

【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60）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCインデックスバランス（株式60）（以下「ファンド」といいます。）

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

2022年2月9日から2022年8月8日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

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

3. 株式に60%、債券などに40%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%とします。
組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	15%
日本債券インデックスマザーファンド	25%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

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

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



主な投資制限

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

分配方針

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

信託金限度額

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

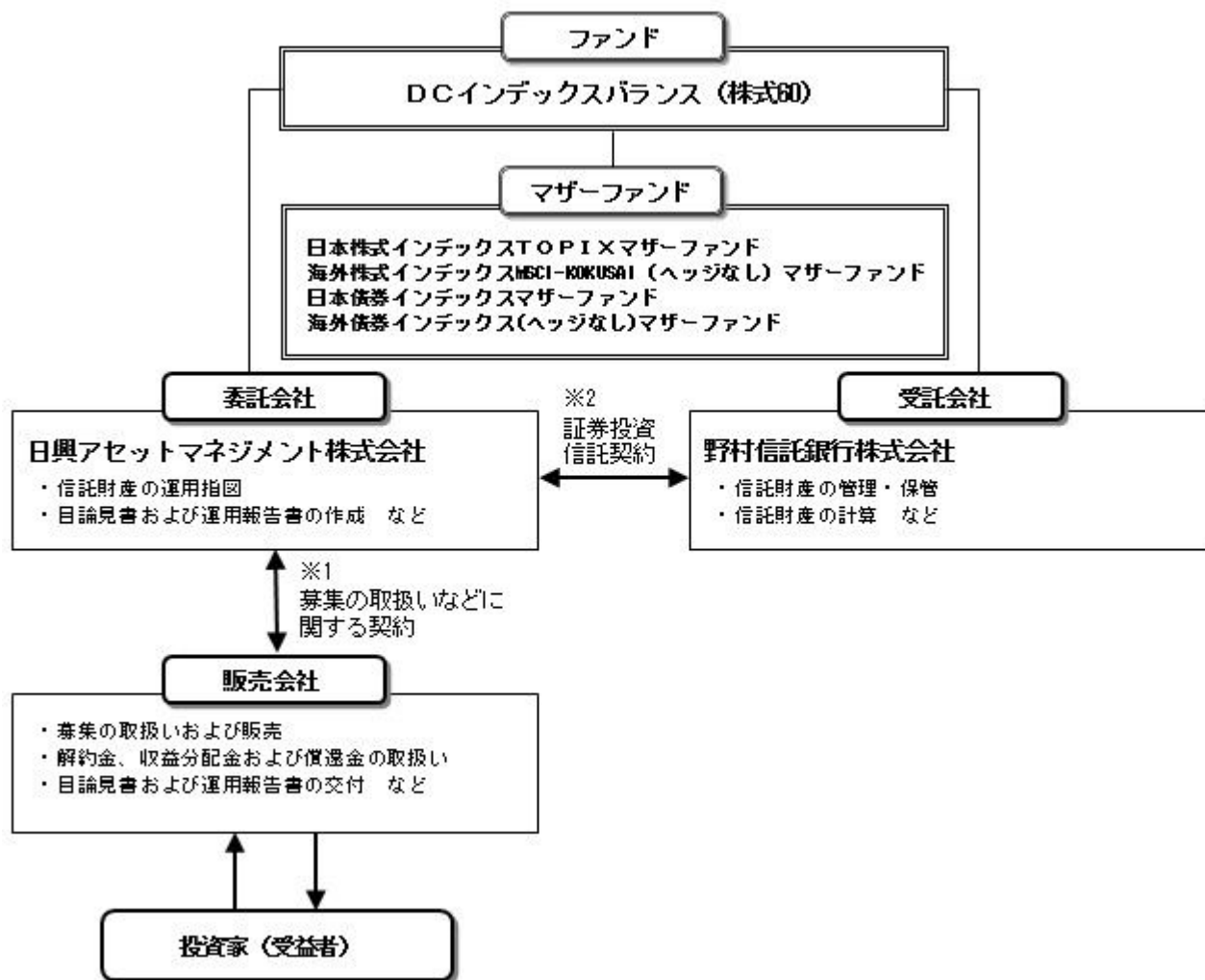
(2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2021年11月末現在）

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

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

2 【投資方針】

（1）【投資方針】

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

致します。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

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

株式の標準実質組入比率.....60%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....40%

- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

< DCインデックスバランス（株式60） >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証券
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 10) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)～12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 15) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で16)に定めるもの以外のもの

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>
わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))には投資しません。
 - 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であっ

て当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)

- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

* T O P I X（東証株価指数）は、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 >

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

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

ファンドに係る費用

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

その他

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

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

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

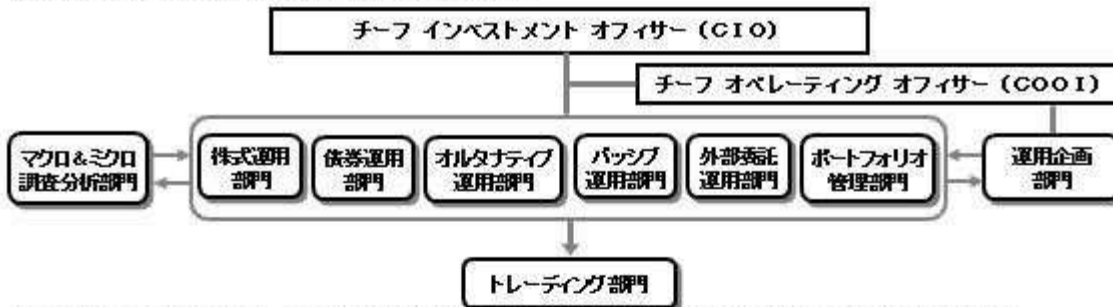
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

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

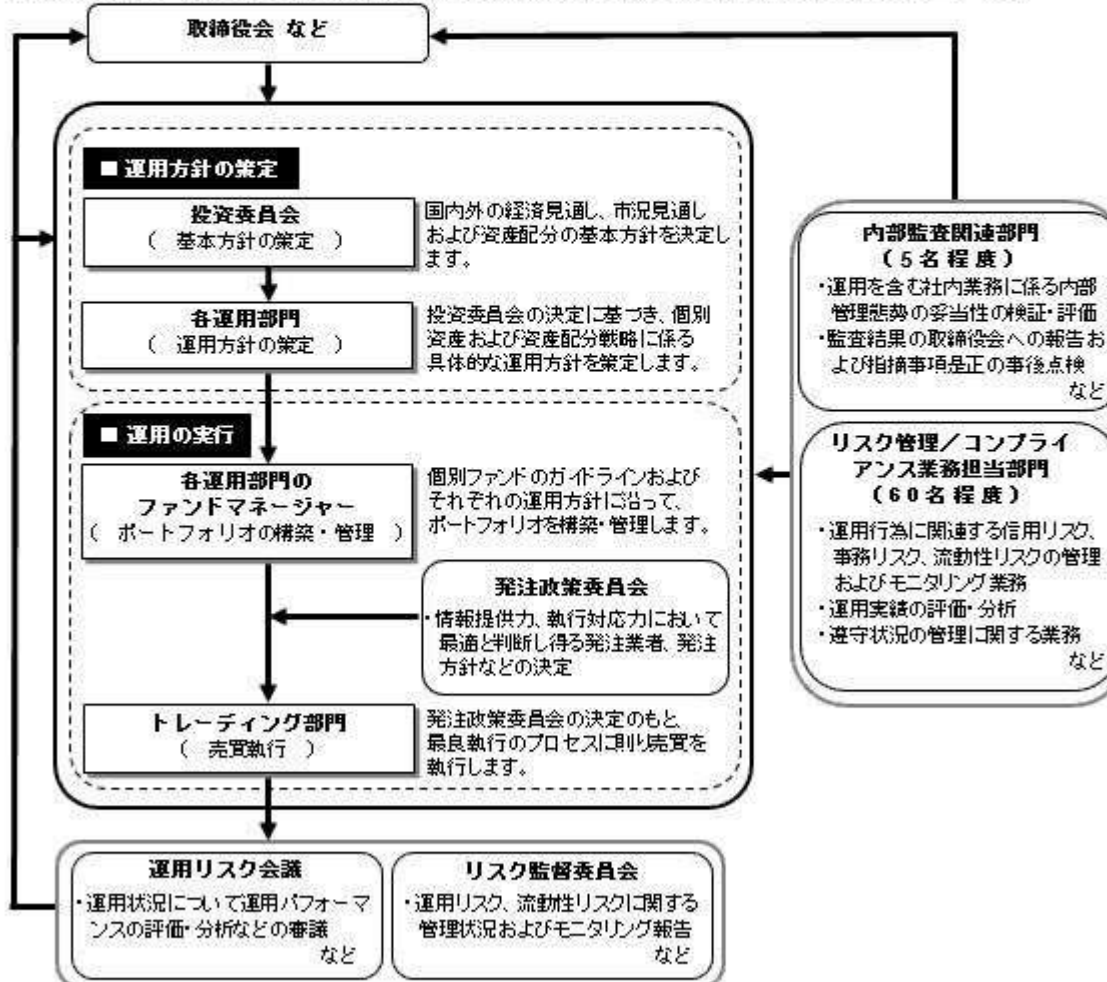
* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（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60） >

1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。

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

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

4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

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

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

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

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

により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商

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

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・ 一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおい

