59,475,000
T B K	1,800	413.00	743,400
エクセディ	2,300	1,743.00	4,008,900
豊田合成	4,800	2,358.00	11,318,400
愛三工業	2,500	832.00	2,080,000
盟和産業	300	1,020.00	306,000
日本プラスト	1,300	628.00	816,400
ヨロズ	1,400	1,218.00	1,705,200
エフ・シー・シー	2,500	1,617.00	4,042,500
シマノ	6,000	31,450.00	188,700,000
テイ・エス テック	6,300	1,458.00	9,185,400
ジャムコ	900	1,007.00	906,300
テルモ	42,300	4,889.00	206,804,700
クリエートメディック	400	980.00	392,000
日機装	4,400	1,027.00	4,518,800
日本エム・ディ・エム	900	2,158.00	1,942,200
島津製作所	19,300	4,675.00	90,227,500
J M S	1,300	645.00	838,500
長野計器	1,100	1,421.00	1,563,100
ブイ・テクノロジー	700	4,300.00	3,010,000
東京計器	1,000	1,010.00	1,010,000
愛知時計電機	200	4,655.00	931,000
インターアクション	800	2,363.00	1,890,400
オーバル	1,300	256.00	332,800
東京精密	2,500	5,270.00	13,175,000
マニー	5,900	1,855.00	10,944,500
ニコン	22,800	1,242.00	28,317,600
トプコン	7,000	2,041.00	14,287,000
オリンパス	78,400	2,656.50	208,269,600
理研計器	1,200	3,170.00	3,804,000
タムロン	1,200	2,575.00	3,090,000
H O Y A	29,200	18,035.00	526,622,000
シード	700	622.00	435,400
ノーリツ鋼機	1,300	2,463.00	3,201,900
エー・アンド・デイ	1,300	1,052.00	1,367,600
朝日インテック	16,400	2,841.00	46,592,400
シチズン時計	17,500	496.00	8,680,000
リズム	500	1,359.00	679,500
大研医器	1,200	560.00	672,000
メニコン	4,900	4,345.00	21,290,500
シンシア	100	589.00	58,900

松風	600	2,286.00	1,371,600
セイコーホールディングス	2,100	2,484.00	5,216,400
ニプロ	11,100	1,162.00	12,898,200
中本パックス	500	1,743.00	871,500
スノーピーク	1,000	6,230.00	6,230,000
パラマウントベッドホールディングス	2,900	2,026.00	5,875,400
トランザクション	900	1,109.00	998,100
粧美堂	600	408.00	244,800
ニホンフラッシュ	1,300	1,109.00	1,441,700
前田工織	1,700	3,500.00	5,950,000
永大産業	2,100	294.00	617,400
アートネイチャー	1,300	695.00	903,500
バンダイナムコホールディングス	13,400	9,262.00	124,110,800
アイフィスジャパン	500	667.00	333,500
共立印刷	2,800	155.00	434,000
SHOEI	1,400	5,140.00	7,196,000
フランスベッドホールディングス	2,000	903.00	1,806,000
パイロットコーポレーション	2,500	4,155.00	10,387,500
萩原工業	1,000	1,506.00	1,506,000
トッパン・フォームズ	2,200	1,038.00	2,283,600
フジシールインターナショナル	3,600	2,553.00	9,190,800
タカラトミー	6,300	1,105.00	6,961,500
広済堂ホールディングス	1,000	937.00	937,000
エステールホールディングス	400	638.00	255,200
タカノ	600	737.00	442,200
プロネクサス	1,200	1,062.00	1,274,400
ホクシン	1,300	179.00	232,700
ウッドワン	500	1,062.00	531,000
大建工業	900	2,449.00	2,204,100
凸版印刷	22,800	1,840.00	41,952,000
大日本印刷	17,700	2,859.00	50,604,300
共同印刷	500	2,620.00	1,310,000
NISSHA	3,100	1,832.00	5,679,200
光村印刷	200	1,507.00	301,400
TAKARA & COMPANY	800	1,797.00	1,437,600
アシックス	13,200	2,978.00	39,309,600
ツツミ	400	2,283.00	913,200
ローランド	1,000	4,765.00	4,765,000
小松ウオール工業	500	1,967.00	983,500
ヤマハ	8,900	6,520.00	58,028,000
河合楽器製作所	400	3,410.00	1,364,000
クリナップ	1,500	545.00	817,500

ピジョン	9,000	2,406.00	21,654,000
兼松サステック	100	1,800.00	180,000
キングジム	1,300	886.00	1,151,800
リンテック	3,200	2,501.00	8,003,200
イトーキ	2,900	385.00	1,116,500
任天堂	8,400	49,260.00	413,784,000
三菱鉛筆	2,500	1,285.00	3,212,500
タカラスタンダード	3,100	1,453.00	4,504,300
コクヨ	7,200	1,729.00	12,448,800
ナカバヤシ	1,400	551.00	771,400
グロープライド	1,300	3,335.00	4,335,500
オカムラ	5,200	1,378.00	7,165,600
美津濃	1,500	2,657.00	3,985,500
東京電力ホールディングス	111,900	308.00	34,465,200
中部電力	45,700	1,140.00	52,098,000
関西電力	56,700	1,050.00	59,535,000
中国電力	23,300	870.00	20,271,000
北陸電力	13,600	530.00	7,208,000
東北電力	35,000	739.00	25,865,000
四国電力	13,400	701.00	9,393,400
九州電力	30,800	814.00	25,071,200
北海道電力	12,900	457.00	5,895,300
沖縄電力	3,200	1,400.00	4,480,000
電源開発	12,700	1,455.00	18,478,500
エフオン	900	798.00	718,200
イーレックス	2,200	2,555.00	5,621,000
レノバ	2,900	5,450.00	15,805,000
東京瓦斯	28,700	2,003.00	57,486,100
大阪瓦斯	27,100	1,838.00	49,809,800
東邦瓦斯	6,900	3,185.00	21,976,500
北海道瓦斯	700	1,516.00	1,061,200
広島ガス	2,900	369.00	1,070,100
西部ガスホールディングス	1,700	2,195.00	3,731,500
静岡ガス	3,900	1,149.00	4,481,100
メタウォーター	1,700	1,969.00	3,347,300
SBSホールディングス	1,100	3,900.00	4,290,000
東武鉄道	14,600	2,857.00	41,712,200
相鉄ホールディングス	4,800	2,176.00	10,444,800
東急	37,700	1,673.00	63,072,100
京浜急行電鉄	19,200	1,320.00	25,344,000
小田急電鉄	22,300	2,394.00	53,386,200
京王電鉄	7,800	5,560.00	43,368,000

京成電鉄	10,400	3,740.00	38,896,000
富士急行	1,800	4,810.00	8,658,000
東日本旅客鉄道	26,300	7,337.00	192,963,100
西日本旅客鉄道	18,100	5,620.00	101,722,000
東海旅客鉄道	12,400	17,570.00	217,868,000
西武ホールディングス	19,500	1,369.00	26,695,500
鴻池運輸	2,400	1,221.00	2,930,400
西日本鉄道	4,200	2,858.00	12,003,600
ハマキョウレックス	1,100	3,115.00	3,426,500
サカイ引越センター	700	4,550.00	3,185,000
近鉄グループホールディングス	14,200	3,680.00	52,256,000
阪急阪神ホールディングス	17,700	3,670.00	64,959,000
南海電気鉄道	6,300	2,255.00	14,206,500
京阪ホールディングス	6,300	3,075.00	19,372,500
神戸電鉄	400	3,440.00	1,376,000
名古屋鉄道	11,700	1,995.00	23,341,500
山陽電気鉄道	1,100	2,026.00	2,228,600
アルプス物流	1,000	1,032.00	1,032,000
日本通運	4,900	7,210.00	35,329,000
ヤマトホールディングス	19,900	2,783.00	55,381,700
山九	3,900	4,955.00	19,324,500
丸運	1,000	266.00	266,000
丸全昭和運輸	1,200	3,445.00	4,134,000
センコーグループホールディングス	7,100	1,014.00	7,199,400
トナミホールディングス	300	4,395.00	1,318,500
ニッコンホールディングス	4,800	2,190.00	10,512,000
日本石油輸送	200	2,706.00	541,200
福山通運	2,300	4,680.00	10,764,000
セイノーホールディングス	9,700	1,387.00	13,453,900
エスライン	500	934.00	467,000
神奈川中央交通	400	3,465.00	1,386,000
日立物流	2,700	4,650.00	12,555,000
丸和運輸機関	3,000	1,519.00	4,557,000
C & F ロジホールディングス	1,400	1,700.00	2,380,000
九州旅客鉄道	11,000	2,759.00	30,349,000
S Gホールディングス	26,800	2,671.00	71,582,800
日本郵船	11,900	7,730.00	91,987,000
商船三井	7,900	7,000.00	55,300,000
川崎汽船	4,400	5,130.00	22,572,000
N S ユナイテッド海運	800	3,330.00	2,664,000
飯野海運	6,900	527.00	3,636,300
乾汽船	1,000	2,096.00	2,096,000

日本航空	32,400	2,630.00	85,212,000
A N Aホールディングス	36,000	2,891.00	104,076,000
パスコ	200	1,518.00	303,600
ランコム	400	8,520.00	3,408,000
日新	1,100	1,808.00	1,988,800
三菱倉庫	4,500	3,120.00	14,040,000
三井倉庫ホールディングス	1,500	2,376.00	3,564,000
住友倉庫	5,000	1,844.00	9,220,000
澁澤倉庫	900	2,216.00	1,994,400
東陽倉庫	2,300	332.00	763,600
日本トランスシティ	3,200	624.00	1,996,800
ケイヒン	200	1,423.00	284,600
中央倉庫	800	962.00	769,600
川西倉庫	300	1,212.00	363,600
安田倉庫	1,200	961.00	1,153,200
ファイブホールディングス	300	710.00	213,000
東洋埠頭	400	1,440.00	576,000
宇徳	1,000	525.00	525,000
上組	7,800	2,300.00	17,940,000
サンリツ	400	860.00	344,000
キムラユニティー	400	1,324.00	529,600
キューソー流通システム	400	2,053.00	821,200
近鉄エクスプレス	2,700	2,716.00	7,333,200
東海運	800	315.00	252,000
エーアイティー	900	1,146.00	1,031,400
内外トランスライン	500	2,002.00	1,001,000
日本コンセプト	400	1,747.00	698,800
N E C ネットエスアイ	4,900	1,897.00	9,295,300
クロスキャット	400	1,256.00	502,400
システナ	5,200	2,060.00	10,712,000
デジタルアーツ	800	10,050.00	8,040,000
日鉄ソリューションズ	2,100	3,590.00	7,539,000
キューブシステム	800	1,001.00	800,800
W O W W O R L D	200	1,620.00	324,000
コア	600	1,603.00	961,800
ラクーンホールディングス	1,000	1,596.00	1,596,000
ソリトンシステムズ	700	1,323.00	926,100
ソフトクリエイティブホールディングス	600	4,070.00	2,442,000
T I S	14,000	3,275.00	45,850,000
J N S ホールディングス	700	494.00	345,800
グリー	9,000	1,052.00	9,468,000
G M O ペパボ	200	2,650.00	530,000

コーエーテクモホールディングス	4,700	5,280.00	24,816,000
三菱総合研究所	600	4,040.00	2,424,000
ボルテージ	400	391.00	156,400
電算	200	2,379.00	475,800
A G S	800	885.00	708,000
ファインデックス	1,300	927.00	1,205,100
ブレインパッド	400	5,820.00	2,328,000
K L a b	2,800	627.00	1,755,600
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,100	1,029.00	2,160,900
イーブックイニシアティブジャパン	300	4,735.00	1,420,500
ネクソン	33,100	2,117.00	70,072,700
アイスタイル	4,600	370.00	1,702,000
エムアップホールディングス	400	4,065.00	1,626,000
エイチーム	1,000	1,774.00	1,774,000
エニグモ	1,600	1,123.00	1,796,800
テクノスジャパン	1,200	585.00	702,000
e n i s h	900	406.00	365,400
コロプラ	4,800	780.00	3,744,000
ブロードリーフ	7,300	552.00	4,029,600
クロス・マーケティンググループ	600	869.00	521,400
デジタルハーツホールディングス	700	1,810.00	1,267,000
システム情報	1,100	967.00	1,063,700
メディアドゥ	500	5,070.00	2,535,000
じげん	4,300	415.00	1,784,500
ブイキューブ	1,500	1,317.00	1,975,500
エンカレッジ・テクノロジー	400	655.00	262,000
サイバーリンクス	500	1,203.00	601,500
フィックスターズ	1,600	761.00	1,217,600
C A R T A H O L D I N G S	600	2,578.00	1,546,800
オブティム	1,100	1,776.00	1,953,600
セレス	500	2,868.00	1,434,000
S H I F T	700	28,180.00	19,726,000
ティーガイア	1,300	1,813.00	2,356,900
セック	200	2,530.00	506,000
テクマトリックス	2,500	1,840.00	4,600,000
プロシップ	500	1,614.00	807,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,223.00	8,892,000
G M O ペイメントゲートウェイ	2,800	15,080.00	42,224,000
ザッパラス	600	548.00	328,800
システムリサーチ	400	1,951.00	780,400
インターネットイニシアティブ	3,900	4,385.00	17,101,500
さくらインターネット	1,600	596.00	953,600

ヴィンクス	400	985.00	394,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	4,460.00	1,338,000
SRAホールディングス	700	2,918.00	2,042,600
システムインテグレータ	500	609.00	304,500
朝日ネット	1,400	707.00	989,800
eBASE	1,800	721.00	1,297,800
アバント	1,600	1,395.00	2,232,000
アドソル日進	500	2,137.00	1,068,500
ODKソリューションズ	300	689.00	206,700
フリービット	900	1,365.00	1,228,500
コムチュア	1,600	3,360.00	5,376,000
サイバーコム	200	1,281.00	256,200
アステリア	1,100	714.00	785,400
アイル	800	1,674.00	1,339,200
マークラインズ	700	3,230.00	2,261,000
メディカル・データ・ビジョン	1,900	1,395.00	2,650,500
gumi	2,100	879.00	1,845,900
ショーケース	400	584.00	233,600
モバイルファクトリー	400	1,040.00	416,000
テラスカイ	500	2,504.00	1,252,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,781.00	1,246,700
PCIホールディングス	700	1,055.00	738,500
パイプドHD	300	2,931.00	879,300
アイビーシー	300	922.00	276,600
ネオジャパン	400	1,297.00	518,800
PR TIMES	300	3,260.00	978,000
ラクス	5,000	3,650.00	18,250,000
ランドコンピュータ	400	813.00	325,200
ダブルスタンダード	400	3,760.00	1,504,000
オープンドア	900	2,830.00	2,547,000
マイネット	600	687.00	412,200
アカツキ	700	3,235.00	2,264,500
ベネフィットジャパン	100	2,682.00	268,200
Ubicomホールディングス	400	2,819.00	1,127,600
カナミックネットワーク	1,600	600.00	960,000
ノムラシステムコーポレーション	800	289.00	231,200
チェンジ	2,700	2,026.00	5,470,200
シンクロ・フード	800	381.00	304,800
オークネット	800	2,405.00	1,924,000
キャピタル・アセット・プランニング	300	883.00	264,900
エイトレッド	200	2,410.00	482,000
マクロミル	3,000	832.00	2,496,000

ビーグリー	400	1,662.00	664,800	
オロ	500	3,730.00	1,865,000	
ユーザーローカル	400	1,874.00	749,600	
テモナ	300	726.00	217,800	
マネーフォワード	2,200	8,130.00	17,886,000	
サインポスト	500	1,929.00	964,500	
電算システムホールディングス	600	2,625.00	1,575,000	
ソルクシーズ	1,300	506.00	657,800	
フェイス	400	650.00	260,000	
プロトコーポレーション	1,600	1,370.00	2,192,000	
ハイマックス	400	1,176.00	470,400	
野村総合研究所	28,400	4,600.00	130,640,000	
サイバネットシステム	1,100	697.00	766,700	
C Eホールディングス	800	540.00	432,000	
日本システム技術	300	2,231.00	669,300	
インテージホールディングス	1,800	2,063.00	3,713,400	
東邦システムサイエンス	400	999.00	399,600	
ソースネクスト	6,400	198.00	1,267,200	
インフォコム	1,600	2,364.00	3,782,400	
シンプレクス・ホールディングス	1,500	2,720.00	4,080,000	
HEROZ	400	1,683.00	673,200	
ラクスル	1,600	6,860.00	10,976,000	
I P S	400	1,799.00	719,600	
F I G	1,700	315.00	535,500	
システムサポート	400	1,363.00	545,200	
イーソル	900	799.00	719,100	
アルテリア・ネットワークス	1,900	1,680.00	3,192,000	
E d u L a b	200	1,649.00	329,800	
東海ソフト	200	1,213.00	242,600	
ウイングアーク1 s t	900	2,188.00	1,969,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	2,499.00	999,600	
サーバーワークス	300	4,110.00	1,233,000	
東名	200	1,139.00	227,800	
ヴィッツ	100	1,600.00	160,000	
トビラシステムズ	300	1,048.00	314,400	
S a n s a n	1,300	13,560.00	17,628,000	
L i n k - U	300	1,201.00	360,300	
ギフトィ	1,300	3,875.00	5,037,500	
ベース	300	4,880.00	1,464,000	
フォーカスシステムズ	1,000	1,036.00	1,036,000	
クレスコ	1,100	2,177.00	2,394,700	
フジ・メディア・ホールディングス	14,100	1,271.00	17,921,100	

オービック	4,600	20,740.00	95,404,000
ジャストシステム	2,100	5,850.00	12,285,000
TDCソフト	1,300	1,273.00	1,654,900
Zホールディングス	213,400	785.00	167,519,000
トレンドマイクロ	7,800	6,520.00	50,856,000
IDホールディングス	900	919.00	827,100
日本オラクル	3,000	10,370.00	31,110,000
アルファシステムズ	400	4,290.00	1,716,000
フューチャー	1,500	3,765.00	5,647,500
CAC Holdings	900	1,663.00	1,496,700
SBテクノロジー	700	3,105.00	2,173,500
トーセ	400	794.00	317,600
オービックビジネスコンサルタント	1,400	5,430.00	7,602,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,700	3,750.00	25,125,000
アイティフォー	1,800	872.00	1,569,600
東計電算	200	4,740.00	948,000
エクスネット	200	996.00	199,200
大塚商会	7,900	5,290.00	41,791,000
サイボウズ	2,000	2,646.00	5,292,000
電通国際情報サービス	2,100	4,020.00	8,442,000
ACCESS	1,700	861.00	1,463,700
デジタルガレージ	2,400	5,530.00	13,272,000
EMシステムズ	2,500	766.00	1,915,000
ウェザーニューズ	400	8,670.00	3,468,000
CIJ	1,000	850.00	850,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,530.00	706,000
日本エンタープライズ	1,600	198.00	316,800
WOWOW	700	2,222.00	1,555,400
スカラ	1,300	726.00	943,800
インテリジェント ウェイブ	900	563.00	506,700
IMAGICA GROUP	1,300	681.00	885,300
ネットワンシステムズ	5,600	3,815.00	21,364,000
システムソフト	3,300	134.00	442,200
アルゴグラフィックス	1,100	3,080.00	3,388,000
マーベラス	2,300	779.00	1,791,700
エイベックス	2,500	1,667.00	4,167,500
日本ユニシス	4,600	3,490.00	16,054,000
兼松エレクトロニクス	800	3,730.00	2,984,000
都築電気	800	1,818.00	1,454,400
TBSホールディングス	8,900	1,896.00	16,874,400
日本テレビホールディングス	12,300	1,307.00	16,076,100
朝日放送グループホールディングス	1,500	714.00	1,071,000

テレビ朝日ホールディングス	3,500	1,805.00	6,317,500
スカパーJ S A Tホールディングス	12,400	436.00	5,406,400
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,230.00	2,453,000
日本BS放送	500	1,125.00	562,500
ビジョン	2,500	1,559.00	3,897,500
スマートバリュー	400	577.00	230,800
USEN-NEXT HOLDINGS	1,400	3,600.00	5,040,000
コネクシオ	1,000	1,418.00	1,418,000
日本通信	12,200	205.00	2,501,000
クロップス	300	985.00	295,500
日本電信電話	171,600	3,224.00	553,238,400
KDDI	107,000	3,396.00	363,372,000
ソフトバンク	222,300	1,491.50	331,560,450
光通信	1,700	18,130.00	30,821,000
エムティーアイ	1,500	689.00	1,033,500
GMOインターネット	5,200	3,225.00	16,770,000
アйдママーケティングコミュニケーション	400	385.00	154,000
KADOKAWA	4,300	6,530.00	28,079,000
学研ホールディングス	2,100	1,087.00	2,282,700
ゼンリン	2,400	1,039.00	2,493,600
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	1,300	270.00	351,000
アイネット	800	1,375.00	1,100,000
松竹	1,000	12,440.00	12,440,000
東宝	8,700	5,600.00	48,720,000
東映	500	23,320.00	11,660,000
エヌ・ティ・ティ・データ	39,100	2,380.00	93,058,000
ピー・シー・エー	900	1,646.00	1,481,400
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,897.00	948,500
D T S	2,800	2,466.00	6,904,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,800	6,500.00	44,200,000
シーイーシー	1,600	1,357.00	2,171,200
カブコン	13,800	3,175.00	43,815,000
アイ・エス・ビー	700	1,154.00	807,800
ジャステック	900	1,297.00	1,167,300
S C S K	10,200	2,183.00	22,266,600
日本システムウエア	600	2,425.00	1,455,000
アイネス	1,300	1,460.00	1,898,000
T K C	2,500	3,530.00	8,825,000
富士ソフト	1,600	5,760.00	9,216,000
N S D	4,700	2,150.00	10,105,000
コナミホールディングス	5,300	6,520.00	34,556,000

福井コンピュータホールディングス	700	3,985.00	2,789,500
J B C Cホールディングス	1,000	1,747.00	1,747,000
ミロク情報サービス	1,300	1,815.00	2,359,500
ソフトバンクグループ	88,000	6,161.00	542,168,000
ハウスイ	200	930.00	186,000
高千穂交易	600	1,239.00	743,400
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,578.00	473,400
伊藤忠食品	400	5,120.00	2,048,000
エレマテック	1,200	1,120.00	1,344,000
J A L U X	500	2,552.00	1,276,000
あらた	1,200	4,110.00	4,932,000
トーメンデバイス	200	6,140.00	1,228,000
東京エレクトロン デバイス	400	7,470.00	2,988,000
フィールズ	1,400	542.00	758,800
双日	16,300	1,722.00	28,068,600
アルフレッサ ホールディングス	16,400	1,671.00	27,404,400
横浜冷凍	4,200	882.00	3,704,400
神栄	200	1,004.00	200,800
ラサ商事	900	925.00	832,500
アルコニックス	1,600	1,628.00	2,604,800
神戸物産	11,400	4,065.00	46,341,000
ハイパー	400	555.00	222,000
あい ホールディングス	2,100	2,182.00	4,582,200
ディーブイエックス	500	1,103.00	551,500
ダイワボウホールディングス	7,200	2,004.00	14,428,800
マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	2,692.00	9,422,000
ラクト・ジャパン	500	2,697.00	1,348,500
グリムス	700	2,634.00	1,843,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	786.00	2,122,200
八洲電機	1,100	937.00	1,030,700
メディアスホールディングス	900	864.00	777,600
レスターホールディングス	1,400	1,902.00	2,662,800
ジュテックホールディングス	400	1,215.00	486,000
大光	600	717.00	430,200
O C H Iホールディングス	500	1,269.00	634,500
T O K A Iホールディングス	7,100	872.00	6,191,200
黒谷	500	656.00	328,000
C o m i n i x	300	731.00	219,300
三洋貿易	1,500	1,072.00	1,608,000
ビューティガレージ	200	4,265.00	853,000
ウイン・パートナーズ	1,100	946.00	1,040,600
ミタチ産業	400	947.00	378,800

シップヘルスケアホールディングス	4,700	2,984.00	14,024,800
明治電機工業	500	1,338.00	669,000
デリカフーズホールディングス	600	623.00	373,800
スターティアホールディングス	400	1,459.00	583,600
コメダホールディングス	3,200	2,066.00	6,611,200
ピーバンドットコム	300	671.00	201,300
アセンテック	600	1,329.00	797,400
富士興産	400	1,067.00	426,800
協栄産業	200	1,544.00	308,800
フルサト・マルカホールディングス	1,400	1,986.00	2,780,400
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,122.00	1,122,000
小野建	1,400	1,667.00	2,333,800
南陽	300	2,011.00	603,300
佐島電機	1,000	1,100.00	1,100,000
エコートレーディング	400	637.00	254,800
伯東	900	2,237.00	2,013,300
コンドーテック	1,200	941.00	1,129,200
中山福	900	388.00	349,200
ナガイレーベン	2,000	2,383.00	4,766,000
三菱食品	1,400	2,826.00	3,956,400
松田産業	1,100	3,360.00	3,696,000
第一興商	2,800	4,190.00	11,732,000
メディバルホールディングス	15,900	2,100.00	33,390,000
S P K	600	1,376.00	825,600
萩原電気ホールディングス	600	2,201.00	1,320,600
アズワン	1,100	14,610.00	16,071,000
スズデン	500	1,718.00	859,000
シモジマ	900	1,121.00	1,008,900
ドウシシャ	1,400	1,649.00	2,308,600
小津産業	300	1,912.00	573,600
高速	900	1,544.00	1,389,600
たけびし	600	1,478.00	886,800
リックス	400	1,534.00	613,600
丸文	1,400	842.00	1,178,800
ハピネット	1,300	1,536.00	1,996,800
橋本総業ホールディングス	300	2,151.00	645,300
日本ライフライン	4,400	1,191.00	5,240,400
タカショー	1,200	824.00	988,800
I D O M	4,500	782.00	3,519,000
進和	900	2,110.00	1,899,000
エスケイジャパン	400	492.00	196,800
ダイトロン	600	2,145.00	1,287,000

シークス	2,100	1,273.00	2,673,300
田中商事	500	666.00	333,000
オーハシテクニカ	900	1,460.00	1,314,000
白銅	500	2,910.00	1,455,000
ダイコー通産	200	1,196.00	239,200
伊藤忠商事	101,000	3,449.00	348,349,000
丸紅	145,400	1,037.50	150,852,500
高島	200	1,914.00	382,800
長瀬産業	8,100	1,807.00	14,636,700
蝶理	800	1,853.00	1,482,400
豊田通商	14,800	5,290.00	78,292,000
三共生興	2,000	572.00	1,144,000
兼松	5,500	1,311.00	7,210,500
ツカモトコーポレーション	300	1,339.00	401,700
三井物産	114,400	2,540.00	290,576,000
日本紙パルプ商事	800	3,900.00	3,120,000
カメイ	1,800	1,143.00	2,057,400
東都水産	100	4,720.00	472,000
OUGホールディングス	200	2,721.00	544,200
スターゼン	1,100	2,152.00	2,367,200
山善	6,200	1,055.00	6,541,000
椿本興業	300	3,825.00	1,147,500
住友商事	93,000	1,665.50	154,891,500
内田洋行	600	4,900.00	2,940,000
三菱商事	110,400	3,435.00	379,224,000
第一実業	700	5,190.00	3,633,000
キャノンマーケティングジャパン	3,700	2,305.00	8,528,500
西華産業	800	1,663.00	1,330,400
佐藤商事	1,200	1,193.00	1,431,600
菱洋エレクトロ	900	2,360.00	2,124,000
東京産業	1,400	747.00	1,045,800
ユアサ商事	1,400	3,020.00	4,228,000
神鋼商事	300	3,460.00	1,038,000
トルク	1,000	220.00	220,000
阪和興業	3,000	3,340.00	10,020,000
正栄食品工業	1,000	4,005.00	4,005,000
カナデン	1,200	1,044.00	1,252,800
菱電商事	1,200	1,741.00	2,089,200
岩谷産業	3,500	6,800.00	23,800,000
ナイス	500	1,847.00	923,500
ニチモウ	200	2,100.00	420,000
極東貿易	400	2,592.00	1,036,800

アステナホールディングス	2,100	572.00	1,201,200
三愛石油	3,600	1,400.00	5,040,000
稲畑産業	3,200	1,674.00	5,356,800
G S I クレオス	800	900.00	720,000
明和産業	1,400	825.00	1,155,000
クワザワホールディングス	700	660.00	462,000
ワキタ	3,200	1,042.00	3,334,400
東邦ホールディングス	4,700	1,810.00	8,507,000
サンゲツ	3,900	1,580.00	6,162,000
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,351.00	2,972,200
シナネンホールディングス	600	3,450.00	2,070,000
伊藤忠エネクス	3,300	1,009.00	3,329,700
サンリオ	4,600	2,800.00	12,880,000
サンワテクノス	900	1,498.00	1,348,200
リョーサン	1,600	2,391.00	3,825,600
新光商事	2,300	862.00	1,982,600
トーヨー	700	1,540.00	1,078,000
三信電気	700	1,668.00	1,167,600
東陽テクニカ	1,500	1,126.00	1,689,000
モスフードサービス	1,900	3,150.00	5,985,000
加賀電子	1,300	3,010.00	3,913,000
ソーダニッカ	1,600	625.00	1,000,000
立花エレテック	1,200	1,590.00	1,908,000
フォーバル	700	1,141.00	798,700
P A L T A C	2,100	4,990.00	10,479,000
三谷産業	1,900	349.00	663,100
太平洋興発	600	651.00	390,600
西本Wismettacホールディングス	300	4,095.00	1,228,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,009.00	401,800
コア商事ホールディングス	1,200	693.00	831,600
国際紙パルプ商事	3,300	407.00	1,343,100
ヤマタネ	700	1,606.00	1,124,200
丸紅建材リース	200	1,839.00	367,800
日鉄物産	1,100	4,960.00	5,456,000
泉州電業	400	4,735.00	1,894,000
トラスコ中山	3,100	2,691.00	8,342,100
オートバックスセブン	5,000	1,405.00	7,025,000
モリト	1,200	678.00	813,600
加藤産業	2,100	3,185.00	6,688,500
北恵	400	1,004.00	401,600
イノテック	900	1,500.00	1,350,000
イエローハット	2,600	1,729.00	4,495,400

J Kホールディングス	1,200	1,039.00	1,246,800
日伝	1,200	2,270.00	2,724,000
北沢産業	1,200	248.00	297,600
杉本商事	700	2,359.00	1,651,300
因幡電機産業	3,900	2,708.00	10,561,200
東テク	500	2,591.00	1,295,500
ミスミグループ本社	18,500	4,845.00	89,632,500
アルテック	1,100	318.00	349,800
タキヒヨー	500	1,775.00	887,500
蔵王産業	300	1,884.00	565,200
スズケン	5,800	3,170.00	18,386,000
ジェコス	1,100	836.00	919,600
グローセル	1,900	403.00	765,700
ローソン	3,300	5,850.00	19,305,000
サンエー	1,100	4,195.00	4,614,500
カワチ薬品	1,200	2,329.00	2,794,800
エービーシー・マート	2,300	5,630.00	12,949,000
ハードオフコーポレーション	700	758.00	530,600
アスクル	2,400	1,545.00	3,708,000
ゲオホールディングス	2,000	1,224.00	2,448,000
アダストリア	1,600	2,140.00	3,424,000
ジーフット	1,000	399.00	399,000
シー・ヴィー・エス・ベイエリア	300	403.00	120,900
くら寿司	1,500	3,815.00	5,722,500
キャンドウ	700	2,557.00	1,789,900
アイケイ	500	515.00	257,500
パルグループホールディングス	1,300	1,690.00	2,197,000
エディオン	6,800	1,071.00	7,282,800
サーラコーポレーション	3,100	631.00	1,956,100
ワッツ	800	763.00	610,400
ハローズ	700	2,829.00	1,980,300
フジオフードグループ本社	1,300	1,406.00	1,827,800
あみやき亭	400	3,050.00	1,220,000
ひらまつ	3,400	211.00	717,400
大黒天物産	500	6,620.00	3,310,000
ハニーズホールディングス	1,200	1,095.00	1,314,000
ファーマライズホールディングス	400	806.00	322,400
アルペン	1,100	2,458.00	2,703,800
ハブ	500	746.00	373,000
クオールホールディングス	1,800	1,632.00	2,937,600
ジズホールディングス	1,000	7,370.00	7,370,000
ビックカメラ	8,800	1,004.00	8,835,200

D C Mホールディングス	9,100	1,121.00	10,201,100	
M o n o t a R O	18,600	2,431.00	45,216,600	
東京一番フーズ	400	599.00	239,600	
オークランドサービスホールディングス	1,100	2,286.00	2,514,600	
J . フロント リテイリング	17,600	1,111.00	19,553,600	
ドトール・日レスホールディングス	2,500	1,666.00	4,165,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	9,100	4,910.00	44,681,000	
ブロンコビリー	800	2,449.00	1,959,200	
Z O Z O	10,100	3,660.00	36,966,000	
トレジャー・ファクトリー	500	1,011.00	505,500	
物語コーポレーション	800	7,280.00	5,824,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,800	891.00	22,987,800	
H a m e e	400	1,260.00	504,000	
マーケットエンタープライズ	100	711.00	71,100	
ウエルシアホールディングス	7,800	4,250.00	33,150,000	
クリエイティブSDホールディングス	2,200	3,455.00	7,601,000	
丸善C H Iホールディングス	1,900	378.00	718,200	
ミサワ	400	678.00	271,200	
ティーライフ	200	1,453.00	290,600	
シュッピン	1,200	1,313.00	1,575,600	
オイシックス・ラ・大地	2,100	4,785.00	10,048,500	
ネクステージ	3,000	2,256.00	6,768,000	
ジョイフル本田	4,300	1,562.00	6,716,600	
鳥貴族ホールディングス	600	1,975.00	1,185,000	
ホットランド	1,100	1,385.00	1,523,500	
すかいらーくホールディングス	19,000	1,553.00	29,507,000	
S F Pホールディングス	700	1,480.00	1,036,000	
綿半ホールディングス	1,100	1,236.00	1,359,600	
ヨシックスホールディングス	300	2,141.00	642,300	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,300	1,026.00	4,411,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,285.00	1,028,000	
B E E N O S	700	2,595.00	1,816,500	
あさひ	1,200	1,371.00	1,645,200	
日本調剤	900	1,510.00	1,359,000	
コスモス薬品	1,500	17,860.00	26,790,000	
トーエル	800	798.00	638,400	
オンリー	200	761.00	152,200	
セブン&アイ・ホールディングス	57,600	4,987.00	287,251,200	
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	7,000	745.00	5,215,000	
ツルハホールディングス	3,200	14,230.00	45,536,000	
サンマルクホールディングス	1,200	1,556.00	1,867,200	