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

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

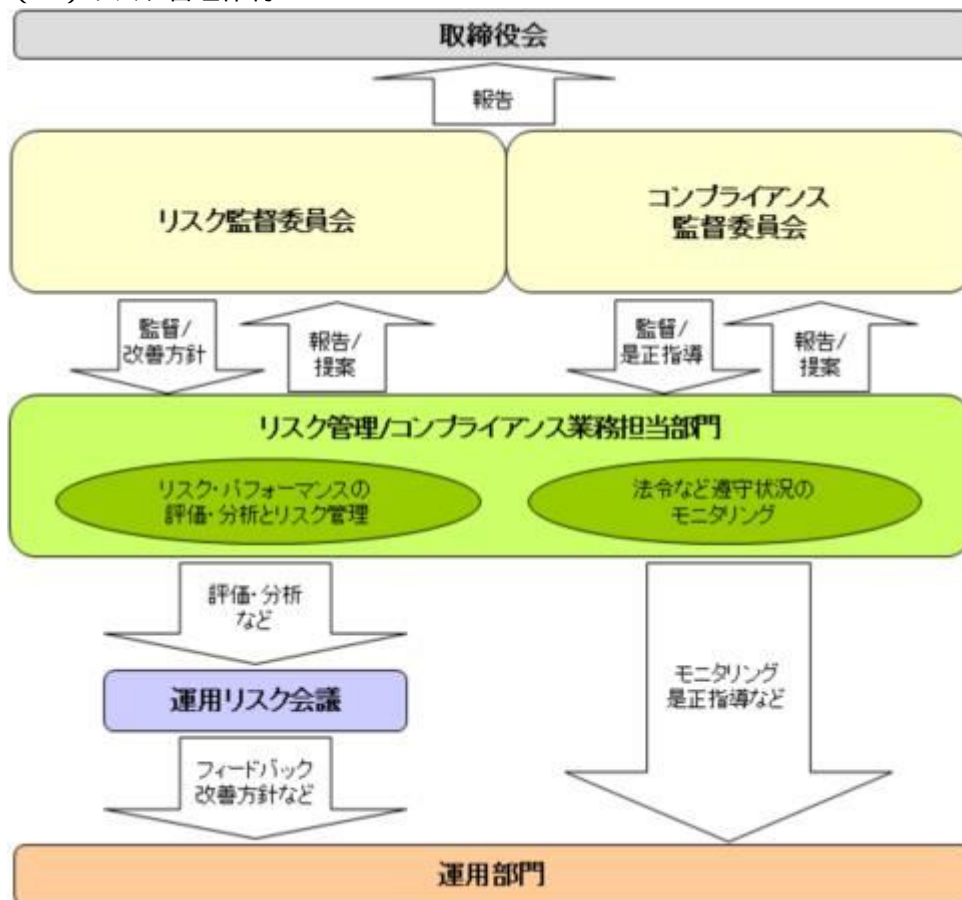
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限さ

れることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

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

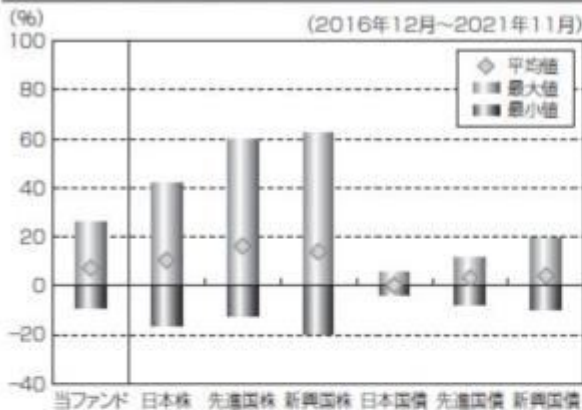
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2021年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。

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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	7.2%	10.4%	16.2%	13.9%	0.2%	3.2%	4.1%
最大値	25.8%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-9.1%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.0%	-7.9%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年12月から2021年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

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

MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース)

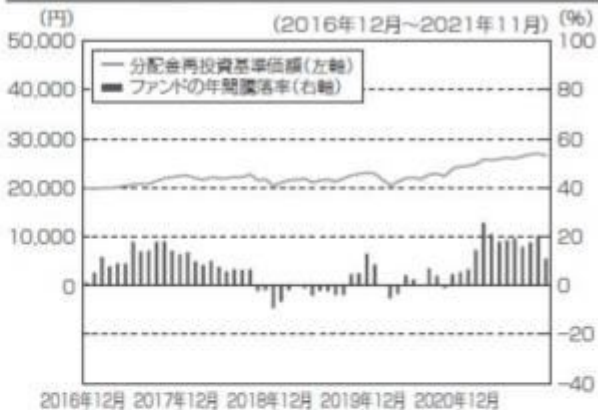
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されません。

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ただし、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

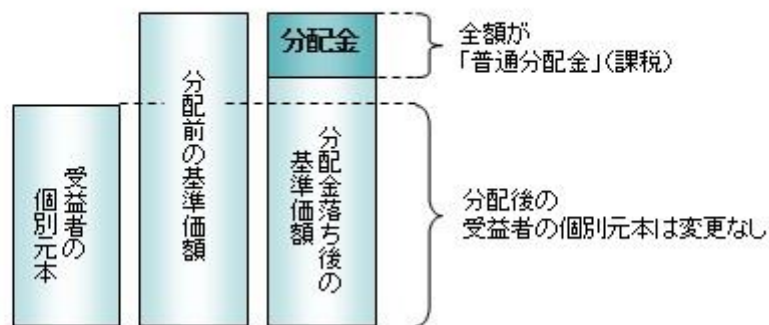
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

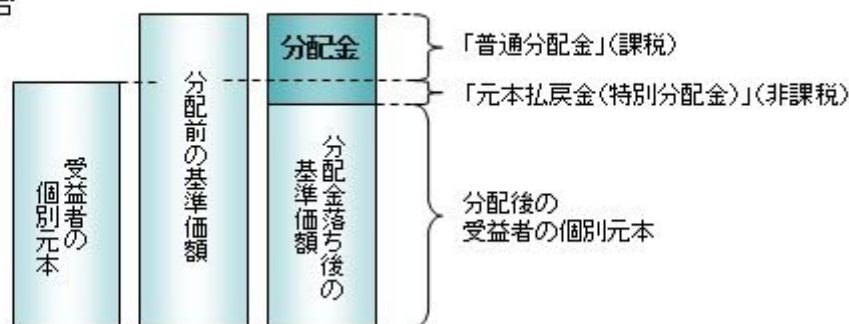
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は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60)】

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】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	14,977,929,010	94.92
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		800,896,935	5.08
合計（純資産総額）		15,778,825,945	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,691,240,933	1.9753	7,291,336,299	1.8722	6,910,741,274	43.80
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	2,837,309,546	1.4152	4,015,606,495	1.4154	4,015,927,931	25.45
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	594,153,803	4.2058	2,498,892,065	4.1241	2,450,349,698	15.53
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	622,994,944	2.6024	1,621,312,988	2.5697	1,600,910,107	10.15

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	94.92
合計	94.92

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第10計算期間末 (2012年11月 6日)	1,972	1,973	1.1554	1.1564
第11計算期間末 (2013年11月 6日)	2,651	2,652	1.5855	1.5865

第12計算期間末	(2014年11月 6日)	3,346	3,347	1.8012	1.8022
第13計算期間末	(2015年11月 6日)	3,898	3,900	1.9758	1.9768
第14計算期間末	(2016年11月 7日)	3,878	3,880	1.8341	1.8351
第15計算期間末	(2017年11月 6日)	5,724	5,727	2.2197	2.2207
第16計算期間末	(2018年11月 6日)	7,503	7,506	2.1621	2.1631
第17計算期間末	(2019年11月 6日)	9,913	9,917	2.2665	2.2675
第18計算期間末	(2020年11月 6日)	11,841	11,846	2.3048	2.3058
第19計算期間末	(2021年11月 8日)	16,104	16,110	2.7243	2.7253
	2020年11月末日	12,353		2.3858	
	12月末日	12,806		2.4299	
	2021年 1月末日	12,944		2.4383	
	2月末日	13,260		2.4775	
	3月末日	14,064		2.5755	
	4月末日	14,095		2.5619	
	5月末日	14,348		2.5865	
	6月末日	14,773		2.6097	
	7月末日	14,878		2.5943	
	8月末日	15,285		2.6397	
	9月末日	15,644		2.6790	
	10月末日	15,895		2.6961	
	11月末日	15,778		2.6483	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	4.14
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	37.31

第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	13.67
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	9.75
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	7.12
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	21.08
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	2.55
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	4.87
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1.73
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	18.24

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	280,700,352	185,136,062
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	276,014,975	310,793,361
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	370,051,653	184,520,878
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	380,095,839	264,656,068
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	371,339,540	230,013,327
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	878,324,252	413,874,113
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1,237,064,109	345,671,921
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	1,312,172,027	408,686,802
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1,522,648,131	758,698,697
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	1,520,961,203	747,212,137

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	39,697,814,850	98.35
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		664,870,019	1.65
合計（純資産総額）		40,362,684,869	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	----	------	---------	---------

株価指数先物取引	買建	日本	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	761,000	1,980.86	1,507,438,000	2,001.00	1,522,761,000	3.77
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	94,100	13,408.53	1,261,743,500	13,825.00	1,300,932,500	3.22
日本	株式	キーエンス	電気機器	13,600	66,804.26	908,538,000	70,330.00	956,488,000	2.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	110,800	7,402.22	820,166,400	6,901.00	764,630,800	1.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	950,400	640.19	608,438,880	601.40	571,570,560	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,500	51,406.00	488,357,000	59,840.00	568,480,000	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	172,500	3,266.30	563,437,400	3,125.00	539,062,500	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	88,400	6,502.85	574,852,800	6,030.00	533,052,000	1.32
日本	株式	HOYA	精密機器	29,300	17,279.50	506,289,500	18,020.00	527,986,000	1.31
日本	株式	日本電産	電気機器	38,900	12,576.40	489,222,000	13,000.00	505,700,000	1.25
日本	株式	日立製作所	電気機器	72,300	6,776.35	489,930,200	6,688.00	483,542,400	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	25,300	19,485.96	492,995,000	19,000.00	480,700,000	1.19
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,100	25,584.16	488,657,500	23,150.00	442,165,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	8,500	49,168.70	417,934,000	50,100.00	425,850,000	1.06
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	102,600	3,808.95	390,798,900	3,703.00	379,927,800	0.94
日本	株式	三菱商事	卸売業	110,900	3,614.82	400,883,800	3,391.00	376,061,900	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	44,100	8,537.36	376,498,000	8,380.00	369,558,000	0.92
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	118,300	3,409.91	403,393,500	3,101.00	366,848,300	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	118,100	3,184.26	376,061,600	3,031.00	357,961,100	0.89
日本	株式	KDDI	情報・通信業	107,500	3,678.73	395,464,500	3,300.00	354,750,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	223,300	1,540.51	343,997,550	1,562.50	348,906,250	0.86
日本	株式	第一三共	医薬品	118,100	2,855.40	337,223,000	2,824.50	333,573,450	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	101,200	3,232.92	327,171,600	3,260.00	329,912,000	0.82
日本	株式	S M C	機械	4,400	68,720.00	302,368,000	72,650.00	319,660,000	0.79
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	17,000	18,012.23	306,208,000	17,840.00	303,280,000	0.75
日本	株式	三井物産	卸売業	115,000	2,617.34	300,994,500	2,557.00	294,055,000	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	13,200	24,533.56	323,843,000	22,245.00	293,634,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,800	6,017.61	293,659,400	5,708.00	278,550,400	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	33,100	8,083.92	267,578,000	8,331.00	275,756,100	0.68
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	189,600	1,520.96	288,374,100	1,402.00	265,819,200	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.22
		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	