フェリシモ	400	1,432.00	572,800
トリドールホールディングス	3,700	2,984.00	11,040,800
TOKYO BASE	1,400	819.00	1,146,600
ウイルプラスホールディングス	300	1,036.00	310,800
JMホールディングス	1,000	1,884.00	1,884,000
サツドラホールディングス	200	2,256.00	451,200
アレンザホールディングス	1,200	1,176.00	1,411,200
串カツ田中ホールディングス	400	2,333.00	933,200
パロックジャパンリミテッド	1,100	877.00	964,700
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,590.00	11,385,000
FOOD & LIFE COMPANIE	8,600	4,975.00	42,785,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	682.00	1,023,000
一家ホールディングス	400	590.00	236,000
はるやまホールディングス	800	585.00	468,000
ノジマ	2,400	2,395.00	5,748,000
カッパ・クリエイト	2,100	1,421.00	2,984,100
ライトオン	1,200	706.00	847,200
良品計画	17,000	2,130.00	36,210,000
三城ホールディングス	2,000	259.00	518,000
アドヴァングループ	1,500	967.00	1,450,500
アルビス	500	2,315.00	1,157,500
コナカ	1,800	333.00	599,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,664.00	332,800
G-7ホールディングス	1,700	1,862.00	3,165,400
イオン北海道	2,600	1,353.00	3,517,800
コジマ	2,600	581.00	1,510,600
ヒマラヤ	500	1,010.00	505,000
コーナン商事	2,100	3,580.00	7,518,000
エコス	600	1,859.00	1,115,400
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	29,500	2,405.00	70,947,500
西松屋チェーン	3,200	1,482.00	4,742,400
ゼンショーホールディングス	7,200	2,737.00	19,706,400
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,509.00	1,509,000
ハークスレイ	700	473.00	331,100
サイゼリヤ	2,200	3,080.00	6,776,000
VTホールディングス	5,600	513.00	2,872,800
魚力	400	2,000.00	800,000
フジ・コーポレーション	800	1,216.00	972,800
ユナイテッドアローズ	1,600	2,188.00	3,500,800
ハイデイ日高	2,100	1,662.00	3,490,200
YU-WA Creation Holdi	1,000	229.00	229,000
コロワイド	6,100	1,689.00	10,302,900

ピーシーデポコーポレーション	1,800	474.00	853,200
壱番屋	1,000	4,620.00	4,620,000
P L A N T	400	720.00	288,000
スギホールディングス	2,900	8,310.00	24,099,000
薬王堂ホールディングス	800	2,414.00	1,931,200
スクロール	2,400	919.00	2,205,600
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,716.00	2,402,400
木曽路	1,900	2,201.00	4,181,900
S R S ホールディングス	2,000	785.00	1,570,000
千趣会	2,800	397.00	1,111,600
リテールパートナーズ	1,800	1,207.00	2,172,600
ケーヨー	2,700	832.00	2,246,400
上新電機	1,700	2,256.00	3,835,200
日本瓦斯	7,200	1,419.00	10,216,800
ロイヤルホールディングス	2,500	2,144.00	5,360,000
東天紅	100	1,105.00	110,500
いなげや	1,800	1,407.00	2,532,600
チヨダ	1,500	771.00	1,156,500
ライフコーポレーション	1,400	3,625.00	5,075,000
リンガーハット	1,800	2,266.00	4,078,800
M r M a x H D	1,900	589.00	1,119,100
A O K I ホールディングス	3,000	723.00	2,169,000
オークワ	2,300	1,114.00	2,562,200
コメリ	2,300	2,641.00	6,074,300
青山商事	3,100	837.00	2,594,700
しまむら	1,700	9,500.00	16,150,000
はせがわ	900	260.00	234,000
高島屋	10,700	1,169.00	12,508,300
松屋	3,000	1,029.00	3,087,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,000	926.00	6,482,000
近鉄百貨店	600	2,661.00	1,596,600
丸井グループ	12,500	2,302.00	28,775,000
アクシアル リテイリング	1,200	3,435.00	4,122,000
イオン	56,700	2,691.50	152,608,050
イズミ	2,700	3,580.00	9,666,000
平和堂	2,700	2,006.00	5,416,200
フジ	1,800	2,014.00	3,625,200
ヤオコー	1,700	6,790.00	11,543,000
ゼビオホールディングス	2,000	1,033.00	2,066,000
ケーズホールディングス	13,600	1,158.00	15,748,800
O l y m p i c グループ	800	724.00	579,200
日産東京販売ホールディングス	2,300	241.00	554,300

シルバーライフ	300	1,430.00	429,000
Genky DrugStores	700	5,160.00	3,612,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,206.00	482,400
ブックオフグループホールディングス	900	994.00	894,600
ギフト	300	3,120.00	936,000
アインホールディングス	2,100	6,350.00	13,335,000
元気寿司	400	2,708.00	1,083,200
ヤマダホールディングス	53,900	425.00	22,907,500
アークランドサカモト	2,300	1,748.00	4,020,400
ニトリホールディングス	5,800	21,160.00	122,728,000
愛眼	1,200	201.00	241,200
ケーユーホールディングス	800	1,070.00	856,000
吉野家ホールディングス	5,100	2,388.00	12,178,800
松屋フーズホールディングス	700	3,655.00	2,558,500
サガミホールディングス	2,300	1,050.00	2,415,000
関西スーパーマーケット	1,100	1,235.00	1,358,500
王将フードサービス	1,000	5,970.00	5,970,000
プレナス	1,700	1,951.00	3,316,700
ミニストップ	1,100	1,415.00	1,556,500
アークス	2,800	2,209.00	6,185,200
パローホールディングス	3,300	2,425.00	8,002,500
藤久	400	786.00	314,400
ベルク	700	5,500.00	3,850,000
大庄	800	1,027.00	821,600
ファーストリテイリング	2,000	78,510.00	157,020,000
サンドラッグ	5,500	3,305.00	18,177,500
サックスパーホールディングス	1,400	600.00	840,000
ヤマザワ	400	1,720.00	688,000
やまや	300	2,440.00	732,000
ベルーナ	3,200	767.00	2,454,400
島根銀行	500	579.00	289,500
じもとホールディングス	1,100	642.00	706,200
めぶきフィナンシャルグループ	76,600	237.00	18,154,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,900	1,473.00	2,798,700
九州フィナンシャルグループ	30,100	398.00	11,979,800
ゆうちょ銀行	34,800	861.00	29,962,800
富山第一銀行	3,600	289.00	1,040,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	84,200	455.00	38,311,000
西日本フィナンシャルホールディングス	9,600	717.00	6,883,200
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,391.00	1,947,400
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,613.00	6,271,200
ひろぎんホールディングス	21,700	651.00	14,126,700

おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,499.00	3,248,700	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,054.00	4,108,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,400	2,110.00	2,954,000	
新生銀行	9,600	1,749.00	16,790,400	
あおぞら銀行	8,200	2,667.00	21,869,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	945,900	638.00	603,484,200	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	168,800	437.50	73,850,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,900	3,904.00	108,921,600	
三井住友フィナンシャルグループ	102,100	3,849.00	392,982,900	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	49,200	719.00	35,374,800	
群馬銀行	28,300	354.00	10,018,200	
武蔵野銀行	2,200	1,752.00	3,854,400	
千葉興業銀行	3,500	265.00	927,500	
筑波銀行	5,800	167.00	968,600	
七十七銀行	4,600	1,210.00	5,566,000	
青森銀行	1,100	1,986.00	2,184,600	
秋田銀行	900	1,460.00	1,314,000	
山形銀行	1,700	813.00	1,382,100	
岩手銀行	1,000	1,655.00	1,655,000	
東邦銀行	12,300	204.00	2,509,200	
東北銀行	700	1,004.00	702,800	
みちのく銀行	900	874.00	786,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,400	2,098.00	26,015,200	
静岡銀行	35,900	924.00	33,171,600	
スルガ銀行	12,900	470.00	6,063,000	
八十二銀行	33,200	375.00	12,450,000	
山梨中央銀行	1,600	823.00	1,316,800	
大垣共立銀行	2,900	1,924.00	5,579,600	
福井銀行	1,300	1,524.00	1,981,200	
清水銀行	600	1,560.00	936,000	
富山銀行	300	1,940.00	582,000	
滋賀銀行	2,800	1,935.00	5,418,000	
南都銀行	2,300	1,962.00	4,512,600	
百五銀行	14,100	334.00	4,709,400	
京都銀行	5,300	5,260.00	27,878,000	
紀陽銀行	5,200	1,486.00	7,727,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,200	838.00	7,709,600	
山陰合同銀行	8,700	574.00	4,993,800	
中国銀行	11,800	843.00	9,947,400	
鳥取銀行	500	1,112.00	556,000	
伊予銀行	19,500	568.00	11,076,000	

百十四銀行	1,600	1,469.00	2,350,400
四国銀行	2,300	748.00	1,720,400
阿波銀行	2,200	2,113.00	4,648,600
大分銀行	800	1,811.00	1,448,800
宮崎銀行	900	2,018.00	1,816,200
佐賀銀行	800	1,400.00	1,120,000
琉球銀行	3,200	752.00	2,406,400
セブン銀行	43,800	240.00	10,512,000
みずほフィナンシャルグループ	188,600	1,547.00	291,764,200
高知銀行	500	756.00	378,000
山口フィナンシャルグループ	17,200	643.00	11,059,600
長野銀行	500	1,094.00	547,000
名古屋銀行	1,100	2,416.00	2,657,600
北洋銀行	22,100	239.00	5,281,900
愛知銀行	500	3,475.00	1,737,500
中京銀行	600	1,335.00	801,000
大光銀行	500	1,350.00	675,000
愛媛銀行	2,100	777.00	1,631,700
トマト銀行	500	1,046.00	523,000
京葉銀行	6,300	448.00	2,822,400
栃木銀行	7,200	178.00	1,281,600
北日本銀行	500	1,530.00	765,000
東和銀行	2,600	510.00	1,326,000
福島銀行	1,700	231.00	392,700
大東銀行	700	692.00	484,400
トモニホールディングス	11,400	304.00	3,465,600
フィデアホールディングス	1,300	1,159.00	1,506,700
池田泉州ホールディングス	17,000	159.00	2,703,000
F P G	5,000	621.00	3,105,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,100	1,311.00	1,442,100
マーキュリアホールディングス	500	744.00	372,000
S B I ホールディングス	18,200	2,880.00	52,416,000
ジャフコ グループ	1,900	7,410.00	14,079,000
大和証券グループ本社	110,500	649.40	71,758,700
野村ホールディングス	225,300	510.40	114,993,120
岡三証券グループ	11,600	385.00	4,466,000
丸三証券	4,400	581.00	2,556,400
東洋証券	4,900	153.00	749,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,900	390.00	6,591,000
光世証券	300	543.00	162,900
水戸証券	4,000	291.00	1,164,000
いちよし証券	2,900	635.00	1,841,500

松井証券	7,200	813.00	5,853,600
マネックスグループ	12,000	1,045.00	12,540,000
極東証券	2,000	772.00	1,544,000
岩井コスモホールディングス	1,400	1,325.00	1,855,000
アイザワ証券グループ	2,400	1,065.00	2,556,000
マネーパートナーズグループ	1,700	254.00	431,800
スパークス・グループ	7,000	309.00	2,163,000
かんぽ生命保険	14,800	1,807.00	26,743,600
S O M P Oホールディングス	26,000	4,921.00	127,946,000
アニコム ホールディングス	4,400	882.00	3,880,800
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	33,100	3,706.00	122,668,600
第一生命ホールディングス	72,600	2,437.50	176,962,500
東京海上ホールディングス	48,600	6,001.00	291,648,600
T & Dホールディングス	38,200	1,439.00	54,969,800
アドバンスクリエイト	700	1,051.00	735,700
全国保証	3,500	5,270.00	18,445,000
あんしん保証	400	306.00	122,400
ジェイリース	500	2,327.00	1,163,500
イントラスト	600	830.00	498,000
日本モーゲージサービス	800	1,094.00	875,200
C a s a	500	922.00	461,000
アルヒ	2,200	1,372.00	3,018,400
プレミアグループ	700	3,735.00	2,614,500
クレディセゾン	9,500	1,420.00	13,490,000
芙蓉総合リース	1,500	7,530.00	11,295,000
みずほリース	2,300	3,560.00	8,188,000
東京センチュリー	2,900	6,230.00	18,067,000
日本証券金融	5,800	809.00	4,692,200
アイフル	24,700	387.00	9,558,900
リコーリース	1,300	3,645.00	4,738,500
イオンフィナンシャルサービス	8,000	1,440.00	11,520,000
アコム	29,100	378.00	10,999,800
ジャックス	1,600	3,075.00	4,920,000
オリエントコーポレーション	39,700	147.00	5,835,900
オリックス	89,600	2,253.00	201,868,800
三菱H C キャピタル	54,400	578.00	31,443,200
九州リースサービス	700	602.00	421,400
日本取引所グループ	37,400	2,584.50	96,660,300
イー・ギャランティ	2,200	2,652.00	5,834,400
アサックス	800	714.00	571,200
N E C キャピタルソリューション	600	2,016.00	1,209,600
いちご	16,600	335.00	5,561,000

日本駐車場開発	16,700	147.00	2,454,900
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,486.00	1,337,400
S R Eホールディングス	400	8,640.00	3,456,000
A Dワークスグループ	3,500	162.00	567,000
ヒューリック	35,300	1,133.00	39,994,900
三栄建築設計	600	1,765.00	1,059,000
野村不動産ホールディングス	7,700	2,723.00	20,967,100
三重交通グループホールディングス	3,100	490.00	1,519,000
サムティ	2,400	2,603.00	6,247,200
ディア・ライフ	2,100	563.00	1,182,300
コーセーアールイー	600	678.00	406,800
日本商業開発	1,000	1,776.00	1,776,000
プレサンスコーポレーション	2,000	1,975.00	3,950,000
T H Eグローバル社	1,400	222.00	310,800
ハウスコム	300	1,278.00	383,400
日本管理センター	800	1,130.00	904,000
サンセイランディック	500	830.00	415,000
エストラスト	300	647.00	194,100
フージャースホールディングス	2,000	696.00	1,392,000
オープンハウス	4,700	7,100.00	33,370,000
東急不動産ホールディングス	43,500	641.00	27,883,500
飯田グループホールディングス	12,300	2,861.00	35,190,300
イーランド	300	1,763.00	528,900
ムゲンエステート	1,100	488.00	536,800
ビーロッド	1,200	559.00	670,800
ファーストブラザーズ	400	1,053.00	421,200
ハウズドゥ	900	965.00	868,500
シーアールイー	400	1,791.00	716,400
プロパティエージェント	200	2,573.00	514,600
ケイアイスター不動産	700	6,330.00	4,431,000
アグレ都市デザイン	300	1,545.00	463,500
グッドコムアセット	700	1,335.00	934,500
ジェイ・エス・ビー	300	2,817.00	845,100
テンポイノベーション	500	908.00	454,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,053.00	315,900
フェイスネットワーク	200	1,278.00	255,600
パーク24	8,000	1,893.00	15,144,000
バラカ	400	1,633.00	653,200
三井不動産	67,300	2,677.00	180,162,100
三菱地所	97,000	1,727.50	167,567,500
平和不動産	2,500	3,465.00	8,662,500
東京建物	14,600	1,667.00	24,338,200

ダイビル	3,800	1,525.00	5,795,000
京阪神ビルディング	2,400	1,408.00	3,379,200
住友不動産	31,000	4,111.00	127,441,000
テオオーシー	2,900	624.00	1,809,600
東京楽天地	300	4,135.00	1,240,500
スターツコーポレーション	2,000	2,741.00	5,482,000
フジ住宅	1,800	715.00	1,287,000
空港施設	1,600	580.00	928,000
明和地所	800	619.00	495,200
ゴールドクレスト	1,200	1,538.00	1,845,600
エスリード	600	1,707.00	1,024,200
日神グループホールディングス	2,600	500.00	1,300,000
日本エスコン	2,800	820.00	2,296,000
タカラレーベン	6,600	297.00	1,960,200
A V A N T I A	900	867.00	780,300
イオンモール	7,400	1,710.00	12,654,000
毎日コムネット	600	777.00	466,200
ファースト住建	600	1,224.00	734,400
カチタス	3,700	4,175.00	15,447,500
トーセイ	2,100	1,113.00	2,337,300
サンフロンティア不動産	2,100	1,080.00	2,268,000
F Jネクストホールディングス	1,500	1,078.00	1,617,000
インテリックス	500	721.00	360,500
ランドビジネス	1,000	276.00	276,000
グランディハウス	1,200	492.00	590,400
日本空港ビルデング	5,600	6,090.00	34,104,000
明豊ファシリティワークス	700	921.00	644,700
日本工営	800	3,550.00	2,840,000
L I F U L L	4,300	364.00	1,565,200
ミクシィ	3,300	2,245.00	7,408,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	2,259.00	2,484,900
日本M&Aセンターホールディングス	23,400	3,655.00	85,527,000
メンバーズ	400	2,556.00	1,022,400
中広	200	396.00	79,200
UTグループ	2,100	4,020.00	8,442,000
アイティメディア	700	2,207.00	1,544,900
E・Jホールディングス	700	1,305.00	913,500
夢真ビーネックスグループ	3,800	1,634.00	6,209,200
コシダカホールディングス	3,800	722.00	2,743,600
アルトナー	400	875.00	350,000
パソナグループ	1,500	3,645.00	5,467,500
C D S	400	1,619.00	647,600