	ジャージー	781,614,865	0.30
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	56,629,485	0.02
	小計	243,451,686,934	94.82
投資証券	アメリカ	4,966,316,506	1.93
	カナダ	14,610,790	0.01
	フランス	102,331,702	0.04
	イギリス	156,274,719	0.06
	オーストラリア	353,039,025	0.14
	香港	87,704,137	0.03
	シンガポール	100,947,584	0.04
	小計	5,781,224,463	2.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		7,516,254,670	2.93
合計（純資産総額）		256,749,166,067	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,968,582,025	1.55
	買建	ドイツ	698,614,605	0.27

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		2,381,105,560	0.93
	売建		1,109,461,820	0.43

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	641,278	16,910.77	10,844,506,560	18,230.50	11,690,821,657	4.55
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	274,944	35,055.95	9,638,423,144	38,298.39	10,529,913,942	4.10
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,470	377,758.49	6,599,440,906	405,199.81	7,078,840,836	2.76
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	31,575	116,598.32	3,681,592,024	129,355.35	4,084,395,249	1.59
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,550	312,746.90	3,612,226,739	331,140.09	3,824,668,152	1.49

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	11,192	315,764.08	3,534,031,630	332,467.79	3,720,979,568	1.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	95,780	26,355.95	2,524,373,677	37,971.87	3,636,946,207	1.42
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	メディア・ 娯楽	92,040	37,395.06	3,441,841,442	38,457.67	3,539,644,232	1.38
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,320	19,447.84	2,262,173,190	18,343.13	2,133,673,707	0.83
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	40,850	42,238.25	1,725,432,521	46,283.91	1,890,697,781	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	36,215	51,138.47	1,851,979,956	51,424.04	1,862,321,609	0.73
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	101,121	18,667.38	1,887,664,295	18,174.75	1,837,849,653	0.72
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバコ	110,653	14,395.60	1,592,916,327	14,802.32	1,637,921,668	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	50,975	33,022.88	1,683,341,319	32,096.79	1,636,133,993	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	94,079	16,024.50	1,507,569,359	16,954.00	1,595,015,874	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	296,419	5,405.21	1,602,207,743	5,186.77	1,537,458,451	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	16,132	88,037.89	1,420,227,339	90,503.36	1,460,000,333	0.57
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	64,992	26,608.52	1,729,341,426	22,331.91	1,451,395,709	0.57
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	18,354	73,605.77	1,350,960,429	78,215.73	1,435,571,642	0.56
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	17,045	76,414.75	1,302,489,553	75,525.07	1,287,324,934	0.50
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	215,070	4,909.17	1,055,816,374	5,961.54	1,282,150,128	0.50
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェ ア・サービ ス	37,346	33,439.27	1,248,823,292	33,760.10	1,260,805,061	0.49
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェ ア・サービ ス	33,985	41,055.04	1,395,255,609	36,748.84	1,248,909,589	0.49
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	26,973	44,031.06	1,187,649,848	44,061.87	1,188,480,954	0.46
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・ 娯楽	69,942	19,569.57	1,368,735,403	16,816.34	1,176,168,711	0.46
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	162,891	7,321.09	1,192,541,219	7,007.09	1,141,392,598	0.44
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	15,089	69,143.71	1,043,309,554	73,810.56	1,113,727,584	0.43
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活 必需品小売 り	16,984	55,758.67	947,005,370	63,128.69	1,072,177,800	0.42
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・ 娯楽	176,614	6,152.68	1,086,649,708	5,862.56	1,035,411,602	0.40
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	161,730	6,273.27	1,014,577,218	6,343.81	1,025,985,232	0.40

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	3.19
		素材	3.94
		資本財	5.86
		商業・専門サービス	1.25
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	2.52
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.68
		メディア・娯楽	6.94
		小売	5.68
		食品・生活必需品小売り	1.42
		食品・飲料・タバコ	3.54
		家庭用品・パーソナル用品	1.63
		ヘルスケア機器・サービス	4.44
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.62
		銀行	5.72
		各種金融	4.54
		保険	2.82
		不動産	0.36
		ソフトウェア・サービス	12.25
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.08		
電気通信サービス	1.41		
公益事業	2.71		
半導体・半導体製造装置	5.43		
投資証券			2.25
合計			97.07

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等 (円)	評価額 (各通貨)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2112	買建	150	米ドル	34,510,375	3,926,245,364	34,882,500	3,968,582,025	1.55
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2112	買建	150	ユーロ	5,518,980	708,692,222	5,440,500	698,614,605	0.27

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	16,200,000.00	1,844,118,770	1,841,351,070	0.72
	ユーロ	買建	4,200,000.00	548,175,240	539,754,490	0.21
	米ドル	売建	8,100,000.00	921,699,000	921,494,070	0.36
	ユーロ	売建	850,000.00	109,176,625	109,156,550	0.04
	英ポンド	売建	520,000.00	78,826,488	78,811,200	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	37,304,810,578	76.12
地方債証券	日本	4,808,170,983	9.81
特殊債証券	日本	5,297,994,650	10.81
社債券	日本	1,415,462,083	2.89
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		183,240,469	0.37
合計（純資産総額）		49,009,678,763	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	720,000,000	100.69	724,975,200	101.25	729,021,600	0.100	2029/12/20	1.49
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	101.60	711,214,000	101.68	711,823,000	0.300	2025/12/20	1.45
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	690,000,000	100.89	696,161,700	101.06	697,348,500	0.100	2027/3/20	1.42
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	680,000,000	100.89	686,099,600	101.20	688,180,400	0.100	2028/3/20	1.40
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	660,000,000	100.62	664,144,800	101.20	667,966,200	0.100	2030/3/20	1.36
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	100.85	615,197,200	101.01	616,191,500	0.100	2026/12/20	1.26
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	590,000,000	100.86	595,091,700	101.26	597,463,500	0.100	2028/9/20	1.22

日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	100.92	595,457,500	101.18	596,997,400	0.100	2027/12/20	1.22
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	550,000,000	100.56	553,080,000	101.11	556,127,000	0.100	2030/6/20	1.13
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	100.86	539,627,750	101.21	541,516,300	0.100	2028/6/20	1.10
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	101.72	498,472,100	101.75	498,609,300	0.500	2024/9/20	1.02
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	430,000,000	115.12	495,033,200	115.44	496,422,100	1.500	2033/3/20	1.01
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	420,000,000	101.91	428,051,400	101.98	428,341,200	0.400	2025/9/20	0.87
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	358,000,000	116.87	418,398,180	117.16	419,439,960	1.700	2032/9/20	0.86
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	355,000,000	117.60	417,504,850	117.93	418,662,150	1.700	2033/6/20	0.85
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	117.38	402,620,260	117.86	404,283,810	2.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	101.65	396,438,900	101.72	396,715,800	0.400	2025/3/20	0.81
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	370,000,000	101.77	376,563,800	101.85	376,859,800	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	300,000,000	112.60	337,812,000	113.10	339,300,000	1.200	2035/3/20	0.69
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	116.49	337,835,500	116.97	339,239,100	2.100	2029/9/20	0.69
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	111.04	333,144,000	110.99	332,988,000	2.300	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	325,000,000	100.81	327,642,250	101.32	329,293,250	0.100	2029/3/20	0.67
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	270,000,000	114.08	308,021,400	114.51	309,182,400	1.300	2035/6/20	0.63
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	300,000,000	100.82	302,466,000	101.31	303,936,000	0.100	2028/12/20	0.62
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	101.72	300,100,550	101.60	299,722,950	1.400	2022/12/20	0.61
日本	国債証券	第155回利付国債(20年)	270,000,000	110.17	297,467,100	110.63	298,703,700	1.000	2035/12/20	0.61
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	250,000,000	111.64	279,122,500	111.58	278,955,000	2.300	2026/9/20	0.57
日本	国債証券	第139回利付国債(20年)	230,000,000	115.49	265,643,100	115.84	266,436,600	1.600	2032/6/20	0.54
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	255,000,000	102.24	260,727,300	102.86	262,313,400	0.500	2038/3/20	0.54
日本	国債証券	第136回利付国債(20年)	220,000,000	115.25	253,556,600	115.58	254,287,000	1.600	2032/3/20	0.52

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.12
地方債証券	9.81
特殊債券	10.81
社債券	2.89
合計	99.63

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	74,098,884,428	46.83
	カナダ	3,114,135,509	1.97
	メキシコ	1,041,200,487	0.66
	ドイツ	11,455,422,236	7.24
	イタリア	14,258,765,491	9.01
	フランス	15,658,076,602	9.90
	オランダ	2,975,585,224	1.88
	スペイン	9,267,492,491	5.86
	ベルギー	3,548,634,753	2.24
	オーストリア	2,293,263,848	1.45
	フィンランド	937,452,371	0.59
	アイルランド	1,234,051,192	0.78
	イギリス	9,694,546,795	6.13
	スウェーデン	462,906,464	0.29
	ノルウェー	378,959,743	0.24
	デンマーク	789,885,688	0.50
	ポーランド	768,893,351	0.49
	オーストラリア	2,728,671,300	1.72
	シンガポール	684,058,215	0.43
	マレーシア	750,219,243	0.47
中国	343,436,556	0.22	
イスラエル	755,131,904	0.48	
	小計	157,239,673,891	99.38
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		982,075,865	0.62
合計（純資産総額）		158,221,749,756	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		133,275,107	0.08