リンクアンドモチベーション	3,200	1,140.00	3,648,000
エス・エム・エス	4,900	4,720.00	23,128,000
サニーサイドアップグループ	500	786.00	393,000
パーソルホールディングス	14,300	3,125.00	44,687,500
リニカル	800	824.00	659,200
クックパッド	4,500	225.00	1,012,500
エスクリ	700	596.00	417,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	700	670.00	469,000
学情	600	1,236.00	741,600
スタジオアリス	600	2,209.00	1,325,400
シミックホールディングス	800	1,600.00	1,280,000
エプロ	300	835.00	250,500
N J S	300	2,020.00	606,000
総合警備保障	5,700	4,795.00	27,331,500
カカクコム	10,600	3,685.00	39,061,000
アイロムグループ	500	1,918.00	959,000
セントケア・ホールディング	900	933.00	839,700
サイネックス	200	674.00	134,800
ルネサンス	1,000	1,319.00	1,319,000
ディップ	2,500	4,165.00	10,412,500
デジタルホールディングス	1,000	1,799.00	1,799,000
新日本科学	1,700	1,673.00	2,844,100
キャリアデザインセンター	400	1,171.00	468,400
ベネフィット・ワン	5,200	5,840.00	30,368,000
エムスリー	25,200	6,346.00	159,919,200
ツカダ・グローバルホールディング	900	351.00	315,900
プラス	200	834.00	166,800
アウトソーシング	8,200	1,657.00	13,587,400
ウェルネット	1,500	506.00	759,000
ワールドホールディングス	600	2,981.00	1,788,600
ディー・エヌ・エー	5,400	2,166.00	11,696,400
博報堂DYホールディングス	19,900	1,940.00	38,606,000
ぐるなび	2,300	596.00	1,370,800
タカミヤ	1,800	448.00	806,400
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	1,001.00	1,001,000
ファンコミュニケーションズ	3,600	450.00	1,620,000
ライク	400	1,850.00	740,000
ビジネス・ブレークスルー	500	429.00	214,500
エスプール	4,000	1,233.00	4,932,000
WDBホールディングス	600	3,725.00	2,235,000
手間いらず	200	6,130.00	1,226,000
ティア	800	484.00	387,200

C D G	200	1,493.00	298,600
アドウェイズ	2,200	879.00	1,933,800
バリューコマース	1,100	4,990.00	5,489,000
インフォマート	15,700	1,262.00	19,813,400
J Pホールディングス	3,700	254.00	939,800
エコナックホールディングス	2,600	99.00	257,400
レッグス	300	1,585.00	475,500
プレステージ・インターナショナル	5,400	763.00	4,120,200
アミューズ	800	2,273.00	1,818,400
ドリームインキュベータ	400	793.00	317,200
クイック	1,000	1,434.00	1,434,000
T A C	800	239.00	191,200
電通グループ	14,700	4,420.00	64,974,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,330.00	931,000
ぴあ	500	4,230.00	2,115,000
イオンファンタジー	600	2,032.00	1,219,200
シーティーエス	1,600	825.00	1,320,000
ネクシィーズグループ	500	885.00	442,500
H . U . グループホールディングス	3,700	2,677.00	9,904,900
アルプス技研	1,300	2,085.00	2,710,500
ダイオーズ	300	1,025.00	307,500
日本空調サービス	1,500	794.00	1,191,000
オリエンタルランド	16,900	18,690.00	315,861,000
ダスキン	3,300	2,713.00	8,952,900
明光ネットワークジャパン	1,700	565.00	960,500
ファルコホールディングス	700	1,710.00	1,197,000
秀英予備校	300	416.00	124,800
ラウンドワン	4,000	1,472.00	5,888,000
リゾートトラスト	6,500	2,077.00	13,500,500
ビー・エム・エル	1,800	3,985.00	7,173,000
りらいあコミュニケーションズ	2,200	1,184.00	2,604,800
リソー教育	6,500	448.00	2,912,000
早稲田アカデミー	800	1,040.00	832,000
ユー・エス・エス	16,000	1,845.00	29,520,000
東京個別指導学院	1,300	694.00	902,200
サイバーエージェント	35,200	2,001.00	70,435,200
楽天グループ	73,400	1,238.00	90,869,200
クリーク・アンド・リバー社	700	2,026.00	1,418,200
モーニングスター	2,500	535.00	1,337,500
テー・オー・ダブリュー	2,500	340.00	850,000
山田コンサルティンググループ	700	1,213.00	849,100
セントラルスポーツ	500	2,526.00	1,263,000

フルキャストホールディングス	1,200	2,785.00	3,342,000	
エン・ジャパン	2,300	4,615.00	10,614,500	
リソルホールディングス	200	4,180.00	836,000	
テクノプロ・ホールディングス	8,600	3,485.00	29,971,000	
アトラグループ	300	315.00	94,500	
インターワークス	400	409.00	163,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	9,050.00	6,335,000	
K e e P e r 技研	900	3,280.00	2,952,000	
ファーストロジック	300	794.00	238,200	
三機サービス	300	1,063.00	318,900	
G u n o s y	900	624.00	561,600	
デザインワン・ジャパン	400	226.00	90,400	
イー・ガーディアン	600	3,300.00	1,980,000	
リブセンス	800	240.00	192,000	
ジャパンマテリアル	4,400	1,616.00	7,110,400	
ベクトル	2,000	1,341.00	2,682,000	
ウチヤマホールディングス	700	372.00	260,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,100	1,656.00	1,821,600	
キャリアリンク	500	1,433.00	716,500	
I B J	1,200	1,128.00	1,353,600	
アサンテ	600	1,735.00	1,041,000	
バリューHR	600	1,967.00	1,180,200	
M & A キャピタルパートナーズ	1,200	6,130.00	7,356,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,460.00	876,000	
E R I ホールディングス	400	1,705.00	682,000	
アビスト	200	2,886.00	577,200	
シグマクシス・ホールディングス	900	2,944.00	2,649,600	
ウィルグループ	1,100	1,398.00	1,537,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	198.00	376,200	
メドピア	1,100	3,070.00	3,377,000	
レアジョブ	300	1,202.00	360,600	
リクルートホールディングス	110,200	7,899.00	870,469,800	
エラン	2,000	1,239.00	2,478,000	
土木管理総合試験所	700	349.00	244,300	
ネットマーケティング	700	536.00	375,200	
日本郵政	186,600	853.00	159,169,800	
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,416.00	2,973,600	
鎌倉新書	1,600	957.00	1,531,200	
S M N	300	690.00	207,000	
一蔵	200	457.00	91,400	
グローバルキッズCOMPANY	300	905.00	271,500	
エアトリ	900	4,310.00	3,879,000	

アトラエ	1,000	2,449.00	2,449,000
ストライク	500	5,830.00	2,915,000
ソラスト	3,500	1,413.00	4,945,500
セラク	500	2,101.00	1,050,500
インソース	1,400	2,606.00	3,648,400
ベikalレント・コンサルティング	1,000	53,400.00	53,400,000
Orchestra Holdings	300	4,975.00	1,492,500
アイモバイル	400	1,486.00	594,400
キャリアインデックス	500	1,010.00	505,000
MS - Japan	600	1,006.00	603,600
船場	300	789.00	236,700
グレイステクノロジー	1,900	1,021.00	1,939,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	2,538.00	11,421,000
フルテック	200	1,480.00	296,000
ツナググループ・ホールディングス	300	323.00	96,900
GameWith	400	540.00	216,000
ソウルドアウト	300	1,383.00	414,900
MS&Consulting	200	771.00	154,200
ウェルビー	900	1,681.00	1,512,900
エル・ティー・エス	200	3,435.00	687,000
ミダックホールディングス	600	5,530.00	3,318,000
日総工産	1,100	735.00	808,500
キュービーネットホールディングス	700	1,983.00	1,388,100
RPAホールディングス	2,000	426.00	852,000
スプリックス	400	1,265.00	506,000
マネジメントソリューションズ	700	3,365.00	2,355,500
プロレド・パートナーズ	300	1,280.00	384,000
and factory	300	474.00	142,200
テノ・ホールディングス	200	823.00	164,600
フロンティア・マネジメント	400	919.00	367,600
ピアラ	200	728.00	145,600
コプロ・ホールディングス	300	1,241.00	372,300
ギークス	200	1,477.00	295,400
カーブスホールディングス	3,900	946.00	3,689,400
フォーラムエンジニアリング	1,000	880.00	880,000
ダイレクトマーケティングミックス	800	4,175.00	3,340,000
ポピンズホールディングス	300	3,690.00	1,107,000
LITALICO	1,200	3,685.00	4,422,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	840.00	672,000
リログループ	7,800	2,257.00	17,604,600
東祥	1,100	2,195.00	2,414,500
TREホールディングス	2,000	1,635.00	3,270,000

人・夢・技術グループ	600	1,959.00	1,175,400	
エイチ・アイ・エス	3,200	2,689.00	8,604,800	
ラックランド	400	3,000.00	1,200,000	
共立メンテナンス	2,500	4,560.00	11,400,000	
イチネンホールディングス	1,500	1,432.00	2,148,000	
建設技術研究所	800	2,776.00	2,220,800	
スペース	1,000	975.00	975,000	
燦ホールディングス	600	1,402.00	841,200	
スバル興業	100	8,390.00	839,000	
東京テアトル	600	1,243.00	745,800	
タナベ経営	600	739.00	443,400	
ナガワ	500	11,130.00	5,565,000	
東京都競馬	1,100	4,580.00	5,038,000	
常磐興産	600	1,446.00	867,600	
カナモト	2,500	2,466.00	6,165,000	
西尾レントオール	1,300	2,874.00	3,736,200	
トランス・コスモス	1,800	3,310.00	5,958,000	
乃村工藝社	6,100	1,112.00	6,783,200	
藤田観光	600	2,560.00	1,536,000	
KNT-CTホールディングス	900	1,780.00	1,602,000	
日本管財	1,500	2,785.00	4,177,500	
トーカイ	1,300	2,221.00	2,887,300	
白洋舎	200	1,864.00	372,800	
セコム	14,100	7,682.00	108,316,200	
セントラル警備保障	700	2,693.00	1,885,100	
丹青社	2,900	927.00	2,688,300	
メイテック	1,700	7,000.00	11,900,000	
応用地質	1,600	1,821.00	2,913,600	
船井総研ホールディングス	2,900	2,635.00	7,641,500	
進学会ホールディングス	500	401.00	200,500	
オオバ	1,000	829.00	829,000	
いであ	400	1,936.00	774,400	
学究社	500	1,409.00	704,500	
ベネッセホールディングス	4,800	2,443.00	11,726,400	
イオンディライト	1,800	3,515.00	6,327,000	
ナック	700	980.00	686,000	
ダイセキ	2,600	5,330.00	13,858,000	
ステップ	500	1,861.00	930,500	
合計	16,274,000		41,695,319,770	

## (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11月 6日現在	2021年11月 8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	972,711,865	1,197,954,079
コール・ローン	1,762,909,076	2,888,755,206
株式	221,987,720,686	250,167,589,782
投資証券	5,247,863,381	5,798,044,857
派生商品評価勘定	121,431,199	241,792,102
未収入金	591,236	68,197
未収配当金	145,728,858	151,944,458
差入委託証拠金	518,140,681	618,174,626
流動資産合計	230,757,096,982	261,064,323,307
資産合計	230,757,096,982	261,064,323,307
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,276,948	6,737,315
未払解約金	8,098,832	172,290,676
未払利息	1,219	1,551
流動負債合計	38,376,999	179,029,542
負債合計	38,376,999	179,029,542
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	80,972,691,731	62,029,182,999
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	149,746,028,252	198,856,110,766
元本等合計	230,718,719,983	260,885,293,765
純資産合計	230,718,719,983	260,885,293,765
負債純資産合計	230,757,096,982	261,064,323,307

## 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。
--------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
1.	期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日
	期首元本額	73,251,955,905円	80,972,691,731円
	期首からの追加設定元本額	31,186,546,669円	5,505,535,862円
	期首からの一部解約元本額	23,465,810,843円	24,449,044,594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）	21,583,842,358円	25,465,344,132円
	DCインデックスバランス（株式20）	130,747,619円	110,868,769円
	DCインデックスバランス（株式40）	335,931,303円	304,596,290円
	DCインデックスバランス（株式60）	637,019,208円	601,540,552円
	DCインデックスバランス（株式80）	647,750,426円	649,449,696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	1,781,110,445円	1,498,519,588円
	日興五大陸株式ファンド	4,645,954,046円	3,935,036,100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）	36,336,826,466円	16,508,539,257円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,550,352円	3,665,248円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,666,871円	3,082,472円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	5,390,061円	4,003,307円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	4,882,516円	3,238,663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	2,365,631,865円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	27,306,646円	19,506,309円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	74,179,157円	55,348,650円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	108,997,787円	86,526,309円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	102,138,945円	81,118,655円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,281,364,537円	4,106,312,280円
計	80,972,691,731円	62,029,182,999円
2. 受益権の総数	80,972,691,731口	62,029,182,999口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2020年11月 6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	2,767,873,639
投資証券	15,981,608
合計	2,783,855,247

（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（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11月 6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	3,360,505,367	-		3,476,085,248	115,579,881
	合計	3,360,505,367	-		3,476,085,248	115,579,881

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

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

## (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11月 6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	1,969,028,120	-		1,944,575,000	24,453,120
	米ドル	1,586,771,460	-		1,564,805,000	21,966,460

	ユーロ	382,256,660	-	379,770,000	2,486,660
	売建	37,790,840	-	37,763,350	27,490
	加ドル	17,062,400	-	17,051,650	10,750
	シンガポールドル	20,728,440	-	20,711,700	16,740
	合計	2,006,818,960	-	1,982,338,350	24,425,630

(2021年11月 8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,870,905,510	-	2,889,217,850	18,312,340
	米ドル	2,252,531,540	-	2,271,719,730	19,188,190
	ユーロ	618,373,970	-	617,498,120	875,850
	売建	7,282,825	-	7,287,500	4,675
	スウェーデンクローナ	7,282,825	-	7,287,500	4,675
	合計	2,878,188,335	-	2,896,505,350	18,307,665

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2020年11月 6日現在		2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	2.8493円	1口当たり純資産額	4.2058円
(1万口当たり純資産額)	(28,493円)	(1万口当たり純資産額)	(42,058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	KYNDRYL HOLDINGS INC(N)	6,938	24.25	168,246.50	
	BAKER HUGHES CO	28,155	24.80	698,244.00	
	CHENIERE ENERGY INC	9,780	107.82	1,054,479.60	
	CHEVRON CORP	74,641	114.74	8,564,308.34	
	CONOCOPHILLIPS	52,316	75.45	3,947,242.20	
	COTERRA ENERGY INC	26,800	21.58	578,344.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	26,280	43.58	1,145,282.40	
	EOG RESOURCES INC	22,662	95.12	2,155,609.44	
	EXXON MOBIL CORP	163,831	65.02	10,652,291.62	
	HALLIBURTON CO	34,687	24.69	856,422.03	
	HESS CORP	10,910	82.55	900,620.50	
	KINDER MORGAN INC	80,380	16.95	1,362,441.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	25,782	65.81	1,696,713.42	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	36,251	33.42	1,211,508.42	
	ONEOK INC	17,040	64.72	1,102,828.80	
	PHILLIPS 66	16,825	77.77	1,308,480.25	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,570	185.30	1,588,021.00	
	SCHLUMBERGER LTD	54,581	33.51	1,829,009.31	
	VALERO ENERGY CORP	15,632	77.92	1,218,045.44	
	WILLIAMS COS INC	48,344	28.56	1,380,704.64	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,725	309.31	2,698,729.75	
	ALBEMARLE CORP	4,600	272.51	1,253,546.00	
	AMCOR PLC	63,210	12.14	767,369.40	
AVERY DENNISON CORP	3,200	226.42	724,544.00		
BALL CORP	12,670	90.49	1,146,508.30		
CELANESE CORP	3,930	169.40	665,742.00		

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,060	59.20	477,152.00
CORTEVA INC	29,012	47.60	1,380,971.20
CROWN HOLDINGS INC	5,235	106.97	559,987.95
DOW INC	28,855	58.31	1,682,535.05
DUPONT DE NEMOURS INC	20,392	80.40	1,639,516.80
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	111.83	569,773.85
ECOLAB INC	10,060	230.68	2,320,640.80
FMC CORP	5,140	106.63	548,078.20
FREEMONT-MCMORAN INC	57,418	37.04	2,126,762.72
INTERNATIONAL PAPER CO	14,510	48.87	709,103.70
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	143.60	1,385,022.00
LINDE PLC	20,220	331.99	6,712,837.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	92.97	934,348.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,425	412.32	999,876.00
MOSAIC CO/THE	14,870	37.35	555,394.50
NEWMONT CORP	31,042	56.36	1,749,527.12
NUCOR CORP	11,709	112.20	1,313,749.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	135.38	484,660.40
PPG INDUSTRIES INC	9,114	163.09	1,486,402.26
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	89.78	501,870.20
SEALED AIR CORP	6,376	62.92	401,177.92
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,831	319.03	3,136,383.93
STEEL DYNAMICS INC	7,510	65.04	488,450.40
VULCAN MATERIALS CO	5,383	196.06	1,055,390.98
WESTROCK CO	10,519	48.76	512,906.44
3M CO	22,486	181.80	4,087,954.80
ALLEGION PLC	3,850	131.41	505,928.50
AMETEK INC	8,943	140.94	1,260,426.42
BOEING CO/THE	21,402	224.46	4,803,892.92
CARRIER GLOBAL CORP	31,848	52.79	1,681,255.92
CATERPILLAR INC	21,256	205.88	4,376,185.28
CUMMINS INC	5,675	237.07	1,345,372.25
DEERE & CO	11,550	355.20	4,102,560.00
DOVER CORP	5,350	171.29	916,401.50
EATON CORP PLC	15,806	171.30	2,707,567.80