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,400,000	10,913.03	916,694,664	11,026.35	926,214,015	1.125	2031/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,377.13	910,170,467	11,370.85	909,668,368	0.125	2022/10/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,323.22	905,858,074	11,321.89	905,751,412	0.250	2023/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,480,000	11,392.99	852,196,275	11,508.54	860,839,283	1.625	2031/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,322.11	792,548,039	11,323.89	792,672,475	0.125	2023/7/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	12,013.17	732,803,855	11,992.51	731,543,279	2.375	2026/4/30	0.46
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	22,087.44	670,353,942	22,517.61	683,409,708	4.500	2041/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	10,697.93	653,643,847	10,798.81	659,807,738	0.875	2030/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,805.85	625,710,550	11,779.86	624,332,618	2.500	2023/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,426.48	613,868,247	12,434.26	614,252,446	2.875	2028/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	11,937.62	613,594,071	11,908.51	612,097,858	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,824.74	593,602,267	11,790.74	591,895,574	2.000	2025/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	13,525.96	554,564,524	14,017.70	574,726,008	3.000	2048/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,265.60	576,483,441	12,225.38	574,593,156	3.000	2025/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,870,000	11,812.97	575,291,642	11,777.86	573,581,813	2.000	2025/2/15	0.36
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,692,000	20,218.54	544,283,296	21,259.53	572,306,791	2.500	2046/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	12,650.46	570,536,081	12,674.24	571,608,414	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,866.96	569,614,389	11,834.30	568,046,493	2.125	2025/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,284.56	564,228,094	11,281.89	564,094,767	0.250	2024/3/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,274.78	563,739,236	11,266.78	563,339,266	0.375	2024/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,631.64	562,971,817	11,623.64	562,584,602	1.625	2026/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,046.80	552,340,016	11,042.35	552,117,812	0.375	2026/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,942.80	547,140,375	10,974.36	548,718,046	0.750	2028/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	11,908.96	550,194,112	11,873.41	548,551,558	2.375	2024/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,822.81	541,140,782	10,851.25	542,562,907	0.500	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	10,489.06	533,893,187	10,582.83	538,666,150	0.625	2030/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,750,000	10,841.92	514,991,460	11,335.22	538,423,189	1.875	2051/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,540,000	20,599.99	523,239,860	20,862.14	529,898,445	5.750	2032/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	12,055.61	530,447,273	12,016.95	528,746,075	2.625	2025/3/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	11,252.11	528,849,624	11,248.11	528,661,638	0.250	2024/6/15	0.33

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.38
合計	99.38

投資不動産物件

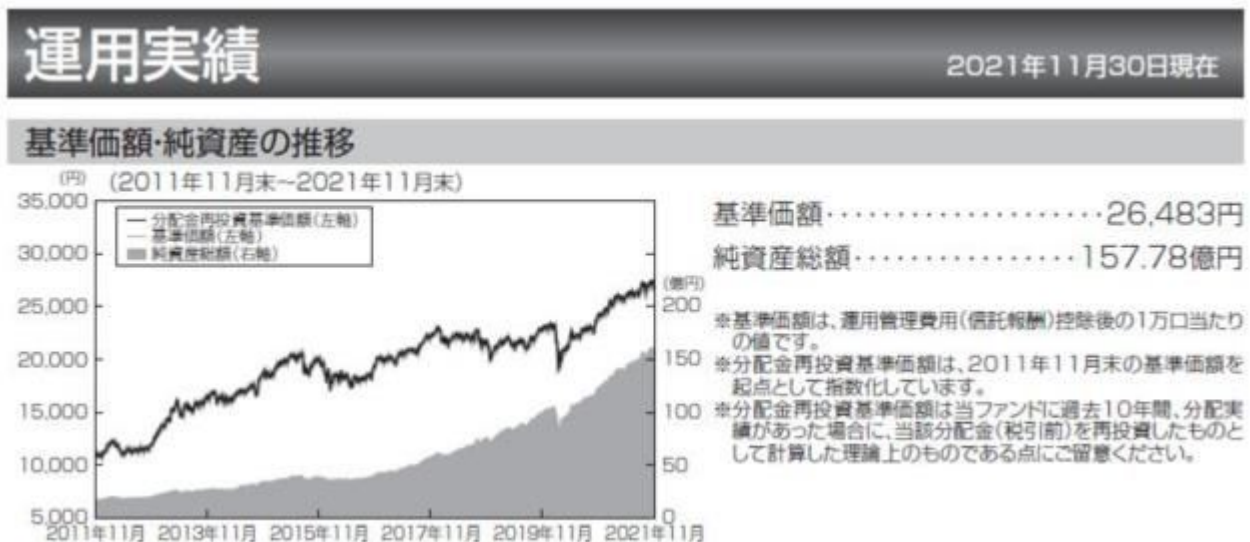
該当事項はありません。

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



分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	2021年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	160円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	43.80%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	15.53%
日本債券インデックスマザーファンド	25.45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.15%
現金その他	5.08%

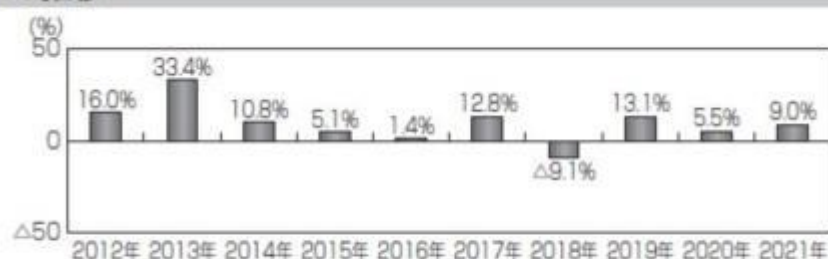
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.77%	
	2 ソニーグループ	電気機器	3.22%	
	3 キーエンス	電気機器	2.37%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.55%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.10%	
	3 AMAZON.COM INC	小売	2.76%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第357回利付国債(10年)	国債証券	2029/12/20	1.49%
	2 第341回利付国債(10年)	国債証券	2025/12/20	1.45%
	3 第346回利付国債(10年)	国債証券	2027/3/20	1.42%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン1.125%)	国債証券	2031/2/15	0.59%
	2 US TREASURY N/B (クーポン0.125%)	国債証券	2022/10/31	0.57%
	3 US TREASURY N/B (クーポン0.250%)	国債証券	2023/11/15	0.57%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2021年は、2021年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

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

- (2) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (3) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (4) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (5) 申込単位
1円以上1円単位
- (6) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (5) 手取額
1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。
上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。
税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。
- (6) 解約単位
1口単位
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。
- (7) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむ

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

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

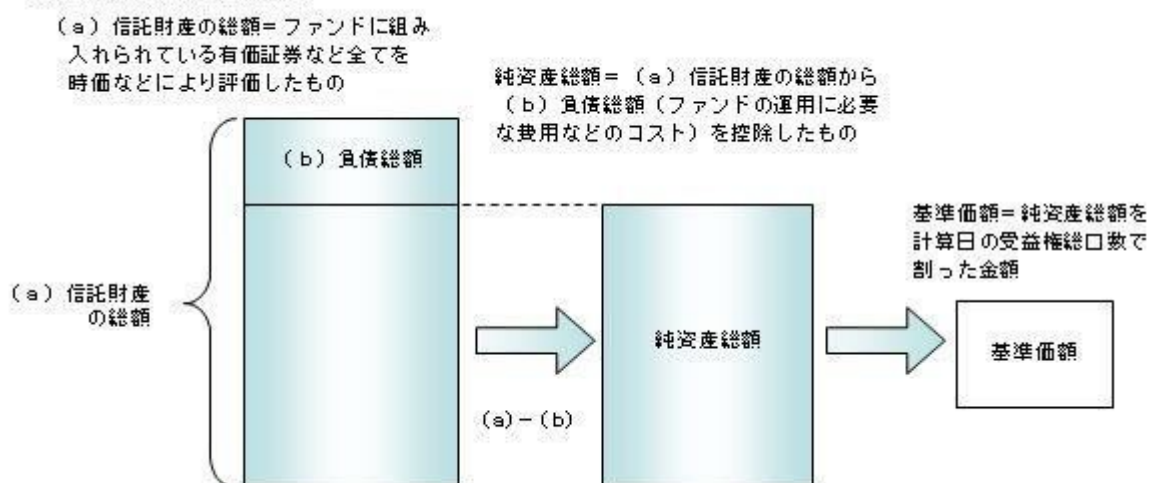
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

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

^{*}外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

信託約款の変更

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

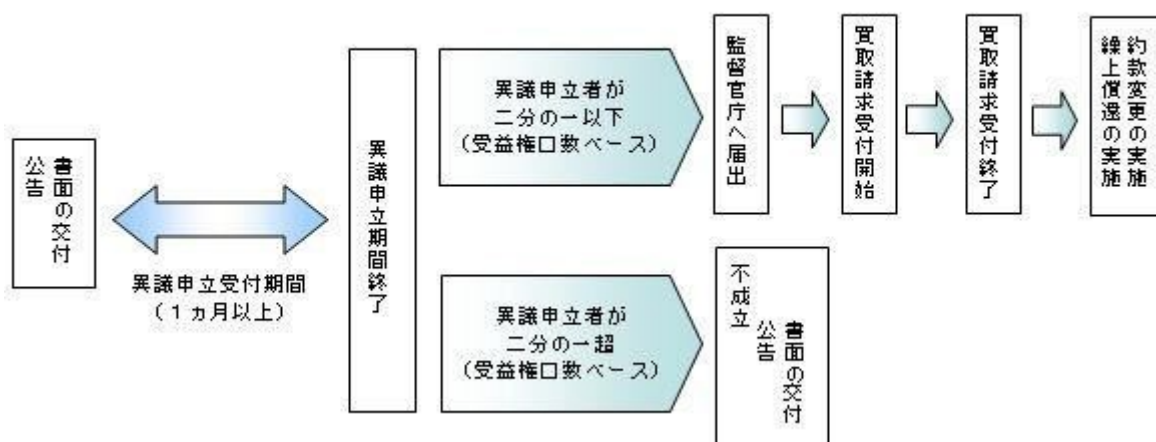
は、原則として公告を行いません。

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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60)】

(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
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	599,990,708	813,830,032
親投資信託受益証券	11,265,029,527	15,315,935,752
未収入金	4,080,299	8,606,159
流動資産合計	11,869,100,534	16,138,371,943
資産合計	11,869,100,534	16,138,371,943
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,137,752	5,911,501
未払解約金	13,553,367	15,443,170
未払受託者報酬	1,208,758	1,685,917
未払委託者報酬	7,252,931	10,115,886
未払利息	414	437
その他未払費用	241,700	337,130
流動負債合計	27,394,922	33,494,041
負債合計	27,394,922	33,494,041
純資産の部		
元本等		
元本	5,137,752,906	5,911,501,972
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,703,952,706	10,193,375,930
(分配準備積立金)	1,445,340,017	3,371,434,161
元本等合計	11,841,705,612	16,104,877,902
純資産合計	11,841,705,612	16,104,877,902
負債純資産合計	11,869,100,534	16,138,371,943

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期		第19期	
	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
営業収益				
有価証券売買等損益		244,592,596		2,307,152,721
営業収益合計		244,592,596		2,307,152,721
営業費用				
支払利息		150,279		92,082
受託者報酬		2,585,041		3,126,050
委託者報酬		14,945,605		18,757,022
その他費用		461,309		625,110
営業費用合計		18,142,234		22,600,264
営業利益又は営業損失()		226,450,362		2,284,552,457
経常利益又は経常損失()		226,450,362		2,284,552,457
当期純利益又は当期純損失()		226,450,362		2,284,552,457
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		49,789,936		168,440,925
期首剰余金又は期首欠損金()		5,539,493,946		6,703,952,706
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,849,353,602		2,372,886,346
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,849,353,602		2,372,886,346
剰余金減少額又は欠損金増加額		955,997,388		993,663,153
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		955,997,388		993,663,153
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		5,137,752		5,911,501
期末剰余金又は期末欠損金()		6,703,952,706		10,193,375,930

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月7日から翌年11月6日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年11月 7日から2021年11月 8日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第18期 2020年11月 6日現在	第19期 2021年11月 8日現在
1.	期首元本額	4,373,803,472円	5,137,752,906円
	期中追加設定元本額	1,522,648,131円	1,520,961,203円
	期中一部解約元本額	758,698,697円	747,212,137円
2.	受益権の総数	5,137,752,906口	5,911,501,972口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日		第19期 自 2020年11月 7日 至 2021年11月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	178,799,848円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 228,964,938円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	97,440,450円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 1,887,146,594円
C	信託約款に定める収益調整金	5,514,513,414円	C 信託約款に定める収益調整金 6,821,941,769円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,174,237,471円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 1,261,234,130円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	6,964,991,183円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 10,199,287,431円
F	分配対象収益(1万口当たり)	13,556円	F 分配対象収益(1万口当たり) 17,253円
G	分配金額	5,137,752円	G 分配金額 5,911,501円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第18期 自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日	第19期 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

	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	364,947,611
合計	364,947,611

第19期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,185,437,700
合計	2,185,437,700

(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	2.3048円	1口当たり純資産額	2.7243円
(1万口当たり純資産額)	(23,048円)	(1万口当たり純資産額)	(27,243円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

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

親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	601,540,552	2,529,959,253	
	日本債券インデックスマザーファンド	2,816,463,929	3,986,141,398	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	619,582,841	1,612,526,301	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,636,933,914	7,187,308,800	
合計		7,674,521,236	15,315,935,752	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	99,769,328	281,234,777
株式	34,394,247,690	41,695,319,770
派生商品評価勘定	7,827,350	5,851,800
未収入金	52,158,410	-
未収配当金	297,955,110	347,282,854
流動資産合計	34,851,957,888	42,329,689,201
資産合計	34,851,957,888	42,329,689,201
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,552,750
前受金	5,230,000	4,605,000

未払金	-	301,100
未払解約金	52,611,923	34,533,416
未払利息	68	151
流動負債合計	57,841,991	40,992,417
負債合計	57,841,991	40,992,417
純資産の部		
元本等		
元本	22,074,085,898	21,399,374,592
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,720,029,999	20,889,322,192
元本等合計	34,794,115,897	42,288,696,784
純資産合計	34,794,115,897	42,288,696,784
負債純資産合計	34,851,957,888	42,329,689,201

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		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	21,517,048,675円	22,074,085,898円
	期首からの追加設定元本額	5,120,023,303円	2,449,231,144円
	期首からの一部解約元本額	4,562,986,080円	3,123,942,450円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	706,769,163円	696,888,688円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,801,534,543円	1,850,824,764円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,409,693,795円	3,636,933,914円
	DCインデックスバランス（株式80）	3,476,712,685円	4,009,153,065円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,354,690,627円	1,406,483,021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	3,236,646,653円	3,079,703,536円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	734,514,070円	636,617,068円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	49,485,768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)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位 : 円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	3,065.00	2,145,500	
日本水産	20,300	629.00	12,768,700	
マルハニチロ	3,200	2,588.00	8,281,600	
雪国まいたけ	1,500	1,413.00	2,119,500	
カネコ種苗	600	1,494.00	896,400	
サカタのタネ	2,400	3,370.00	8,088,000	
ホクト	1,700	1,957.00	3,326,900	
ホクリヨウ	300	748.00	224,400	
住石ホールディングス	3,200	139.00	444,800	
日鉄鉱業	500	6,500.00	3,250,000	
三井松島ホールディングス	800	1,389.00	1,111,200	
I N P E X	81,400	970.00	78,958,000	
石油資源開発	2,400	2,208.00	5,299,200	
K & O エナジーグループ	1,000	1,605.00	1,605,000	
ヒノキヤグループ	500	2,342.00	1,171,000	
ショーボンドホールディングス	2,900	4,815.00	13,963,500	
ミライト・ホールディングス	6,600	2,189.00	14,447,400	
サンヨーホームズ	300	729.00	218,700	
日本アクア	900	625.00	562,500	
ファーストコーポレーション	700	777.00	543,900	
ベステラ	400	1,409.00	563,600	
キャンディル	500	520.00	260,000	
スペースバリューホールディングス	2,300	928.00	2,134,400	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,911.00	764,400	
第一カッター興業	600	1,398.00	838,800	
安藤・間	11,200	753.00	8,433,600	

東急建設	6,000	804.00	4,824,000	
コムシスホールディングス	6,600	2,844.00	18,770,400	
ピーアールホールディングス	2,900	432.00	1,252,800	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,006.00	2,607,800	
東建コーポレーション	600	9,340.00	5,604,000	
ソネック	300	1,083.00	324,900	
ヤマウラ	1,000	928.00	928,000	
オリエンタル白石	7,200	271.00	1,951,200	
大成建設	13,600	3,465.00	47,124,000	
大林組	46,900	900.00	42,210,000	
清水建設	44,000	809.00	35,596,000	
飛島建設	1,300	1,056.00	1,372,800	
長谷工コーポレーション	14,000	1,516.00	21,224,000	
松井建設	1,900	728.00	1,383,200	
銭高組	200	4,080.00	816,000	
鹿島建設	34,400	1,359.00	46,749,600	
不動テトラ	1,100	1,817.00	1,998,700	
大末建設	600	1,120.00	672,000	
鉄建建設	1,100	1,820.00	2,002,000	
西松建設	2,900	3,340.00	9,686,000	
三井住友建設	10,600	493.00	5,225,800	
大豊建設	700	3,740.00	2,618,000	
ナカノフドー建設	1,300	339.00	440,700	
奥村組	2,800	2,976.00	8,332,800	
東鉄工業	2,200	2,504.00	5,508,800	
イチケン	400	1,908.00	763,200	
富士ピー・エス	700	533.00	373,100	
浅沼組	500	4,575.00	2,287,500	
戸田建設	19,500	722.00	14,079,000	
熊谷組	2,400	2,809.00	6,741,600	
北野建設	300	2,167.00	650,100	
植木組	400	1,473.00	589,200	
矢作建設工業	2,100	731.00	1,535,100	
ピーエス三菱	1,600	682.00	1,091,200	
日本ハウスホールディングス	3,300	379.00	1,250,700	
大東建託	4,800	13,510.00	64,848,000	
新日本建設	2,100	850.00	1,785,000	
N I P P O	3,900	4,040.00	15,756,000	
東亜道路工業	300	5,140.00	1,542,000	
日本道路	500	8,050.00	4,025,000	
東亜建設工業	1,200	2,563.00	3,075,600	
日本国土開発	4,700	586.00	2,754,200	

若築建設	800	2,017.00	1,613,600
東洋建設	5,400	569.00	3,072,600
五洋建設	18,600	788.00	14,656,800
福田組	500	4,535.00	2,267,500
住友林業	12,000	2,325.00	27,900,000
日本基礎技術	1,500	483.00	724,500
巴コーポレーション	2,200	457.00	1,005,400
大和ハウス工業	43,300	3,615.00	156,529,500
ライト工業	3,000	2,018.00	6,054,000
積水ハウス	50,900	2,409.50	122,643,550
日特建設	1,100	696.00	765,600
北陸電気工事	900	1,030.00	927,000
ユアテック	2,800	653.00	1,828,400
日本リーテック	1,000	1,496.00	1,496,000
四電工	500	1,606.00	803,000
中電工	2,200	2,180.00	4,796,000
関電工	7,600	874.00	6,642,400
きんでん	10,500	1,846.00	19,383,000
東京エネシス	1,600	1,084.00	1,734,400
トーエネック	500	3,340.00	1,670,000
住友電設	1,200	2,095.00	2,514,000
日本電設工業	2,600	1,727.00	4,490,200
エクシオグループ	7,100	2,678.00	19,013,800
新日本空調	1,300	2,353.00	3,058,900
九電工	3,600	3,505.00	12,618,000
三機工業	3,100	1,447.00	4,485,700
日揮ホールディングス	14,500	1,099.00	15,935,500
中外炉工業	500	1,728.00	864,000
ヤマト	1,500	766.00	1,149,000
太平電業	1,100	2,652.00	2,917,200
高砂熱学工業	4,300	2,076.00	8,926,800
三晃金属工業	200	2,493.00	498,600
朝日工業社	300	3,420.00	1,026,000
明星工業	3,100	658.00	2,039,800
大気社	2,300	3,260.00	7,498,000
ダイダン	1,100	2,302.00	2,532,200
日比谷総合設備	1,500	1,958.00	2,937,000
フィル・カンパニー	300	2,848.00	854,400
テスホールディングス	900	2,474.00	2,226,600
インフロニア・ホールディングス	20,000	929.00	18,580,000
東洋エンジニアリング	2,100	860.00	1,806,000
レイズネクスト	2,300	1,229.00	2,826,700