EMERSON ELECTRIC CO	23,260	97.93	2,277,851.80
FASTENAL CO	21,616	58.23	1,258,699.68
FORTIVE CORP	13,254	78.71	1,043,222.34
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,570	102.36	570,145.20
GENERAC HOLDINGS INC	2,530	442.88	1,120,486.40
GENERAL DYNAMICS CORP	9,452	201.00	1,899,852.00
GENERAL ELECTRIC CO	42,587	108.74	4,630,910.38
HEICO CORP	2,000	145.41	290,820.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	133.30	330,584.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,986	226.06	6,100,455.16
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	33.40	487,740.20
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,800	194.02	349,236.00
IDEX CORP	2,830	234.51	663,663.30
ILLINOIS TOOL WORKS	12,195	234.07	2,854,483.65
INGERSOLL-RAND INC	15,268	57.25	874,093.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,370	59.60	558,452.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,824	74.63	2,076,505.12
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,205	223.97	1,837,673.85
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	302.18	423,052.00
LOCKHEED MARTIN CORP	9,616	339.89	3,268,382.24
MASCO CORP	8,979	64.17	576,182.43
NORDSON CORP	2,010	261.28	525,172.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,884	364.37	2,143,953.08
OTIS WORLDWIDE CORP	16,004	81.71	1,307,686.84
OWENS CORNING	4,030	95.38	384,381.40
PACCAR INC	14,054	90.00	1,264,860.00
PARKER HANNIFIN CORP	4,895	325.75	1,594,546.25
PENTAIR PLC	5,588	74.31	415,244.28
PLUG POWER INC	19,000	38.37	729,030.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	58,836	91.18	5,364,666.48
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	339.01	1,458,760.03
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,030	484.30	1,951,729.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	59.74	386,517.80
SMITH (A.O.) CORP	4,770	77.55	369,913.50
SNAP-ON INC	1,820	212.01	385,858.20

STANLEY BLACK & DECKER INC	6,136	183.83	1,127,980.88
SUNRUN INC	7,160	56.19	402,320.40
TEXTRON INC	9,246	77.44	716,010.24
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,276	184.69	1,713,184.44
TRANSDIGM GROUP INC	2,095	665.14	1,393,468.30
UNITED RENTALS INC	2,820	391.96	1,105,327.20
WABTEC CORP	5,780	94.21	544,533.80
WW GRAINGER INC	1,607	472.93	759,998.51
XYLEM INC	6,308	131.01	826,411.08
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,570	86.80	483,476.00
CINTAS CORP	3,557	441.95	1,572,016.15
CLARIVATE PLC	12,400	23.36	289,664.00
COPART INC	8,140	153.92	1,252,908.80
COSTAR GROUP INC	14,910	83.25	1,241,257.50
EQUIFAX INC	4,654	284.56	1,324,342.24
IHS MARKIT LTD	14,653	126.66	1,855,948.98
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,090	142.63	725,986.70
LEIDOS HOLDINGS INC	4,840	94.69	458,299.60
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	132.76	1,079,338.80
ROBERT HALF INTL INC	4,405	118.76	523,137.80
ROLLINS INC	9,015	35.86	323,277.90
TRANSUNION	7,140	113.66	811,532.40
VERISK ANALYTICS INC	5,940	214.59	1,274,664.60
WASTE CONNECTIONS INC	10,626	134.42	1,428,346.92
WASTE MANAGEMENT INC	16,744	159.89	2,677,198.16
AMERCO	375	759.25	284,718.75
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,150	93.82	483,173.00
CSX CORP	88,179	35.41	3,122,418.39
DELTA AIR LINES INC	5,105	44.29	226,100.45
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	125.17	816,984.59
FEDEX CORP	9,893	242.77	2,401,723.61
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	193.27	633,925.60
KANSAS CITY SOUTHERN	3,640	308.41	1,122,612.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,180	57.64	356,215.20
LYFT INC-A	9,660	53.55	517,293.00

NORFOLK SOUTHERN CORP	9,830	283.90	2,790,737.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,995	348.83	1,393,575.85
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	52.23	285,698.10
UBER TECHNOLOGIES INC	46,970	47.19	2,216,514.30
UNION PACIFIC CORP	25,616	238.83	6,117,869.28
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,987	208.22	5,827,453.14
APTIV PLC	10,120	175.03	1,771,303.60
AUTOLIV INC	2,540	101.34	257,403.60
BORGWARNER INC	9,890	46.90	463,841.00
FORD MOTOR COMPANY	147,595	19.29	2,847,107.55
GENERAL MOTORS CORP	51,505	58.52	3,014,072.60
LEAR CORP	2,710	178.25	483,057.50
TESLA INC	31,675	1,222.09	38,709,700.75
DR HORTON INC	13,386	92.50	1,238,205.00
GARMIN LTD	5,865	142.18	833,885.70
HASBRO INC	5,298	96.00	508,608.00
LENNAR CORP-CL A	10,480	104.29	1,092,959.20
LULULEMON ATHLETICA INC	4,650	467.91	2,175,781.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,458	177.00	435,066.00
NEWELL BRANDS INC	16,126	24.13	389,120.38
NIKE INC -CL B	49,248	177.51	8,742,012.48
NVR INC	135	5,089.24	687,047.40
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,230	55.64	569,197.20
PULTE GROUP INC	10,010	50.43	504,804.30
VF CORP	13,620	74.04	1,008,424.80
WHIRLPOOL CORP	2,644	218.14	576,762.16
AIRBNB INC-CLASS A	4,500	201.62	907,290.00
ARAMARK	7,800	39.26	306,228.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,583	2,618.97	4,145,829.51
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,990	106.48	850,775.20
CARNIVAL CORP	31,027	24.79	769,159.33
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,105	1,794.35	1,982,756.75
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	154.48	779,042.64
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	495.88	758,696.40
DRAFTKINGS INC - CL A	11,440	43.62	499,012.80

EXPEDIA GROUP INC	5,422	182.17	987,725.74
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,920	151.84	1,658,092.80
LAS VEGAS SANDS CORP	14,900	42.64	635,336.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,603	167.61	1,777,168.83
MCDONALD'S CORP	28,781	254.71	7,330,808.51
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,080	11.47	92,677.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,870	50.37	648,261.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	96.67	845,669.16
STARBUCKS CORP	45,394	116.91	5,307,012.54
VAIL RESORTS INC	1,520	372.51	566,215.20
WYNN RESORTS LTD	3,510	96.92	340,189.20
YUM! BRANDS INC	11,624	126.68	1,472,528.32
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,290	67.83	2,054,570.70
ALPHABET INC-CL A	11,640	2,977.04	34,652,745.60
ALPHABET INC-CL C	11,262	2,984.82	33,615,042.84
ALTICE USA INC- A	10,600	18.06	191,436.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	18,100	41.70	754,770.00
CABLE ONE INC	225	1,767.01	397,577.25
CHARTER COMMUNICATION-A	5,121	689.32	3,530,007.72
COMCAST CORP-CLASS A	177,664	53.90	9,576,089.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,790	26.52	153,550.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	25.68	318,688.80
DISH NETWORK CORP-A	9,279	37.86	351,302.94
ELECTRONIC ARTS INC	11,034	139.57	1,540,015.38
FOX CORP - CLASS A	14,464	41.48	599,966.72
FOX CORP- CLASS B	5,466	38.61	211,042.26
IAC/INTERACTIVECORP	3,330	145.17	483,416.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,536	36.42	492,981.12
LIBERTY BROADBAND-A	740	166.94	123,535.60
LIBERTY BROADBAND-C	5,870	168.88	991,325.60
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	55.00	182,875.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,616	54.68	361,762.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,970	58.42	407,187.40
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,060	123.80	750,228.00
MATCH GROUP INC	9,892	160.73	1,589,941.16

META PLATFORMS INC	92,680	341.13	31,615,928.40
NETFLIX INC	17,155	645.72	11,077,326.60
NEWS CORP - CLASS A	16,580	24.37	404,054.60
OMNICOM GROUP	8,337	68.80	573,585.60
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	46.22	968,309.00
ROKU INC	4,350	278.62	1,211,997.00
SEA LTD-ADR	2,500	357.78	894,450.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.41	302,808.40
SNAP INC - A	36,810	53.17	1,957,187.70
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,450	187.20	833,040.00
THE WALT DISNEY CO.	70,322	175.63	12,350,652.86
TWITTER INC	30,850	53.15	1,639,677.50
VIACOMCBS INC - CLASS B	22,823	36.34	829,387.82
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,488	229.73	571,568.24
AMAZON.COM INC	17,560	3,518.99	61,793,464.40
AUTOZONE INC	847	1,817.94	1,539,795.18
BATH & BODY WORKS INC	10,670	75.31	803,557.70
BEST BUY CO INC	9,014	129.07	1,163,436.98
BURLINGTON STORES INC	2,430	297.88	723,848.40
CARMAX INC	6,249	154.69	966,657.81
CARVANA CO	2,950	297.89	878,775.50
CHEWY INC - CLASS A	3,410	74.40	253,704.00
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,120	225.63	2,057,745.60
DOLLAR TREE INC	9,296	110.00	1,022,560.00
DOORDASH INC - A	2,530	198.68	502,660.40
EBAY INC	26,367	75.57	1,992,554.19
ETSY INC	4,980	260.12	1,295,397.60
GENUINE PARTS CO	5,611	136.36	765,115.96
HOME DEPOT INC	41,080	368.40	15,133,872.00
LKQ CORP	10,810	57.28	619,196.80
LOWE'S COS INC	27,462	235.54	6,468,399.48
MERCADOLIBRE INC	1,740	1,629.76	2,835,782.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,695	638.08	1,719,625.60
POOL CORP	1,460	517.97	756,236.20
ROSS STORES INC	13,722	119.65	1,641,837.30

TARGET CORP	19,200	254.27	4,881,984.00
TJX COMPANIES INC	46,716	71.20	3,326,179.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,490	220.05	988,024.50
ULTA BEAUTY INC	2,010	391.85	787,618.50
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	246.22	699,264.80
COSTCO WHOLESALE CORP	17,164	513.12	8,807,191.68
KROGER CO	28,230	42.32	1,194,693.60
SYSCO CORP	19,886	81.31	1,616,930.66
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28,602	50.20	1,435,820.40
WALMART INC	59,872	150.23	8,994,570.56
ALTRIA GROUP INC	71,708	45.20	3,241,201.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,383	64.49	1,378,989.67
BOSTON BEER COMPANY INC-A	340	502.71	170,921.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	72.68	848,902.40
BUNGE LTD	5,457	92.92	507,064.44
CAMPBELL SOUP CO	6,835	40.73	278,389.55
COCA-COLA CO/THE	158,052	56.84	8,983,675.68
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	55.10	455,126.00
CONAGRA BRANDS INC	19,470	32.59	634,527.30
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,690	222.69	1,489,796.10
GENERAL MILLS INC	23,449	62.65	1,469,079.85
HERSHEY CO/THE	5,715	175.39	1,002,353.85
HORMEL FOODS CORP	11,500	43.21	496,915.00
JM SMUCKER CO/THE	4,760	125.78	598,712.80
KELLOGG CO	10,528	62.56	658,631.68
KEURIG DR PEPPER INC	27,050	36.38	984,079.00
KRAFT HEINZ CO/THE	26,891	37.84	1,017,555.44
LAMB WESTON HOLDING INC	5,990	57.66	345,383.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,410	81.23	845,604.30
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,330	46.61	388,261.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,985	62.26	3,361,106.10
MONSTER BEVERAGE CORP	15,600	91.63	1,429,428.00
PEPSICO INC	53,311	166.00	8,849,626.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	60,068	94.30	5,664,412.40
TYSON FOODS INC-CL A	11,216	81.56	914,776.96

CHURCH & DWIGHT CO INC	9,680	88.78	859,390.40
CLOROX COMPANY	4,916	163.26	802,586.16
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,950	77.84	2,331,308.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,110	349.50	3,183,945.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,023	132.23	1,722,031.29
PROCTER & GAMBLE CO	94,689	146.04	13,828,381.56
ABBOTT LABORATORIES	68,726	124.37	8,547,452.62
ABIOMED INC	1,770	361.71	640,226.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	687.19	1,951,619.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	127.57	736,589.18
ANTHEM INC	9,426	422.06	3,978,337.56
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,619	78.04	1,531,066.76
BECTON DICKINSON AND CO	11,247	243.71	2,741,006.37
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,988	43.16	2,286,962.08
CARDINAL HEALTH INC	11,355	49.54	562,526.70
CENTENE CORP	22,967	74.17	1,703,462.39
CERNER CORP	11,120	75.53	839,893.60
CIGNA CORP	13,150	214.12	2,815,678.00
COOPER COS INC/THE	1,840	424.22	780,564.80
CVS HEALTH CORP	51,098	93.78	4,791,970.44
DAVITA INC	2,648	109.36	289,585.28
DENTSPLY SIRONA INC	9,332	55.81	520,818.92
DEXCOM INC	3,710	635.46	2,357,556.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,040	118.65	2,852,346.00
HCA HEALTHCARE INC	10,405	248.27	2,583,249.35
HENRY SCHEIN INC	5,040	80.10	403,704.00
HOLOGIC INC	10,298	68.97	710,253.06
HUMANA INC	4,975	453.43	2,255,814.25
IDEXX LABORATORIES INC	3,270	637.40	2,084,298.00
INSULET CORP	2,710	308.00	834,680.00
INTUITIVE SURGICAL INC	13,800	364.95	5,036,310.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,875	274.84	1,065,005.00
MASIMO CORP	2,020	280.33	566,266.60
MCKESSON CORP	6,284	221.69	1,393,099.96
MEDTRONIC PLC	51,988	122.98	6,393,484.24

MOLINA HEALTHCARE INC	2,360	304.18	717,864.80
NOVOCURE LTD	3,430	106.42	365,020.60
OAK STREET HEALTH INC	3,420	44.77	153,113.40
QUEST DIAGNOSTICS	5,246	140.55	737,325.30
RESMED INC	5,630	260.55	1,466,896.50
STERIS PLC	3,620	224.58	812,979.60
STRYKER CORP	13,073	276.16	3,610,239.68
TELADOC HEALTH INC	5,180	146.24	757,523.20
TELEFLEX INC	1,760	353.31	621,825.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,435	455.81	16,607,437.35
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	129.88	392,237.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,350	318.82	1,705,687.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,952	141.66	1,126,480.32
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,770	177.98	493,004.60
ABBVIE INC	68,216	117.18	7,993,550.88
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,700	156.41	1,829,997.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,740	187.25	887,565.00
AMGEN INC	22,141	213.77	4,733,081.57
AVANTOR INC	21,080	38.18	804,834.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	725.61	624,024.60
BIO-TECHNE CORP	1,480	497.32	736,033.60
BIOGEN INC	5,823	278.68	1,622,753.64
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,570	83.92	635,274.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	86,105	59.45	5,118,942.25
CATALENT INC	6,520	122.21	796,809.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	375.23	716,689.30
DANAHER CORP	24,969	292.08	7,292,945.52
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	34.09	563,371.34
ELI LILLY & CO	31,554	265.00	8,361,810.00
EXACT SCIENCES CORP	6,990	100.68	703,753.20
GILEAD SCIENCES INC	48,454	66.32	3,213,469.28
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,280	110.67	916,347.60
ILLUMINA INC	5,665	408.14	2,312,113.10
INCYTE CORP	7,110	67.86	482,484.60
IQVIA HOLDINGS INC	7,453	247.19	1,842,307.07

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	135.06	301,183.80
JOHNSON & JOHNSON	101,791	163.43	16,635,703.13
MERCK & CO. INC.	97,673	81.61	7,971,093.53
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	930	1,518.53	1,412,232.90
MODERNA INC	13,215	236.99	3,131,822.85
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	93.21	338,352.30
NOVAVAX INC	2,600	159.19	413,894.00
PERKINELMER INC	4,550	168.84	768,222.00
PFIZER INC	216,590	48.61	10,528,439.90
PPD INC	5,510	47.27	260,457.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,060	611.54	2,482,852.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,460	39.52	255,299.20
SEAGEN INC	5,140	190.86	981,020.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	9.13	397,976.70
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,209	616.80	9,380,911.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,980	192.85	1,924,643.00
VIATRIS INC	48,469	13.73	665,479.37
WATERS CORP	2,336	343.06	801,388.16
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,920	403.78	1,179,037.60
ZOETIS INC	18,340	216.73	3,974,828.20
BANK OF AMERICA CORP	298,319	46.97	14,012,043.43
CITIGROUP INC	79,667	66.99	5,336,892.33
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,580	47.79	744,568.20
FIFTH THIRD BANCORP	27,119	44.08	1,195,405.52
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	219.05	1,478,587.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	56,330	15.85	892,830.50
JPMORGAN CHASE & CO	117,050	168.05	19,670,252.50
KEYCORP	39,428	23.68	933,655.04
M & T BANK CORP	5,223	155.09	810,035.07
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,460	207.10	3,408,866.00
REGIONS FINANCIAL CORP	37,044	24.31	900,539.64
SVB FINANCIAL GROUP	2,225	747.52	1,663,232.00
TRUIST FINANCIAL CORP	51,850	64.29	3,333,436.50
US BANCORP	54,831	60.69	3,327,693.39
WELLS FARGO & CO	160,740	50.44	8,107,725.60