ニッポン	4,400	1,617.00	7,114,800
日清製粉グループ本社	17,000	1,751.00	29,767,000
日東富士製粉	200	3,515.00	703,000
昭和産業	1,400	2,779.00	3,890,600
鳥越製粉	1,400	767.00	1,073,800
中部飼料	1,700	1,066.00	1,812,200
フィード・ワン	2,000	760.00	1,520,000
東洋精糖	300	1,164.00	349,200
日本甜菜製糖	800	1,643.00	1,314,400
D M三井製糖ホールディングス	1,400	1,964.00	2,749,600
塩水港精糖	1,800	219.00	394,200
日新製糖	700	1,703.00	1,192,100
森永製菓	3,500	3,965.00	13,877,500
中村屋	400	3,735.00	1,494,000
江崎グリコ	4,100	3,950.00	16,195,000
名糖産業	700	1,710.00	1,197,000
井村屋グループ	900	2,309.00	2,078,100
不二家	900	2,343.00	2,108,700
山崎製パン	11,200	1,680.00	18,816,000
第一屋製パン	300	696.00	208,800
モロゾフ	200	5,440.00	1,088,000
亀田製菓	900	4,490.00	4,041,000
寿スピリッツ	1,400	7,500.00	10,500,000
カルビー	6,800	2,873.00	19,536,400
森永乳業	2,800	6,660.00	18,648,000
六甲バター	1,100	1,668.00	1,834,800
ヤクルト本社	11,100	5,850.00	64,935,000
明治ホールディングス	9,900	7,150.00	70,785,000
雪印メグミルク	3,600	2,209.00	7,952,400
プリマハム	1,900	2,572.00	4,886,800
日本ハム	5,700	4,070.00	23,199,000
林兼産業	500	589.00	294,500
丸大食品	1,500	1,719.00	2,578,500
S Foods	1,300	3,435.00	4,465,500
柿安本店	500	2,581.00	1,290,500
伊藤ハム米久ホールディングス	9,600	689.00	6,614,400
サッポロホールディングス	5,100	2,457.00	12,530,700
アサヒグループホールディングス	35,300	5,180.00	182,854,000
キリンホールディングス	55,200	2,006.00	110,731,200
宝ホールディングス	10,200	1,536.00	15,667,200
オエノンホールディングス	4,300	380.00	1,634,000
養命酒製造	500	1,816.00	908,000

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,500	1,601.00	16,810,500
サントリー食品インターナショナル	10,000	4,425.00	44,250,000
ダイドーグループホールディングス	800	5,520.00	4,416,000
伊藤園	4,600	7,590.00	34,914,000
キーコーヒー	1,500	2,212.00	3,318,000
ユニカフェ	500	1,096.00	548,000
ジャパンフーズ	200	1,219.00	243,800
日清オイリオグループ	1,900	3,000.00	5,700,000
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
グンゼ	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
トモク	900	1,870.00	1,683,000
ザ・パック	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
日本パーカライズニング	7,400	1,141.00	8,443,400
高圧ガス工業	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	
住友ベークライト	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
サカタインクス	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
マンダム	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P M C	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	
O A T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
A G C	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
T O T O	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
M A R U W A	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
リョービ	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
東京製綱	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
ナブテスコ	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・ビー機械	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
日本エアーテック	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
T O W A	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

NTN	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
THK	8,700	2,434.00	21,175,800
ユーシン精機	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
IHI	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-PEX	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
IDEC	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
EIZO	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	

OBARA GROUP	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
ヘリオス 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

SCREEN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	
MUTOH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	
GMB	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	
NOK	7,300	1,374.00	10,030,200	
フタバ産業	3,900	440.00	1,716,000	
KYB	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

ノーリツ銅機	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
S H O E I	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
N I S S H A	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ANDARD	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
グローブライド	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
ファイズホールディングス	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
WOW WORLD	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
ポルトウウィン・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
GMO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نز	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

トピラシステムズ	300	1,048.00	314,400
Sansan	1,300	13,560.00	17,628,000
Link-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
S B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JSAT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
DTS	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
ジューテックホールディングス	400	1,215.00	486,000
大光	600	717.00	430,200

OCHIホールディングス	500	1,269.00	634,500
TOKAIホールディングス	7,100	872.00	6,191,200
黒谷	500	656.00	328,000
Cominix	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
SPK	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

ハビネット	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
O U G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・エス・ベイエリア	300	403.00	120,900
くら寿司	1,500	3,815.00	5,722,500
キャンドゥ	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inz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
Monotaro	18,600	2,431.00	45,216,600
東京一番フーズ	400	599.00	239,600
ア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
Hamee	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
クリエイトSDホールディングス	2,200	3,455.00	7,601,000
丸善CHI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
SFP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
クリエイト・レストランツ・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
カップ・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
V T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
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	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
Olympic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HC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
NEC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
SREホールディングス	400	8,640.00	3,456,000
AD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
THE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
パラカ	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
テーオーシー	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
CDS	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
NJS	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・ブレイクスルー	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
CDG	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
TAC	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
Keepers 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
Gunosy	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 MN	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
資産の部		
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
負債の部		
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
純資産の部		
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	<p>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。</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>(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 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	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		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	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		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,676,631,591	-	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		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	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 SOFTWRE	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
ENTERGY 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	
	SOLAREdge 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
ASHTED 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	
英債券小計		11,307,399		70,682,776.67	(10,827,894,558)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	19.52	147,766.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	911.00	245,970.00	
	GIVAUDAN-REG	373	4,359.00	1,625,907.00	
	HOLCIM LTD	21,639	47.20	1,021,360.80	
	SIKA AG-REG	5,550	318.30	1,766,565.00	
	ABB LTD-REG	67,405	31.49	2,122,583.45	
	GEBERIT AG-REG	1,455	716.00	1,041,780.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	590	246.60	145,494.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	251.00	371,480.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,477	47.13	258,131.01	
	SGS SA-REG	258	2,793.00	720,594.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	288.30	573,717.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,209	120.30	2,431,142.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,000	260.80	260,800.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	50.45	93,332.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	125	2,170.00	271,250.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	11,510.00	506,440.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	115,300.00	461,200.00	
	NESTLE SA-REG	111,133	123.18	13,689,362.94	
	ALCON INC	18,824	78.16	1,471,283.84	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,231	390.60	871,428.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	425	2,013.00	855,525.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,898	712.60	2,065,114.80	

	NOVARTIS AG-REG	85,643	76.09	6,516,575.87	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,230	409.60	503,808.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,173	364.30	9,899,123.90	
	VIFOR PHARMA AG	1,940	119.10	231,054.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	890	74.20	66,038.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,638	9.39	983,178.64	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,170	65.40	534,318.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	1,655.00	1,456,400.00	
	UBS GROUP AG-REG	142,382	16.74	2,383,474.68	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,630	146.30	238,469.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,180	511.80	603,924.00	
	SWISS RE AG	12,249	90.82	1,112,454.18	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,611	412.30	2,313,415.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	93.70	239,028.70	
	TEMENOS AG	2,640	137.90	364,056.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	72.40	482,184.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,094	500.80	547,875.20	
	スイスフラン小計	679,361		61,493,606.51 (7,657,183,882)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,540	354.90	3,030,846.00	
	BOLIDEN AB	10,890	297.80	3,243,042.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	22,310	133.55	2,979,500.50	
	ALFA LAVAL AB	10,550	369.50	3,898,225.00	
	ASSA ABLOY AB-B	38,560	255.10	9,836,656.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,725	546.80	14,066,430.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,390	463.80	7,137,882.00	
	EPIROC AB-A	27,585	221.00	6,096,285.00	
	EPIROC AB-B	15,450	189.30	2,924,685.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	129.60	1,944,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	329.90	2,243,320.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,100	130.95	7,346,295.00	
	SANDVIK AB	45,770	221.00	10,115,170.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,410	219.80	2,507,918.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	208.00	2,928,432.00	
	VOLVO AB-A SHS	7,120	209.00	1,488,080.00	

	VOLVO AB-B SHS-B	57,670	205.80	11,868,486.00	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	140.40	2,053,911.60	
	ELECTROLUX AB-B	8,095	201.00	1,627,095.00	
	EVOLUTION AB	6,800	1,357.80	9,233,040.00	
	EMBRACER GROUP AB	18,620	83.56	1,555,887.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,138	172.20	5,189,763.60	
	ICA GRUPPEN AB	4,230	471.60	1,994,868.00	
	SWEDISH MATCH AB	63,200	72.14	4,559,248.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,065	284.50	5,992,992.50	
	NORDEA BANK ABP	128,442	109.02	14,002,746.84	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	140.30	8,761,735.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	47,710	102.05	4,868,805.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	36,220	192.00	6,954,240.00	
	EQT AB	10,680	500.20	5,342,136.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	291.00	1,450,344.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	286.50	1,713,270.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	209.15	14,504,552.50	
	KINNEVIK AB - B	10,215	343.00	3,503,745.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,370	511.20	1,211,544.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,570	646.20	2,953,134.00	
	SINCH AB	18,850	122.05	2,300,642.50	
	ERICSSON LM-B SHS	115,425	95.00	10,965,375.00	
	HEXAGON AB-B SHS	78,890	143.00	11,281,270.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,705	121.05	2,264,240.25	
	TELIA CO AB	94,230	34.39	3,240,569.70	
	スウェーデンクローナ小計	1,264,797		221,180,408.69 (2,930,640,415)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	37,444	225.95	8,460,471.80	
	NORSK HYDRO A S	53,840	60.96	3,282,086.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,660	461.00	3,531,260.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	149.95	1,709,430.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,830	387.40	1,483,742.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,420	443.20	1,072,544.00	
	MOWI ASA	15,340	242.20	3,715,348.00	
	ORKLA ASA	22,670	86.38	1,958,234.60	

	DNB BANK ASA	39,765	215.60	8,573,334.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,810	216.70	1,475,727.00	
	TELENOR ASA	23,915	136.75	3,270,376.25	
ノルウェークローネ小計		225,094		38,532,554.05	(512,097,643)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	515.00	1,977,600.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	476.20	3,769,123.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	385	3,042.00	1,171,170.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	39,180	210.00	8,227,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	140	18,740.00	2,623,600.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	223	19,405.00	4,327,315.00	
	DSV A/S	7,650	1,538.00	11,765,700.00	
	PANDORA A/S	4,080	911.60	3,719,328.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	1,099.50	4,343,025.00	
	AMBU A/S-B	6,780	171.60	1,163,448.00	
	COLOPLAST-B	4,275	1,056.50	4,516,537.50	
	DEMANT A/S	4,410	333.80	1,472,058.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	400.60	1,990,982.00	
	GENMAB A/S	2,560	3,006.00	7,695,360.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	65,265	725.50	47,349,757.50	
	DANSKE BANK A/S	20,705	109.45	2,266,162.25	
TRYG A/S	15,435	156.25	2,411,718.75		
ORSTED A/S	7,340	876.20	6,431,308.00		
デンマーククローネ小計		199,103		117,221,993.00	(2,070,140,396)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	31.95	280,361.25	
	OIL SEARCH LTD	77,602	4.23	328,256.46	
	SANTOS LTD	65,495	6.83	447,330.85	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	6,600	32.30	213,180.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,333	22.58	865,559.14	
	BHP GROUP LTD	114,106	36.09	4,118,085.54	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.42	373,890.20	
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	3.72	256,680.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,085	14.27	943,032.95	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	17,805	54.85	976,604.25	

NEWCREST MINING LTD	30,209	25.06	757,037.54
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	9.60	405,024.00
ORICA LIMITED	12,135	15.61	189,427.35
RIO TINTO LTD	14,138	88.81	1,255,595.78
SOUTH32 LTD	205,747	3.50	720,114.50
REECE LTD	10,200	21.49	219,198.00
BRAMBLES LTD	62,498	10.46	653,729.08
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.41	250,873.70
QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	5.62	247,280.00
SYDNEY AIRPORT	47,076	8.23	387,435.48
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	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	20.60	856,960.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	43.30	2,762,540.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.70	1,605,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	46.40	1,160,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	75.65	4,501,175.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.74	735,300.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	384,237	11.86	4,557,050.82	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	47.15	2,593,250.00	
香港ドル小計		3,263,081		137,596,821.10 (2,008,913,588)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	5.26	280,673.60	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,900	3.82	198,258.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.28	284,592.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.79	166,769.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.45	329,122.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,715	32.29	2,315,677.35	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	137,740	11.97	1,648,747.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	27.59	1,153,262.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,700	9.55	283,635.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,500	3.43	406,455.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.23	125,079.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	7.12	110,716.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.58	183,942.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	369,180	2.54	937,717.20	
		1,255,605		8,424,645.95	

シンガポールドル小計				(708,849,710)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	27.46	716,431.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	489.60	587,520.00	
	BANK HAPOLIM BM	45,535	31.15	1,418,415.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	30.56	1,742,072.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	40,300	19.27	776,581.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	113.70	557,130.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	314.90	421,966.00	
	NICE LTD	2,565	862.10	2,211,286.50	
イスラエルシュケル小計		178,935		8,431,402.95	(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	
			108,638	978,420.85	

英ポンド小計				(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
豪ドル小計			808,479	4,360,007.40 (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
資産の部		
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

2020年11月 6日現在

2021年11月 8日現在

負債の部		
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
純資産の部		
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 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
国債証券	52,169,736
地方債証券	112,000
特殊債証券	247,000
社債証券	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
特殊債証券	2,872,940
社債証券	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
第334回利付国債(10年)	120,000,000	122,246,400
第335回利付国債(10年)	490,000,000	498,726,900
第336回利付国債(10年)	80,000,000	81,536,000
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,393,600
第338回利付国債(10年)	390,000,000	396,770,400
第339回利付国債(10年)	370,000,000	376,907,900
第340回利付国債(10年)	420,000,000	428,475,600
第341回利付国債(10年)	700,000,000	711,998,000
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,166,100
第343回利付国債(10年)	245,000,000	247,383,850
第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,513,000
第345回利付国債(10年)	610,000,000	616,423,300
第346回利付国債(10年)	690,000,000	697,617,600
第347回利付国債(10年)	160,000,000	161,851,200
第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,061,100
第349回利付国債(10年)	590,000,000	597,251,100
第350回利付国債(10年)	680,000,000	688,262,000
第351回利付国債(10年)	535,000,000	541,575,150
第352回利付国債(10年)	590,000,000	597,327,800
第353回利付国債(10年)	300,000,000	303,861,000
第354回利付国債(10年)	325,000,000	329,085,250
第355回利付国債(10年)	250,000,000	253,057,500
第356回利付国債(10年)	200,000,000	202,368,000
第357回利付国債(10年)	720,000,000	728,200,800
第358回利付国債(10年)	660,000,000	667,464,600
第359回利付国債(10年)	550,000,000	555,692,500
第360回利付国債(10年)	200,000,000	201,862,000
第361回利付国債(10年)	70,000,000	70,573,300
第362回利付国債(10年)	250,000,000	251,750,000
第363回利付国債(10年)	200,000,000	201,148,000
第1回利付国債(30年)	50,000,000	61,200,500

第3回利付国債(30年)	70,000,000	83,905,500	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	96,489,600	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	61,665,000	
第8回利付国債(30年)	80,000,000	94,844,000	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	137,568,240	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	189,754,950	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	45,322,200	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,301,000	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	140,420,500	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	51,198,000	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	52,445,200	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	90,113,800	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	92,278,900	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	72,751,250	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	90,183,640	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	78,024,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	224,226,600	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	119,371,250	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	194,005,440	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	235,324,320	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	194,864,670	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	157,586,400	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	213,636,800	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	173,646,450	
第34回利付国債(30年)	180,000,000	238,858,200	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	217,460,880	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	175,497,300	
第37回利付国債(30年)	161,000,000	206,904,320	
第38回利付国債(30年)	95,000,000	120,577,800	
第39回利付国債(30年)	115,000,000	148,573,100	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	114,525,900	
第41回利付国債(30年)	90,000,000	112,851,900	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	169,453,350	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	194,762,150	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	188,673,000	
第45回利付国債(30年)	160,000,000	194,558,400	
第46回利付国債(30年)	160,000,000	194,686,400	
第47回利付国債(30年)	165,000,000	204,624,750	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	101,633,650	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	167,472,200	
第50回利付国債(30年)	95,000,000	100,642,050	
第51回利付国債(30年)	90,000,000	84,938,400	

第52回利付国債(30年)	130,000,000	128,437,400	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	106,040,550	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	116,119,300	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	116,042,300	
第56回利付国債(30年)	90,000,000	94,771,800	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	105,227,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	105,029,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	174,100,400	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	128,625,600	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	102,093,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	116,223,600	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	84,633,300	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	93,770,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	102,852,200	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	168,217,200	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	108,150,900	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	137,628,400	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	111,073,600	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	110,944,900	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	120,889,200	
第72回利付国債(30年)	40,000,000	40,248,400	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	137,352,084	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	33,664,950	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	299,958,950	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	27,407,700	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	31,955,420	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	56,031,480	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	104,266,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	35,378,360	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	35,616,020	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	82,261,140	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	110,849,440	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	119,125,440	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	120,464,780	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	126,163,240	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,746,800	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	22,426,740	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	42,852,400	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	172,238,400	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	65,143,800	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	143,120,900	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	333,507,000	

第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,802,560	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	279,387,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	66,799,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	66,806,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	55,941,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	93,130,680	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	110,196,100	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	51,103,800	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	106,195,560	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	132,828,930	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	34,393,500	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	76,509,840	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	94,382,010	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,744,160	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	37,793,580	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	88,583,110	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,314,680	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	150,270,900	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	152,977,080	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	30,934,440	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	113,729,980	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,319,750	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	93,212,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	339,218,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	61,056,320	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	147,787,500	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	160,293,600	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	404,390,140	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,742,400	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	34,709,400	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	193,754,100	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,716,020	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	19,720,680	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	232,207,950	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	106,353,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	60,182,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	124,420,800	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	58,780,500	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	76,611,600	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	99,370,100	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	175,762,500	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	13,943,280	

第132回利付国債(20年)	135,000,000	157,173,750	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,229,000	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	141,277,200	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	35,010,900	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	254,485,000	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	233,966,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	137,856,000	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	266,641,300	
第140回利付国債(20年)	358,000,000	419,780,060	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	229,162,050	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	148,272,500	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	109,651,000	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	496,774,700	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	419,230,150	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	159,761,700	
第147回利付国債(20年)	98,000,000	115,041,220	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	104,742,000	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	134,048,600	
第150回利付国債(20年)	140,000,000	161,674,800	
第151回利付国債(20年)	140,000,000	158,292,400	
第152回利付国債(20年)	300,000,000	339,474,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	309,352,500	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	181,337,600	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	298,825,200	
第156回利付国債(20年)	160,000,000	163,552,000	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	148,942,500	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	175,963,600	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	157,300,500	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	148,877,400	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	125,743,200	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	157,051,500	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	172,606,500	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	262,338,900	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	174,688,600	
第166回利付国債(20年)	100,000,000	105,910,000	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	164,006,400	
第168回利付国債(20年)	100,000,000	100,653,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	158,017,600	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	138,010,600	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	167,269,800	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	230,000,000	
第173回利付国債(20年)	150,000,000	149,740,500	

	第174回利付国債（20年）	200,000,000	199,300,000	
	第175回利付国債（20年）	140,000,000	141,855,000	
	第176回利付国債（20年）	160,000,000	161,856,000	
	第177回利付国債（20年）	150,000,000	148,782,000	
	第178回利付国債（20年）	70,000,000	70,702,100	
国債証券 合計		34,109,000,000	37,223,310,744	
地方債証券	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,701,000	
	第712回東京都公募公債	200,000,000	201,327,600	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	101,566,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	101,497,000	
	第736回東京都公募公債	100,000,000	101,447,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,887,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	102,066,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債（5年）	100,000,000	99,976,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	102,016,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	203,180,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	203,530,000	
	平成26年度第12回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	203,040,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,075,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	200,000,000	203,388,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	106,721,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	100,803,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,401,000	
	第10回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	101,369,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,531,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,601,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,695,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,527,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,182,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,569,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,970,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,382,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	100,725,021	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	100,491,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,910,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	100,998,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,875,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債（10年）	40,000,000	40,181,680	
	第486回名古屋市公募公債（10年）	200,000,000	203,274,000	
	平成27年度第5回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,800,000	
	第51回川崎市公募公債（5年）	100,000,000	100,013,704	
	第53回川崎市公募公債（5年）	100,000,000	100,049,000	

	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,996,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	100,061,000	
	平成25年度第2回福井県公募公債	200,000,000	202,666,000	
地方債証券 合計		4,740,000,000	4,809,488,005	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,658,250	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,474,000	
	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,727,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,638,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	202,898,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,722,560	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,461,000	
	第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,668,480	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	200,000,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,952,000	
	第17回道路債券	100,000,000	101,711,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,134,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,669,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,967,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,591,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,342,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,389,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,419,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,697,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,044,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,942,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,862,000	
	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,081,000	
	第13回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,768,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,056,000	
	F54回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,736,000	
	第56回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,724,000	
	第60回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,847,000	
	第62回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,698,000	
	F63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,669,000	
第74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,893,000		
第81回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,774,000		
第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,104,000		