ALLY FINANCIAL INC	14,000	49.45	692,300.00
AMERICAN EXPRESS CO	26,504	176.69	4,682,991.76
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,190	305.24	1,278,955.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,220	76.94	555,506.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,912	58.82	1,935,883.84
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,255	287.88	14,755,289.40
BLACKROCK INC	5,900	955.11	5,635,149.00
BLACKSTONE INC	26,500	142.55	3,777,575.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,475	154.87	2,706,353.25
CARLYLE GROUP INC/THE	6,890	59.83	412,228.70
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	133.27	525,083.80
CME GROUP INC	13,850	221.71	3,070,683.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,120	116.47	1,411,616.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	17,100	35.19	601,749.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,460	446.90	652,474.00
FRANKLIN RESOURCES INC	12,475	35.88	447,603.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	56.49	101,682.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,193	407.08	5,370,606.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,660	136.08	2,947,492.80
INVESCO LTD	13,527	25.98	351,431.46
KKR & CO INC -A	20,050	80.28	1,609,614.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	388.31	551,400.20
MOODY'S CORP	6,482	387.11	2,509,247.02
MORGAN STANLEY	54,203	99.87	5,413,253.61
MSCI INC	3,245	653.34	2,120,088.30
NASDAQ INC	4,485	212.83	954,542.55
NORTHERN TRUST CORP	7,980	123.57	986,088.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,640	100.00	764,000.00
S&P GLOBAL INC	9,297	460.29	4,279,316.13
SCHWAB (CHARLES) CORP	56,083	81.15	4,551,135.45
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	64.33	296,239.65
STATE STREET CORP	13,667	95.67	1,307,521.89
SYNCHRONY FINANCIAL	22,800	49.19	1,121,532.00
T ROWE PRICE GROUP INC	9,005	221.07	1,990,735.35
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	94.50	412,020.00

VOYA FINANCIAL INC	5,580	68.16	380,332.80
AFLAC INC	25,764	56.75	1,462,107.00
ALLEGHANY CORP	500	673.05	336,525.00
ALLSTATE CORP	11,633	117.16	1,362,922.28
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	142.95	414,555.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,935	58.96	1,941,847.60
AON PLC	8,722	288.53	2,516,558.66
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,245	43.36	661,023.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,150	160.26	1,306,119.00
ASSURANT INC	2,300	162.54	373,842.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	5,510	87.24	480,692.40
BROWN & BROWN INC	9,690	61.97	600,489.30
CHUBB LTD	17,315	193.19	3,345,084.85
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,230	126.09	785,540.70
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,190	224.33	266,952.70
EVEREST RE GROUP LTD	1,384	273.55	378,593.20
FNF GROUP	11,561	49.83	576,084.63
GLOBE LIFE INC	3,246	94.85	307,883.10
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,892	71.83	997,862.36
LINCOLN NATIONAL CORP	7,533	72.46	545,841.18
LOEWS CORP	7,055	57.22	403,687.10
MARKEL CORP	525	1,312.71	689,172.75
MARSH & MCLENNAN COS	19,693	161.45	3,179,434.85
METLIFE INC	29,225	63.99	1,870,107.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,890	68.95	750,865.50
PROGRESSIVE CORP	22,550	95.84	2,161,192.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,222	110.92	1,688,424.24
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,847	152.55	281,759.85
TRAVELERS COS INC/THE	9,844	159.60	1,571,102.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,968	231.31	1,149,148.08
WR BERKLEY CORP	5,394	80.58	434,648.52
CBRE GROUP INC - A	13,200	106.68	1,408,176.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	5.69	279,948.00
ZILLOW GROUP INC - A	2,710	66.17	179,320.70
ZILLOW GROUP INC - C	5,760	66.05	380,448.00

ACCENTURE PLC-CL A	24,588	368.46	9,059,694.48
ADOBE INC	18,484	662.72	12,249,716.48
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,350	107.29	681,291.50
ANSYS INC	3,480	406.69	1,415,281.20
AUTODESK INC	8,570	324.52	2,781,136.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,491	229.60	3,786,333.60
AVALARA INC	3,310	170.01	562,733.10
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,340	58.63	371,714.20
BLACK KNIGHT INC	6,530	70.29	458,993.70
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,630	173.81	804,740.30
CADENCE DESIGN SYS INC	10,900	178.00	1,940,200.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,570	123.47	687,727.90
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,320	116.64	503,884.80
CITRIX SYSTEMS INC	5,028	89.20	448,497.60
CLOUDFLARE INC-CLASS A	8,850	197.26	1,745,751.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,848	79.91	1,665,963.68
COUPA SOFTWARE INC	2,800	233.00	652,400.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,170	273.43	1,960,493.10
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,400	194.21	271,894.00
DATADOG INC-CLASS A	7,240	185.51	1,343,092.40
DOCUSIGN INC	7,340	267.49	1,963,376.60
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	27.81	297,845.10
DYNATRACE INC	6,630	76.30	505,869.00
EPAM SYSTEMS INC	2,205	705.06	1,554,657.30
FAIR ISAAC CORP	1,055	380.20	401,111.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,008	113.66	2,728,749.28
FISERV INC	23,614	100.36	2,369,901.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,040	244.76	744,070.40
FORTINET INC	5,470	341.19	1,866,309.30
GARTNER INC	3,240	331.46	1,073,930.40
GLOBAL PAYMENTS INC	11,719	136.75	1,602,573.25
GODADDY INC-CLASS A	7,040	72.78	512,371.20
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	125.67	360,672.90
HUBSPOT INC	1,725	802.46	1,384,243.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,692	123.61	4,288,278.12

INTUIT INC	10,616	614.99	6,528,733.84
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	158.35	449,714.00
MASTERCARD INC	34,155	348.79	11,912,922.45
MICROSOFT CORP	276,814	336.06	93,026,112.84
MONGODB INC	2,200	555.58	1,222,276.00
NORTONLIFELOCK INC	22,205	24.77	550,017.85
OKTA INC	4,990	254.89	1,271,901.10
ORACLE CORP	72,853	94.95	6,917,392.35
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	59,450	26.00	1,545,700.00
PALO ALTO NETWORKS INC	3,770	493.78	1,861,550.60
PAYCHEX INC	12,572	124.63	1,566,848.36
PAYCOM SOFTWARE INC	1,995	504.40	1,006,278.00
PAYPAL HOLDINGS INC	43,157	225.78	9,743,987.46
PTC INC	4,690	125.94	590,658.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,220	234.10	753,802.00
SALESFORCE.COM INC	37,556	307.25	11,539,081.00
SERVICENOW INC	7,700	692.01	5,328,477.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,290	364.80	2,659,392.00
SPLUNK INC	6,310	166.07	1,047,901.70
SQUARE INC - A	15,200	237.38	3,608,176.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	77.82	659,135.40
SYNOPSYS INC	5,817	340.75	1,982,142.75
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,150	68.55	1,175,632.50
TWILIO INC - A	6,275	310.60	1,949,015.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,540	533.10	820,974.00
UNITY SOFTWARE INC	1,950	151.96	296,322.00
VERISIGN INC	3,900	232.66	907,374.00
VISA INC-CLASS A SHARES	65,352	216.67	14,159,817.84
VMWARE INC-CLASS A	7,697	124.55	958,661.35
WESTERN UNION CO	14,561	18.11	263,699.71
WIX.COM LTD	2,280	194.29	442,981.20
WORKDAY INC-CLASS A	7,460	289.92	2,162,803.20
ZENDESK INC	4,550	101.07	459,868.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,180	264.70	2,165,246.00
ZSCALER INC	3,120	338.49	1,056,088.80

AMPHENOL CORP-CL A	23,110	81.44	1,882,078.40
APPLE INC	645,658	151.28	97,675,142.24
ARISTA NETWORKS INC	2,180	530.54	1,156,577.20
ARROW ELECTRONICS INC	2,750	122.19	336,022.50
CDW CORP/DE	5,590	187.07	1,045,721.30
CISCO SYSTEMS INC	162,890	57.07	9,296,132.30
COGNEX CORP	7,020	78.96	554,299.20
CORNING INC	32,828	38.34	1,258,625.52
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	56.36	573,293.92
F5 NETWORKS INC	2,385	221.68	528,706.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,655	15.46	783,126.30
HP INC	47,315	31.95	1,511,714.25
IPG PHOTONICS CORP	1,310	171.36	224,481.60
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	31.29	396,225.27
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,230	183.68	1,328,006.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,675	247.44	1,651,662.00
NETAPP INC	8,146	91.05	741,693.30
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,924	96.75	766,647.00
TE CONNECTIVITY LTD	12,555	158.80	1,993,734.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	446.35	781,112.50
TRIMBLE INC	8,960	86.38	773,964.80
WESTERN DIGITAL CORP	12,428	56.18	698,205.04
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,175	607.50	1,321,312.50
AT&T INC	275,687	25.10	6,919,743.70
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,285	28.44	150,305.40
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,241	28.38	432,539.58
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	14.11	485,186.46
T-MOBILE US INC	24,149	122.67	2,962,357.83
VERIZON COMMUNICATIONS INC	159,457	52.24	8,330,033.68
AES CORP	27,718	24.99	692,672.82
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	56.42	466,029.20
AMEREN CORPORATION	10,942	85.50	935,541.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,868	85.04	1,689,574.72
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	169.66	1,137,570.30
ATMOS ENERGY CORP	4,880	93.99	458,671.20

CENTERPOINT ENERGY INC	22,262	26.67	593,727.54
CMS ENERGY CORP	12,240	60.52	740,764.80
CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	78.21	1,008,596.16
DOMINION ENERGY INC	31,511	76.53	2,411,536.83
DTE ENERGY COMPANY	8,018	114.13	915,094.34
DUKE ENERGY CORP	29,786	101.68	3,028,640.48
EDISON INTERNATIONAL	14,869	64.05	952,359.45
ENERGY CORP	7,127	104.25	742,989.75
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	47.63	437,719.70
EVERGY INC	8,720	64.88	565,753.60
EVERSOURCE ENERGY	13,430	84.41	1,133,626.30
EXELON CORP	38,386	54.14	2,078,218.04
FIRSTENERGY CORP	22,345	39.07	873,019.15
NEXTERA ENERGY INC	75,890	85.53	6,490,871.70
NISOURCE INC	15,050	25.31	380,915.50
NRG ENERGY INC	10,000	36.28	362,800.00
P G & E CORP	60,460	11.65	704,359.00
PINNACLE WEST CAPITAL	4,429	64.56	285,936.24
PPL CORP	29,828	28.72	856,660.16
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,888	64.19	1,212,420.72
SEMPRA ENERGY	12,237	127.35	1,558,381.95
SOUTHERN CO	40,925	63.10	2,582,367.50
UGI CORP	7,720	44.64	344,620.80
VISTRA CORP	18,240	20.50	373,920.00
WEC ENERGY GROUP INC	12,040	90.87	1,094,074.80
XCEL ENERGY INC	20,004	63.80	1,276,255.20
ADVANCED MICRO DEVICES	47,180	136.34	6,432,521.20
ANALOG DEVICES INC	20,847	184.18	3,839,600.46
APPLIED MATERIALS INC	35,293	153.29	5,410,063.97
BROADCOM INC	15,765	558.92	8,811,373.80
ENPHASE ENERGY INC	4,930	237.90	1,172,847.00
INTEL CORP	156,092	50.92	7,948,204.64
KLA CORP	6,039	416.73	2,516,632.47
LAM RESEARCH CORP	5,527	610.77	3,375,725.79
MARVELL TECHNOLOGY INC	30,984	71.86	2,226,510.24

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,668	85.76	1,772,487.68	
	MICRON TECHNOLOGY INC	43,327	72.92	3,159,404.84	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,825	546.28	996,961.00	
	NVIDIA CORP	96,460	297.52	28,698,779.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,667	224.25	2,392,074.75	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,640	59.13	983,923.20	
	QORVO INC	4,600	156.07	717,922.00	
	QUALCOMM INC	43,822	163.03	7,144,300.66	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,210	164.06	1,018,812.60	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	344.07	689,860.35	
	TERADYNE INC	6,540	144.22	943,198.80	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	35,902	193.40	6,943,446.80	
	XILINX INC	9,455	198.51	1,876,912.05	
米ドル小計		12,210,578		1,612,945,329.70	(183,262,848,360)
加ドル	CAMECO CORP	14,272	33.63	479,967.36	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	47,004	54.21	2,548,086.84	
	CENOVUS ENERGY INC	55,183	15.59	860,302.97	
	ENBRIDGE INC	78,467	53.88	4,227,801.96	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	42.17	405,759.74	
	KEYERA CORP	8,460	30.37	256,930.20	
	PARKLAND CORP	6,170	35.67	220,083.90	
	PEMBINA PIPELINE CORP	22,402	42.09	942,900.18	
	SUNCOR ENERGY INC	59,939	32.97	1,976,188.83	
	TC ENERGY CORP	38,733	64.05	2,480,848.65	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	9,775	66.69	651,894.75	
	B2GOLD CORP	42,000	5.43	228,060.00	
	BARRICK GOLD CORP	66,724	24.38	1,626,731.12	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	69.75	401,062.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	27.65	626,272.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,635	177.88	1,358,113.80	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	21,000	9.69	203,490.00	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	7.73	355,773.25	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	10,600	52.53	556,818.00	
	LUNDIN MINING CORP	21,150	10.99	232,438.50	

NUTRIEN LTD	21,648	83.32	1,803,711.36
PAN AMERICAN SILVER CORP	8,780	32.36	284,120.80
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	33.71	605,937.25
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,700	104.15	385,355.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18,535	51.05	946,211.75
YAMANA GOLD INC	32,800	5.17	169,576.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	8,330	22.10	184,093.00
CAE INC	10,265	41.60	427,024.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,710	112.18	416,187.80
WSP GLOBAL INC	4,030	170.46	686,953.80
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	5,730	49.28	282,374.40
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	92.67	374,386.80
THOMSON REUTERS CORP	6,546	146.92	961,738.32
AIR CANADA	7,190	26.34	189,384.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,538	165.44	4,555,886.72
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,835	95.47	2,466,467.45
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,858	103.56	1,228,014.48
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,420	50.22	322,412.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,318	73.93	910,669.74
QUEBECOR INC -CL B	6,110	30.54	186,599.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	35.87	626,469.55
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	184.25	362,972.50
DOLLARAMA INC	11,780	57.51	677,467.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	32,680	49.43	1,615,372.40
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	38.62	268,409.00
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	95.37	525,393.33
METRO INC	7,760	64.14	497,726.40
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	137.33	461,154.14
SAPUTO INC	9,620	31.60	303,992.00
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	34.83	441,783.72
CANOPY GROWTH CORP	9,140	14.60	133,444.00
BANK OF MONTREAL	24,181	137.69	3,329,481.89
BANK OF NOVA SCOTIA	46,939	82.88	3,890,304.32
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	17,915	148.81	2,665,931.15
NATIONAL BANK OF CANADA	12,680	104.17	1,320,875.60

ROYAL BANK OF CANADA	55,479	132.07	7,327,111.53	
TORONTO-DOMINION BANK	70,510	91.45	6,448,139.50	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	49,649	76.62	3,804,106.38	
IGM FINANCIAL INC	3,335	51.06	170,285.10	
ONEX CORPORATION	2,765	94.86	262,287.90	
TMX GROUP LTD	1,810	137.71	249,255.10	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,110	538.47	597,701.70	
GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	38.07	338,975.28	
IA FINANCIAL CORP INC	3,895	74.31	289,437.45	
INTACT FINANCIAL CORP	6,995	166.75	1,166,416.25	
MANULIFE FINANCIAL CORP	79,501	24.37	1,937,439.37	
POWER CORP OF CANADA	23,289	42.21	983,028.69	
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,214	70.71	1,641,461.94	
FIRSTSERVICE CORP	1,770	244.11	432,074.70	
BLACKBERRY LTD	22,208	13.75	305,360.00	
CGI INC	8,930	113.59	1,014,358.70	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	780	2,157.87	1,683,138.60	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	90.92	399,138.80	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	136.97	308,182.50	
OPEN TEXT CORP	10,940	64.23	702,676.20	
SHOPIFY INC - CLASS-A	4,380	1,902.57	8,333,256.60	
BCE INC	3,000	63.27	189,810.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,575	58.95	682,346.25	
TELUS CORP	12,662	28.95	366,564.90	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	17.77	481,211.60	
ALTAGAS LTD	9,000	25.61	230,490.00	
ATCO LTD -CLASS I	2,300	41.17	94,691.00	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	51.53	280,580.85	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.36	161,241.60	
EMERA INC	7,570	58.56	443,299.20	
FORTIS INC	19,615	56.11	1,100,597.65	
HYDRO ONE LTD	11,790	30.45	359,005.50	
NORTHLAND POWER INC	8,600	39.29	337,894.00	
加ドル小計	1,566,851		98,268,972.76 (8,962,130,315)	

ユーロ	ENI SPA	96,856	12.67	1,227,359.23	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	9.08	193,358.60	
	NESTE OYJ	16,390	49.91	818,024.90	
	OMV AG	5,480	53.98	295,810.40	
	REPSOL SA	57,649	10.81	623,300.98	
	TENARIS SA	19,915	10.62	211,497.30	
	TOTALENERGIES SE	96,487	43.41	4,188,500.67	
	VOPAK	2,510	34.14	85,691.40	
	AIR LIQUIDE SA	18,340	149.94	2,749,899.60	
	AKZO NOBEL	6,827	101.15	690,551.05	
	ARCELORMITTAL	28,822	27.99	806,871.89	
	ARKEMA	2,205	116.30	256,441.50	
	BASF SE	35,355	62.08	2,194,838.40	
	COVESTRO AG	7,410	54.50	403,845.00	
	CRH PLC	29,850	42.93	1,281,460.50	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,540	28.08	239,803.20	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	41.10	119,190.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	64.80	370,332.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	6,552	186.25	1,220,310.00	
	LANXESS AG	3,115	54.66	170,265.90	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,460	45.07	381,292.20	
	SOLVAY SA	3,231	104.70	338,285.70	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,305	14.46	279,150.30	
	SYMRISE AG	5,370	121.55	652,723.50	
	UMICORE	7,960	50.02	398,159.20	
	UPM-KYMMENE OYJ	19,568	30.92	605,042.56	
	VOESTALPINE AG	4,249	32.68	138,857.32	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	23.31	244,428.66	
	AIRBUS GROUP SE	22,688	113.90	2,584,163.20	
	ALSTOM	11,635	31.38	365,106.30	
	BOUYGUES SA	9,460	35.59	336,681.40	
	BRENTAG SE	6,075	80.16	486,972.00	
	CNH INDUSTRIAL NV	42,250	15.35	648,537.50	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,596	61.07	1,196,727.72	
	DASSAULT AVIATION SA	900	96.25	86,625.00	

EIFFAGE	3,250	92.64	301,080.00
FERROVIAL SA	18,485	27.40	506,489.00
FERROVIAL SA-RTS	18,485	0.31	5,804.29
GEA GROUP AG	6,680	42.53	284,100.40
KINGSPAN GROUP PLC	6,260	101.75	636,955.00
KION GROUP AG	2,284	95.24	217,528.16
KNORR-BREMSE AG	2,970	93.50	277,695.00
KONE OYJ-B	13,654	60.48	825,793.92
LEGRAND SA	10,528	94.58	995,738.24
MTU AERO ENGINES AG	2,020	203.30	410,666.00
PRYSMIAN SPA	9,565	33.83	323,583.95
RATIONAL AG	230	883.00	203,090.00
SAFRAN SA	13,550	120.36	1,630,878.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,878	153.20	3,198,509.60
SIEMENS AG-REG	29,506	145.58	4,295,483.48
SIEMENS ENERGY AG	15,843	22.82	361,537.26
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	10,210	18.78	191,794.85
THALES SA	3,745	84.12	315,029.40
VINCI SA	20,460	95.56	1,955,157.60
WARTSILA OYJ ABP	21,180	12.55	265,914.90
BUREAU VERITAS SA	10,920	29.21	318,973.20
RANDSTAD NV	4,965	63.78	316,667.70
TELEPERFORMANCE	2,420	346.10	837,562.00
WOLTERS KLUWER	10,377	94.20	977,513.40
ADP	1,090	124.20	135,378.00
AENA SA	2,870	151.25	434,087.50
ATLANTIA SPA	18,740	17.39	325,888.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.92	165,392.88
DEUTSCHE POST AG-REG	38,353	55.66	2,134,727.98
GETLINK	14,730	13.90	204,747.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,235	91.85	1,215,634.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	76.15	130,978.00
CONTINENTAL AG	4,385	101.88	446,743.80
DAIMLER AG	33,212	87.59	2,909,039.08
FAURECIA	4,256	45.45	193,435.20

FERRARI NV	4,944	228.80	1,131,187.20
MICHELIN (CGDE)-B	6,669	136.80	912,319.20
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	88.78	503,382.60
RENAULT SA	6,837	32.54	222,475.98
STELLANTIS NV	75,346	17.71	1,334,980.42
VALEO SA	8,060	26.54	213,912.40
VOLKSWAGEN AG	1,261	300.20	378,552.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,183	192.88	1,385,457.04
ADIDAS AG	7,331	298.40	2,187,570.40
ESSILORLUXOTTICA	11,115	187.86	2,088,063.90
HERMES INTERNATIONAL	1,232	1,459.00	1,797,488.00
KERING	2,957	659.90	1,951,324.30
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,799	708.90	7,655,411.10
MONCLER SPA	8,860	67.60	598,936.00
PUMA SE	4,530	112.30	508,719.00
SEB SA	847	134.20	113,667.40
ACCOR SA	7,646	33.54	256,446.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,706	147.30	987,793.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	45.45	177,255.00
SODEXO	4,090	86.20	352,558.00
BOLLORE	33,530	5.09	170,667.70
PUBLICIS GROUPE	8,645	58.08	502,101.60
SCOUT24 SE	3,880	63.12	244,905.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	47.30	166,023.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	25.97	720,286.75
VIVENDI SE	27,730	11.11	308,080.30
DELIVERY HERO SE	6,050	107.60	650,980.00
INDITEX	42,185	32.27	1,361,309.95
JUST EAT TAKEAWAY	6,520	60.82	396,546.40
PROSUS	36,130	72.91	2,634,238.30
ZALANDO SE	8,260	75.96	627,429.60
CARREFOUR SA	24,723	15.43	381,475.89
COLRUYT SA	2,305	42.98	99,068.90
HELLOFRESH SE	6,070	83.74	508,301.80
JERONIMO MARTINS	9,035	19.89	179,706.15

KESKO OYJ-B SHS	10,930	29.26	319,811.80
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	42,228	28.60	1,207,720.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	29,501	52.45	1,547,327.45
DANONE	25,254	57.35	1,448,316.90
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,980	12.79	293,914.20
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	81.20	326,830.00
HEINEKEN NV	10,453	97.40	1,018,122.20
JDE PEET'S NV	2,400	25.06	60,144.00
KERRY GROUP PLC-A	5,880	113.50	667,380.00
PERNOD-RICARD SA	8,076	204.80	1,653,964.80
REMY COINTREAU	810	177.70	143,937.00
BEIERSDORF AG	3,805	93.20	354,626.00
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	74.85	336,076.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	80.80	518,170.40
L'OREAL	9,916	412.80	4,093,324.80
AMPLIFON SPA	5,620	45.76	257,171.20
BIOMERIEUX	1,310	104.60	137,026.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	177.90	286,419.00
DIASORIN SPA	930	182.50	169,725.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,273	61.34	507,465.82
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,655	39.70	661,203.50
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,020	41.30	1,487,626.00
ORPEA	1,790	94.00	168,260.00
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,080	544.20	587,736.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	60.22	676,270.60
ARGENX SE	1,840	275.90	507,656.00
BAYER AG-REG	36,384	49.72	1,809,194.40
EUROFINS SCIENTIFIC	5,460	99.86	545,235.60
GRIFOLS SA	9,910	18.50	183,335.00
IPSEN	1,350	85.92	115,992.00
MERCK KGAA	5,130	202.30	1,037,799.00
ORION OYJ-CLASS B	4,010	38.07	152,660.70
QIAGEN N.V.	9,614	46.53	447,339.42
RECORDATI SPA	3,920	56.54	221,636.80
SANOFI	43,776	88.46	3,872,424.96

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,160	455.00	527,800.00
UCB SA	4,928	104.45	514,729.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,360	12.84	171,542.40
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,873	6.02	1,572,020.69
BANCO SANTANDER SA	682,749	3.28	2,242,147.71
BNP PARIBAS	43,402	59.51	2,582,853.02
CAIXABANK S.A	163,050	2.50	408,603.30
COMMERZBANK AG	38,844	6.71	260,876.30
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	13.24	539,750.01
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	40.69	466,226.02
FINECOBANK SPA	26,120	17.15	447,958.00
ING GROEP NV-CVA	151,675	13.31	2,019,400.95
INTESA SANPAOLO	643,893	2.48	1,599,108.26
KBC GROEP NV	9,719	84.68	823,004.92
MEDIOBANCA SPA	20,050	10.81	216,840.75
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,370	28.94	155,407.80
SOCIETE GENERALE	31,389	29.99	941,513.05
UNICREDIT SPA	83,846	11.51	965,738.22
AMUNDI SA	2,140	78.55	168,097.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,855	11.15	913,010.67
DEUTSCHE BOERSE AG	7,250	148.45	1,076,262.50
EURAZEO SE	1,877	79.45	149,127.65
EXOR NV	3,424	84.92	290,766.08
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	103.70	421,229.40
SOFINA	480	395.00	189,600.00
WENDEL	1,000	116.40	116,400.00
AEGON NV	77,949	4.33	337,597.11
AGEAS	6,794	42.69	290,035.86
ALLIANZ SE-REG	15,858	203.50	3,227,103.00
ASSICURAZIONI GENERALI	38,748	19.10	740,280.54
AXA SA	74,212	25.50	1,892,406.00
CNP ASSURANCES	6,040	21.60	130,464.00
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	163.90	372,872.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,566	259.40	1,443,820.40
NN GROUP NV	9,940	46.72	464,396.80

POSTE ITALIANE SPA	19,560	12.50	244,500.00
SAMPO OYJ-A SHS	20,209	45.00	909,405.00
SCOR SE	7,452	28.80	214,617.60
AROUNDTOWN SA	33,520	6.31	211,511.20
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	130.65	322,705.50
VONOVIA SE	22,148	51.86	1,148,595.28
ADYEN NV	775	2,745.00	2,127,375.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	61.94	1,058,554.60
ATOS SE	3,890	43.86	170,615.40
BECHTLE AG	3,690	67.38	248,632.20
CAP GEMINI SA	6,109	210.70	1,287,166.30
DASSAULT SYSTEMES SE	25,890	54.41	1,408,674.90
EDENRED	9,626	46.30	445,683.80
NEMETSCHKE SE	1,790	110.55	197,884.50
NEXI SPA	17,180	15.24	261,909.10
SAP SE	40,272	128.98	5,194,282.56
TEAMVIEWER AG	7,050	14.12	99,546.00
WORLDLINE SA	8,950	53.34	477,393.00
NOKIA OYJ	208,086	5.01	1,043,967.46
CELLNEX TELECOM SA	20,330	52.72	1,071,797.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	129,336	16.83	2,176,983.55
ELISA OYJ	5,465	53.86	294,344.90
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.74	147,786.14
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	2.63	346,913.41
ORANGE S.A.	76,994	9.62	740,913.26
PROXIMUS	5,600	16.51	92,484.00
TELECOM ITALIA SPA	317,713	0.34	108,403.67
TELECOM ITALIA-RSP	198,057	0.35	70,983.62
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.43	79,031.98
TELEFONICA SA	202,139	3.76	761,255.47
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	34.00	136,000.00
E.ON SE	86,389	11.06	955,807.89
EDF	16,905	12.83	216,891.15
EDP RENOVAVEIS SA	10,400	22.14	230,256.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	113,771	4.75	541,436.18

	ELIA GROUP SA/NV	960	101.10	97,056.00	
	ENAGAS SA	8,240	20.09	165,541.60	
	ENDESA SA	10,710	20.00	214,200.00	
	ENEL SPA	315,597	7.29	2,301,964.51	
	ENGIE	70,164	12.71	891,784.44	
	FORTUM OYJ	16,415	25.94	425,805.10	
	IBERDROLA SA	228,062	10.27	2,343,337.05	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	9,072	23.38	212,103.36	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	18.17	349,323.50	
	RWE AG	24,615	32.48	799,495.20	
	SNAM SPA	79,380	5.10	404,838.00	
	SUEZ	13,289	19.68	261,593.96	
	TERNA SPA	49,057	6.67	327,602.64	
	UNIPER SE	3,530	38.61	136,293.30	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,600	29.60	728,160.00	
	VERBUND AG	2,780	86.90	241,582.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,840	420.10	772,984.00	
	ASML HOLDING NV	16,252	737.10	11,979,349.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	50,535	42.86	2,166,182.77	
	STMICROELECTRONICS NV	26,093	44.04	1,149,135.72	
ユーロ小計		7,268,352		196,061,800.87 (25,748,796,308)	
英ポンド	BP PLC	778,518	3.45	2,689,001.17	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	159,248	16.83	2,680,780.83	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	144,199	16.83	2,426,869.17	
	ANGLO AMERICAN PLC	50,684	27.27	1,382,406.10	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	13.67	195,962.75	
	BHP GROUP PLC	81,061	19.08	1,547,130.24	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	93.94	518,642.74	
	EVRAZ PLC	21,700	6.01	130,417.00	
	GLENCORE PLC	385,213	3.53	1,361,342.74	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,589	27.18	179,089.02	
	MONDI PLC	18,370	18.27	335,619.90	
	RIO TINTO PLC	43,185	44.24	1,910,720.32	
	ASHTREAD GROUP PLC	17,360	62.58	1,086,388.80	

BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	5.74	694,626.10
BUNZL PLC	13,836	27.32	377,999.52
DCC PLC	3,820	62.68	239,437.60
FERGUSON PLC	8,792	113.15	994,814.80
MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.67	273,059.58
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	1.42	458,881.71
SMITHS GROUP PLC	15,443	14.35	221,607.05
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	162.75	423,150.00
EXPERIAN PLC	35,428	34.59	1,225,454.52
INTERTEK GROUP PLC	6,025	50.82	306,190.50
RELX PLC	74,005	23.50	1,739,117.50
RENTOKIL INITIAL PLC	78,900	6.08	480,185.40
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	6.56	267,204.64
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	42.91	193,738.65
BURBERRY GROUP PLC	14,144	20.08	284,011.52
PERSIMMON PLC	13,570	26.83	364,083.10
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.55	192,711.77
COMPASS GROUP PLC	69,398	16.02	1,111,755.96
ENTAIN PLC	21,400	20.48	438,272.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,893	53.36	421,170.48
WHITBREAD PLC	8,260	34.26	282,987.60
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.10	222,746.88
INFORMA PLC	56,580	5.48	310,284.72
PEARSON PLC	26,259	5.95	156,241.05
WPP PLC	50,104	10.72	537,365.40
JD SPORTS FASHION PLC	19,470	11.21	218,258.70
KINGFISHER PLC	88,337	3.32	293,720.52
NEXT PLC	5,467	81.22	444,029.74
OCADO GROUP PLC	20,060	17.25	346,135.30
SAINSBURY (J) PLC	59,501	2.84	169,161.34
TESCO PLC	304,518	2.75	838,490.31
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,945	18.86	281,937.42
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,407	25.44	2,147,314.08
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	25.82	198,555.80
DIAGEO PLC	90,042	37.78	3,402,236.97

IMPERIAL BRANDS PLC	37,492	15.65	586,937.26
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,365	60.30	1,710,409.50
UNILEVER PLC	100,962	39.00	3,937,518.00
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	35,006	13.69	479,232.14
ASTRAZENECA PLC	59,792	93.09	5,566,037.28
GLAXOSMITHKLINE PLC	193,531	15.76	3,050,048.56
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	23.91	183,867.90
BARCLAYS PLC	668,451	1.92	1,285,966.03
HSBC HOLDINGS PLC	787,061	4.37	3,441,424.22
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,737,436	0.49	1,344,217.94
NATWEST GROUP PLC	207,830	2.16	450,575.44
STANDARD CHARTERED PLC	109,730	4.58	503,112.05
3I GROUP PLC	36,819	13.72	505,340.77
ABRDN PLC	88,515	2.55	226,332.85
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	14.93	194,388.60
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,727	71.18	905,907.86
M&G PLC	99,522	2.01	200,636.35
SCHRODERS PLC	4,131	36.67	151,483.77
ST JAMES'S PLACE PLC	19,260	16.13	310,760.10
ADMIRAL GROUP PLC	6,505	29.02	188,775.10
AVIVA PLC	158,565	4.04	640,602.60
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	51,053	2.90	148,053.70
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	237,501	2.93	695,877.93
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	6.62	164,291.82
PRUDENTIAL PLC	102,232	14.75	1,508,433.16
AVEVA GROUP PLC	4,515	35.40	159,831.00
SAGE GROUP PLC/THE	42,810	7.44	318,592.02
HALMA PLC	14,690	29.90	439,231.00
BT GROUP PLC	355,852	1.60	569,363.20
VODAFONE GROUP PLC	1,097,428	1.11	1,222,095.82
NATIONAL GRID PLC	140,868	9.50	1,338,246.00
SEVERN TRENT PLC	11,503	27.71	318,748.13
SSE PLC	39,837	16.49	657,111.31
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.65	278,018.25









TRANSURBAN GROUP	127,076	13.74	1,746,024.24
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,290	48.28	1,221,001.20
CROWN RESORTS LTD	11,395	10.32	117,596.40
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	116.94	249,082.20
TABCORP HOLDINGS LTD	70,974	5.24	371,903.76
REA GROUP LTD	1,820	176.81	321,794.20
SEEK LTD	10,700	34.41	368,187.00
WESFARMERS LTD	45,475	60.33	2,743,506.75
COLES GROUP LTD	52,085	17.80	927,113.00
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	7.22	364,335.64
WOOLWORTHS GROUP LTD	50,462	39.63	1,999,809.06
TREASURY WINE ESTATES LTD	25,746	11.67	300,455.82
COCHLEAR LTD	2,917	235.05	685,640.85
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,305	73.42	462,913.10
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	40.91	722,470.60
CSL LTD	17,552	314.48	5,519,752.96
AUST AND NZ BANKING GROUP	105,769	28.80	3,046,147.20
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	68,907	109.71	7,559,786.97
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	129,523	28.93	3,747,100.39
WESTPAC BANKING CORP	144,571	22.55	3,260,076.05
ASX LTD	7,925	91.67	726,484.75
MACQUARIE GROUP LTD	13,374	202.42	2,707,165.08
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,820	35.19	169,615.80
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.63	440,428.75
MEDIBANK PRIVATE LTD	92,560	3.47	321,183.20
QBE INSURANCE GROUP LTD	45,050	12.04	542,402.00
SUNCORP GROUP LTD	57,276	11.49	658,101.24
AFTERPAY LTD	8,240	117.50	968,200.00
COMPUTERSHARE LTD	15,880	19.05	302,514.00
WISETECH GLOBAL LTD	5,130	54.77	280,970.10
XERO LTD	5,480	154.47	846,495.60
TELSTRA CORPORATION LTD	182,084	3.98	724,694.32
AGL ENERGY LTD	21,261	5.60	119,061.60
APA GROUP	45,818	8.84	405,031.12
AUSNET SERVICES	72,810	2.57	187,121.70

	ORIGIN ENERGY LTD	53,520	5.06	270,811.20	
豪ドル小計		2,717,046		59,293,673.92	(4,980,668,609)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	8.11	458,336.65	
	A2 MILK CO LTD	35,120	6.67	234,250.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,200	32.46	688,152.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,800	14.37	270,156.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.55	348,425.35	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.05	123,420.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	4.87	223,922.60	
ニュージーランドドル小計		274,592		2,346,663.00	(189,563,437)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,208	51.95	5,777,255.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	55,000	159.10	8,750,500.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	82,000	20.05	1,644,100.00	
	MTR CORP	57,500	42.95	2,469,625.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	26.30	1,367,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	92,000	41.95	3,859,400.00	
	SANDS CHINA LTD	111,400	17.12	1,907,168.00	
	SJM HOLDINGS LTD	91,000	5.64	513,240.00	
	WYNN MACAU LTD	63,000	6.80	428,400.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	21.05	1,429,295.00	
	WH GROUP LTD	339,394	5.47	1,856,485.18	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	24.45	3,667,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	147.70	4,298,070.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,300	466.00	21,575,800.00	
	AIA GROUP LTD	466,190	86.15	40,162,268.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	47.80	3,682,416.40	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	25.90	1,963,220.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	17.88	1,394,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	32.80	1,899,152.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	33.55	2,437,944.30	
SINO LAND CO	143,050	9.92	1,419,056.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,980	103.30	5,472,834.00		
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	48.50	849,574.50		



イスラエルシケル小計			(307,862,561)
合 計	42,410,794		250,167,589,782 (250,167,589,782)

(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	310,288.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	1,080,592.80	
		AMERICAN TOWER CORP	17,649	4,903,421.67	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	529,830.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	1,278,390.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,977	698,771.07	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	651,975.20	
		CROWN CASTLE INTL CORP	16,670	3,002,767.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,095	1,724,939.65	
		DUKE REALTY CORPORATION	14,585	817,343.40	
		EQUINIX INC	3,463	2,707,788.96	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	534,177.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	14,290	1,206,933.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	835,958.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	994,406.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	697,640.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	499,278.23	
		INVITATION HOMES INC	22,810	931,104.20	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	558,696.25	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	423,909.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	859,987.50	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	334,018.80	
		PROLOGIS INC	28,678	4,206,775.82	
		PUBLIC STORAGE	6,119	1,975,702.72	
REALTY INCOME CORP	20,861	1,497,193.97			
REGENCY CENTERS CORP	6,695	508,485.25			

		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,250	1,462,892.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,974	2,212,067.00	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	852,873.60	
		UDR INC	9,590	525,627.90	
		VENTAS INC	14,825	800,253.50	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	634,651.60	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	305,486.09	
		WELLTOWER INC	16,720	1,414,512.00	
		WEYERHAEUSER CO	28,918	1,108,426.94	
		WP CAREY INC	6,460	508,014.40	
米ドル小計			498,564	43,595,180.52	(4,953,284,410)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	171,528.00	
加ドル小計			2,800	171,528.00	(15,643,353)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	148,417.50	
		GECINA SA	1,950	243,360.00	
		KLEPIERRE	6,642	148,382.28	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,360	373,645.60	
ユーロ小計			15,877	913,805.38	(120,010,060)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	191,487.61	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	188,444.67	
		SEGRO PLC	45,033	598,488.57	
英ポンド小計			108,638	978,420.85	(149,884,290)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	35,587	395,727.44	
		GOODMAN GROUP	63,582	1,509,436.68	
		GPT GROUP	71,335	371,655.35	
		LENDLEASE GROUP	28,927	321,378.97	
		MIRVAC GROUP	135,075	384,963.75	
		SCENTRE GROUP	198,271	610,674.68	
		STOCKLAND	96,900	450,585.00	
		VICINITY CENTRES	178,802	315,585.53	
			808,479	4,360,007.40	

豪ドル小計				(366,240,621)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	87,500	6,011,250.00	
香港ドル小計			87,500	6,011,250.00	(87,764,250)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	363,840.59	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	452,640.96	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	155,230.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	278,798.00	
シンガポールドル小計			537,398	1,250,509.55	(105,217,873)
合計				5,798,044,857	(5,798,044,857)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 599銘柄	97.4%		71.8%
	投資証券 36銘柄		2.6%	1.9%
加ドル	株式 88銘柄	99.8%		3.5%
	投資証券 1銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 230銘柄	99.5%		10.1%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 83銘柄	98.6%		4.2%
	投資証券 3銘柄		1.4%	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 41銘柄	100.0%		1.1%
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 56銘柄	93.2%		1.9%
	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	95.8%		0.8%

	投資証券	1銘柄		4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.1%		0.3%
	投資証券	4銘柄		12.9%	0.0%
イスラエルシェケル	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。

## 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11月 6日現在	2021年11月 8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,551,647	150,138,514
国債証券	33,376,926,138	37,223,310,744
地方債証券	3,356,957,000	4,809,488,005
特殊債券	4,509,028,000	5,299,735,290
社債券	2,433,657,584	1,415,554,089
未収利息	94,079,545	98,136,584
前払費用	1,010,091	3,351,344
流動資産合計	43,857,210,005	48,999,714,570
資産合計	43,857,210,005	48,999,714,570
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	65,496,104	38,332,570
未払利息	59	80
流動負債合計	65,496,163	38,332,650
負債合計	65,496,163	38,332,650
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	30,950,687,612	34,595,028,808
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,841,026,230	14,366,353,112
元本等合計	43,791,713,842	48,961,381,920
純資産合計	43,791,713,842	48,961,381,920
負債純資産合計	43,857,210,005	48,999,714,570

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
1.	期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日
	期首元本額	29,082,509,839円	30,950,687,612円
	期首からの追加設定元本額	6,157,737,938円	5,221,516,392円
	期首からの一部解約元本額	4,289,560,165円	1,577,175,196円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	3,316,182,665円	4,213,202,449円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,937,621,572円	3,863,811,278円
	DCインデックスバランス（株式60）	2,060,335,630円	2,816,463,929円
	DCインデックスバランス（株式80）	315,604,302円	464,079,158円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,134,845,421円	2,234,982,215円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,488,595,537円	4,122,797,086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	5,032,467円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	24,342,419円	30,008,281円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	96,411,222円	99,004,620円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	252,398,632円	244,363,632円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,090,395,680円	4,024,703,763円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,382,028,729円	1,462,295,657円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,312,918,382円	1,449,082,259円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	714,291,650円	816,378,095円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	101,570,081円	117,292,874円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,809,834,414円	6,587,744,524円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	315,718,552円	340,450,459円
計	30,950,687,612円	34,595,028,808円
2. 受益権の総数	30,950,687,612口	34,595,028,808口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日	自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8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	(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

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

（有価証券に関する注記）

（2020年11月 6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	52,169,736
地方債証券	112,000
特殊債券	247,000
社債券	156,854
合計	51,653,882

（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（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11月 6日現在		2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	1.4149円	1口当たり純資産額	1.4153円
(1万口当たり純資産額)	(14,149円)	(1万口当たり純資産額)	(14,153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	100,857,400	
	第2回利付国債（40年）	140,000,000	195,396,600	
	第3回利付国債（40年）	85,000,000	118,968,550	
	第4回利付国債（40年）	95,000,000	133,776,150	
	第5回利付国債（40年）	75,000,000	102,096,000	
	第6回利付国債（40年）	110,000,000	147,741,000	
	第7回利付国債（40年）	80,000,000	103,425,600	
	第8回利付国債（40年）	95,000,000	115,005,100	
	第9回利付国債（40年）	130,000,000	118,378,000	
	第10回利付国債（40年）	125,000,000	133,027,500	
	第11回利付国債（40年）	140,000,000	144,475,800	
	第12回利付国債（40年）	175,000,000	163,184,000	
	第13回利付国債（40年）	180,000,000	167,342,400	
	第14回利付国債（40年）	90,000,000	89,447,400	
	第323回利付国債（10年）	45,000,000	45,279,210	
	第325回利付国債（10年）	210,000,000	211,661,100	
	第326回利付国債（10年）	30,000,000	30,270,600	
	第327回利付国債（10年）	65,000,000	65,658,450	
	第328回利付国債（10年）	115,000,000	116,110,900	
	第329回利付国債（10年）	230,000,000	233,376,400	
	第330回利付国債（10年）	210,000,000	213,586,800	
	第331回利付国債（10年）	80,000,000	81,067,200	
	第333回利付国債（10年）	210,000,000	213,551,100	

















	2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
前払費用	25,312,852	28,148,877
流動資産合計	152,330,655,791	160,727,175,346
資産合計	152,330,655,791	160,727,175,346
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,791	1,200
未払金	31,167,517	-
未払解約金	83,200,031	100,530,054
未払利息	56	18
流動負債合計	114,392,395	100,531,272
負債合計	114,392,395	100,531,272
純資産の部		
元本等		
元本	62,261,620,781	61,717,731,067
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	89,954,642,615	98,908,913,007
元本等合計	152,216,263,396	160,626,644,074
純資産合計	152,216,263,396	160,626,644,074
負債純資産合計	152,330,655,791	160,727,175,346

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
1. 期首	2019年11月 7日	2020年11月 7日



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

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年11月 6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	865,881,536
合計	865,881,536

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(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11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	15,530,169	-	15,554,960	24,791
	ユーロ	15,530,169	-	15,554,960	24,791
	合計	15,530,169	-	15,554,960	24,791

(2021年11月 8日現在)

(単位：円)

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

















BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	535,000.00	666,139.73
BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	324,873.78
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,187,000.00	2,016,327.22
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	665,000.00	1,131,023.35
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	941,100.93
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	720,000.00	904,514.81
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	598,751.36
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	722,169.27
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	555,000.00	522,370.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.45%-22/10/31	1,420,000.00	1,435,355.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,530,827.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-23/04/30	1,313,000.00	1,325,827.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-23/07/30	1,290,000.00	1,311,984.18
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,495,000.00	1,645,594.34
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,185,000.00	1,328,208.43
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,340,000.00	1,485,017.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-24/05/31	1,000,000.00	1,011,607.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,180,000.00	1,203,382.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,520,000.00	1,668,117.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,430,000.00	1,450,074.34
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,450,000.00	1,552,802.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,490,000.00	1,773,025.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,745,000.00	1,921,566.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,270,000.00	1,286,579.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,335,000.00	1,470,159.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,490,000.00	1,928,800.53
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,720,000.00	1,854,301.04
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,475,000.00	1,611,362.27
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,315,000.00	1,383,070.97



BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	848,000.00	1,363,249.04
BUNDESobligation-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,769,493.25
BUNDESobligation-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,121,966.17
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,324,022.70
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,389,311.53
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,550,000.00	1,586,750.50
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	660,000.00	677,315.10
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,644,856.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	1,955,200.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,780,561.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	1,942,866.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	911,079.35
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,301,681.94
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,875,000.00	1,982,673.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,919,073.42
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,840,915.05
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	1,740,000.00	1,850,935.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,685,000.00	2,817,604.09
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,320,000.00	2,389,122.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,125,000.00	2,220,146.87
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,130,000.00	1,595,492.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,165,000.00	2,299,989.91
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,150,000.00	1,187,953.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,600,222.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,845,000.00	1,967,216.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,320,198.13
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,757,148.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,080,000.00	1,115,647.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	2,055,000.00	2,164,465.74

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,830,000.00	1,892,095.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,280,000.00	1,999,742.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,410,000.00	1,458,002.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,700,000.00	1,755,545.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	420,000.00	435,966.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,725,629.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	2,420,000.00	2,492,953.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	80,000.00	82,242.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	412,666.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,475,000.00	2,433,882.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	1,224,277.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	1,014,855.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,951,652.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	2,218,453.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,680,000.00	3,247,996.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,631,567.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	2,325,000.00	3,707,182.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,692,000.00	4,405,388.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	2,720,754.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,330,000.00	1,314,904.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	360,000.00	360,423.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/12/15	650,000.00	655,564.78	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/09/15	1,315,000.00	1,333,164.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	298,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	1,900,000.00	2,012,272.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 23/01/15	600,000.00	604,264.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	927,580.29	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,224,002.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,025,000.00	1,101,686.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 23/06/15	1,000,000.00	1,018,577.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,854,776.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 23/08/15	1,640,000.00	1,662,863.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,310,000.00	1,382,636.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,160,000.00	1,184,863.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	1,020,590.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/15	1,110,000.00	1,118,125.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,834,965.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/04/15	1,360,000.00	1,369,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,133,211.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,360,000.00	1,432,822.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/08/15	200,000.00	201,114.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,450,000.00	1,613,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,322,973.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,080,000.00	1,169,819.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,510,335.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,804,487.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	1,175,000.00	1,241,406.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,376,174.02	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	1,071,715.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,434,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,480,000.00	1,603,741.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	1,150,000.00	1,174,288.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,730,000.00	2,066,485.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,220,000.00	1,217,988.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,316,878.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,336,101.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	975,884.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,565,000.00	1,653,184.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,221,100.58
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,287,187.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,395,000.00	1,537,011.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,145,000.00	1,189,312.87
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	2,060,000.00	2,814,950.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,785,000.00	1,968,883.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,220,246.93
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	500,000.00	502,117.69
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,715,576.31
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,255,000.00	1,460,221.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,380,000.00	1,638,247.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,050,000.00	2,806,421.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	2,148,026.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,330,000.00	1,406,888.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	1,191,574.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,452,000.00	1,566,594.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,375,000.00	1,389,238.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,230,000.00	3,306,284.97
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,245,000.00	1,219,169.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	780,000.00	785,653.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,610,000.00	1,731,089.71

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,630,000.00	2,466,742.57
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	1,321,032.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	2,318,638.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	1,050,000.00	1,338,358.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	933,162.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	1,100,000.00	1,256,076.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,205,000.00	3,041,895.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,496,370.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,600,000.00	2,518,252.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	610,000.00	776,367.31
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,720,000.00	2,743,324.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	875,784.54
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,345,000.00	2,173,159.54
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	434,164.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	1,494,027.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,551,990.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	1,572,154.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	850,000.00	1,261,605.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	1,180,000.00	1,379,546.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	850,000.00	845,502.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	807,976.00
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	330,000.00	340,985.13
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	370,000.00	375,186.58
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	363,000.00	387,640.51
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	285,000.00	290,533.56
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	498,363.07
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	338,563.52
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	560,248.25
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	102,427.10
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	421,904.80

















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 228銘柄	100.0%	46.6%
加ドル	国債証券 33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 335銘柄	100.0%	39.6%
英ポンド	国債証券 48銘柄	100.0%	6.1%
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 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	国債証券 16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。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年11月30日現在です。

### 【DCインデックスバランス(株式20)】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	9,175,487,329円
負債総額	8,463,108円
純資産総額( - )	9,167,024,221円
発行済口数	5,399,177,793口
1口当たり純資産額( / )	1.6979円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	40,399,965,608円
負債総額	37,280,739円
純資産総額( - )	40,362,684,869円
発行済口数	21,558,502,277口
1口当たり純資産額( / )	1.8722円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	256,900,771,113円
負債総額	151,605,046円
純資産総額( - )	256,749,166,067円
発行済口数	62,255,842,386口
1口当たり純資産額( / )	4.1241円

日本債券インデックスマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	49,016,294,485円
負債総額	6,615,722円
純資産総額（ - ）	49,009,678,763円
発行済口数	34,626,547,019口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4154円

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 純資産額計算書

資産総額	158,340,319,109円
負債総額	118,569,353円
純資産総額（ - ）	158,221,749,756円
発行済口数	61,572,236,693口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5697円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

該当事項はありません。

### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （4）受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行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11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2021年11月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

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

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

###### ・監査等委員会

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

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2021年11月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク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11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	872	258,513
株式投資信託	803	222,441
単位型	298	11,269
追加型	505	211,171
公社債投資信託	69	36,072
単位型	56	2,162
追加型	13	33,910

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、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				
ソフトウェア		120		241

無形固定資産合計	120	241
投資その他の資産		
投資有価証券	17,826	22,903
関係会社株式	25,769	25,987
長期差入保証金	484	678
繰延税金資産	2,022	1,845
投資その他の資産合計	46,102	51,414
固定資産合計	46,540	52,092
資産合計	95,220	107,145

(単位：百万円)

	第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	554	844
未払金	5,881	9,834
未払収益分配金	8	8
未払償還金	71	71
未払手数料	5,202	8,956
その他未払金	599	798
未払費用	3 4,289	3 4,660
未払法人税等	1,439	1,090
未払消費税等	4 746	4 775
賞与引当金	2,718	3,034
役員賞与引当金	55	55
その他	42	643
流動負債合計	15,726	20,938
固定負債		
退職給付引当金	1,395	1,456
賞与引当金	-	156
その他	695	544
固定負債合計	2,091	2,157
負債合計	17,818	23,095
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	55,395	61,956
利益剰余金合計	55,395	61,956
自己株式	905	2,067
株主資本合計	77,073	82,472
評価・換算差額等		







当期変動額合計	1,521	273	1,247	6,647
当期末残高	1,461	115	1,577	84,049

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

項目	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>

## (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)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,311百万円</p> <p>器具備品 707百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,349百万円</p> <p>器具備品 764百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>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。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>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。</p>
<p>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。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 151百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 623百万円</p>	<p>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。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 257百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 1,247百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。</p>





## (リース取引関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	912百万円	1年内	911百万円
1年超	6,148百万円	1年超	5,236百万円
合計	7,060百万円	合計	6,148百万円

## (金融商品関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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



















































	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ベ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 ユーロ 香港ドル 人民元	投資有価証券	4,973	-	93
			1	-	0
			979	-	17
			4,970	-	120
			合計	10,924	-





定めるものを除きます。 )。

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

## 5【その他】

### ( 1 ) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### ( 2 ) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### ( 1 ) 受託会社

名 称	資本金の額 ( 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
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社 東邦銀行	23,519百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000百万円 ( 基金及び基金償却積立金の合計額 )	
ソニ - 生命保険株式会社	70,000百万円	







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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



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. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。