	第 9 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,671,000	
	F 1 0 1 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,644,000	
	第 1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,318,000	
	F 2 9 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,657,000	
	第 3 5 回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	100,921,000	
	第 5 2 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,768,000	
	第 3 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	101,721,000	
	第 1 9 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,396,000	
	第 3 5 7 回信金中金債（5 年）	100,000,000	99,985,000	
	第 3 6 3 回信金中金債（5 年）	100,000,000	99,917,000	
	第 2 9 回国際協力機構債券	100,000,000	102,033,000	
	第 3 7 回国際協力機構債券	100,000,000	100,388,000	
特殊債券 合計		5,200,000,000	5,299,735,290	
社債券	第 1 5 回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,618,000	
	第 2 5 回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付）	100,000,000	101,505,000	
	第 5 回不二製油グループ本社株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,202,000	
	第 2 1 回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	200,000,000	200,392,000	
	第 1 1 回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,326,000	
	第 2 9 回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,663,000	
	第 8 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,734,089	
	第 9 8 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,561,000	
	第 6 3 回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	201,768,000	
	第 2 0 回 K D D I 株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,477,000	
	第 2 6 回 K D D I 株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,028,000	
	第 1 9 回 N T T ファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,280,000	
社債券 合計		1,400,000,000	1,415,554,089	
合計		45,449,000,000	48,748,088,128	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年11月 6日現在	2021年11月 8日現在
資産の部		
流動資産		
預金	101,245,794	298,560,533
コール・ローン	82,145,228	35,325,662
国債証券	151,146,024,706	159,432,757,316
派生商品評価勘定	-	98,150
未収利息	975,927,211	932,284,808
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	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年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	66,109,940,367円	62,261,620,781円
	期首からの追加設定元本額	7,395,350,288円	5,112,330,712円
	期首からの一部解約元本額	11,243,669,874円	5,656,220,426円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	13,675,807,907円	14,925,804,783円
	DCインデックスバランス（株式20）	295,093,711円	353,460,353円
	DCインデックスバランス（株式40）	376,111,949円	470,928,531円
	DCインデックスバランス（株式60）	474,657,419円	619,582,841円
	DCインデックスバランス（株式80）	363,175,635円	507,904,451円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	22,033,058,132円	20,202,755,754円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,007,884,611円	2,289,679,949円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	15,811,534,905円	14,454,175,581円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,006,798,808円	896,739,833円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	150,608,646円	157,019,480円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	- 円	31,637,570円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,599,441円	2,796,840円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2,810,203円	3,277,904円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,167,512円	6,106,515円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	11,212,682円	10,284,275円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	792,797,616円	1,750,123,599円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	782,118,041円	740,459,525円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,424,959円	61,334,317円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	84,106,678円	87,993,007円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	82,193,886円	90,122,520円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	58,416,254円	64,628,132円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,903,607,480円	3,711,137,127円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,434,306円	279,778,180円
	計	62,261,620,781円	61,717,731,067円
2.	受益権の総数	62,261,620,781口	61,717,731,067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 「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
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

(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	2,4448円	1口当たり純資産額	2,6026円
(1万口当たり純資産額)	(24,448円)	(1万口当たり純資産額)	(26,026円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.875%-22/10/31	3,000,000.00	3,050,538.90	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	2,400,000.00	2,443,243.68	
		US TREASURY N/B-0.125%-22/10/31	8,000,000.00	7,997,890.64	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	2,000,000.00	2,029,868.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,475,985.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,072,791.36	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,986,454.81	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,046,816.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,038,085.80	
		US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,622,184.73	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/01/31	3,000,000.00	2,997,363.27	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,352,558.45	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,522,294.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,152,130.84	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	907,689.02	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,007,304.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,035,117.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,196,770.38	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,499,931.64	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,183,267.86	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,731,835.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,709,107.19	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,962,865.05	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,531,435.50	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,349,841.74	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,497,998.05	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,526,572.20	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	2,350,000.00	2,439,180.62	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,671,258.59	
		US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,047,695.20	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,125,214.60	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/31	7,000,000.00	6,974,843.75	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,501,751.92	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	3,860,000.00	3,845,298.84	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	4,550,000.00	4,633,801.44			
US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,986,933.59			
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,547,119.00			
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	691,053.46			
US TREASURY N/B-0.25%-23/09/30	3,500,000.00	3,492,617.17			

US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,393,082.02	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,740,872.93	
US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	943,857.36	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,187,812.40	
US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	8,000,000.00	7,973,593.76	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,773,014.76	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,900,711.95	
US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,979,785.16	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,076,445.20	
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,584,092.75	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,078,632.80	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,633,055.26	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,468,609.21	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,556,044.80	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,700,134.49	
US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,968,457.05	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	4,006,332.98	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,071,992.00	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,125,449.20	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,543,982.72	
US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,600,000.00	2,579,382.80	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	4,010,589.74	
US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,659,425.79	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,385,351.39	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,740,683.12	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,593,052.88	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	2,640,000.00	2,722,860.88	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,843,781.25	
US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,967,578.10	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,469,838.59	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,340,294.85	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	2,100,676.79	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,254,183.58	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,141,306.62	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,905,882.29	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	1,650,000.00	1,728,310.48	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,461,550.72	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,556,004.29	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,991,548.65	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,342,580.07	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,585,165.95	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,670,000.00	3,746,195.43	

US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,870,000.00	5,068,224.09
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,195,670.15
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,558,738.56
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	4,400,000.00	4,672,593.64
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,555,986.52
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,356,878.70
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,118,799.80
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	5,019,656.16
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,233,127.86
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	1,979,955.07
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,464,107.21
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,547,128.08
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,933,613.27
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,233,937.84
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,211,230.30
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,082,425.37
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	320,000.00	312,293.75
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,515,199.14
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	3,800,000.00	3,702,253.89
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,412,961.75
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,423,563.24
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,344,853.50
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,138,632.80
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,978,885.61
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	5,000,000.00	4,878,808.60
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,182,429.62
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,401,412.60
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,906,035.31
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,578,069.34
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,183,566.82
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,376,140.61
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	6,100,000.00	6,471,599.19
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,711,048.03
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,974,706.88
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,877,909.68
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,079,179.60
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	2,960,000.00	3,077,416.98
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	3,198,875.00
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,087,968.40
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,959,804.68
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,665,530.74
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,976,210.93
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,519,623.85

US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	3,180,896.70	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,951,335.22	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,069,296.80	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,043,125.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	360,000.00	381,171.06	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	1,001,484.30	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,179,182.81	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	966,250.00	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,765,034.46	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,543,875.00	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,500,000.00	3,374,765.62	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,913,515.62	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	3,139,391.98	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,100,000.00	2,019,117.19	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,590,000.00	4,376,995.31	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	5,000,000.00	4,796,289.05	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,686,271.73	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,203,972.05	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,818,151.56	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	5,000,000.00	4,852,246.10	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,367,421.60	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,210,000.00	3,189,247.85	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	3,960,000.00	3,957,060.92	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,366,577.36	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,438,631.25	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	4,292,525.39	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	3,291,814.44	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,863,596.07	
US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	500,000.00	637,050.75	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,633,125.00	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,853,078.12	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,356,183.16	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,061,593.74	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	1,870,000.00	2,039,797.30	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,168,498.95	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,140,000.00	3,208,564.72	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	2,890,000.00	2,980,255.85	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,386,875.03	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,478,824.12	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	4,309,131.42	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,764,418.96	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	5,834,930.66	

US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	890,278.09
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	8,400,000.00	8,190,000.00
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	7,612,068.37
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,650,000.00	4,564,628.88
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	1,112,890.56
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,105,737.30
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	934,283.57
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	1,018,181.23
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	1,013,874.96
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	2,006,125.89
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	2,023,638.59
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,054,863.22
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	985,003.86
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,245,067.43
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,264,816.39
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,916,156.16
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	1,700,000.00	1,496,033.20
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,406,661.64
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,844,492.17
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,220,117.15
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	700,000.00	698,796.87
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,235,671.87
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	3,000,000.00	3,179,062.50
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,262,474.97
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	606,796.85
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	918,374.96
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,296,250.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	2,146,095.09
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,402,263.59
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	2,553,128.76
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	2,788,966.01
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	1,418,955.40
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,400,000.00	3,048,515.52
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,633,791.92
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,768,175.58
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,663,128.70
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,691,894.40
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	3,400,000.00	4,032,054.56
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	2,700,000.00	3,273,644.43
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,123,804.60
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,790,380.75
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,295,670.88
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,391,953.00

		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,427,210.92
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,288,129.52
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,348,515.60
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,338,053.64
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,384,648.30
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	3,024,750.00
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	5,059,335.63
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,893,193.17
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	4,088,777.22
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,640,195.20
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	3,180,410.93
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,434,157.99
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	3,788,380.79
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	2,098,243.16
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	2,269,932.42
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	2,818,828.14
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	4,730,703.12
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	4,559,968.75
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	2,052,187.40
米ドル小計			622,720,000.00	654,175,929.30 (74,327,469,087)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-22/11/01	1,440,000.00	1,434,342.24
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/02/01	770,000.00	765,501.66
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,238,794.09
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/05/01	740,000.00	734,040.78
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,030,928.28
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/08/01	810,000.00	801,368.64
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,498,807.59
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	500,000.00	495,788.50
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	812,782.02
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	950,000.00	932,838.25
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,161,641.60
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	804,275.26
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	612,078.27
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	985,767.50
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,105,464.66
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	951,212.04
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	776,618.92
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,440,000.00	1,415,789.28
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	636,462.45
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	732,377.05
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	720,000.00	940,201.20

		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	574,000.00	606,825.33	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	2,151,241.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,005,000.00	914,898.73	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	620,000.00	614,578.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,117,234.76	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	600,000.00	859,143.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	820,000.00	1,101,602.76	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	990,000.00	1,286,065.44	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	945,000.00	1,102,308.48	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,703,000.00	2,723,018.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	160,000.00	150,948.16	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	401,591.30	
加ドル小計			33,357,000.00	34,896,537.31	(3,182,564,202)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	13,100,000.00	13,157,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,200,000.00	16,564,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	17,900,000.00	18,364,281.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	16,700,000.00	18,093,406.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	23,014,765.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,100,000.00	20,363,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	19,870,000.00	21,341,621.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	16,900,000.00	17,438,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,300,000.00	6,510,656.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	4,100,000.00	5,036,593.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	14,150,000.00	15,299,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	12,500,000.00	12,597,656.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	14,002,543.75	
メキシコペソ小計			195,640,000.00	201,785,524.99	(1,125,983,407)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	243,038.40	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	855,000.00	897,507.86	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	615,000.00	626,876.88	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	975,000.00	1,061,411.71	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	840,000.00	870,413.04	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,395,000.00	1,467,413.05	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	822,502.72	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,132,000.00	1,212,130.88	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	930,000.00	995,020.95	

BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	506,531.32
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,320,000.00	1,826,763.84
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,038,289.43
BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,120,000.00	1,216,673.68
BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	816,147.44
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	1,101,950.00
BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	390,000.00	388,845.60
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	935,113.08
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	910,000.00	1,032,626.14
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	735,474.49
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,305,000.00	2,135,949.61
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	496,154.35
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-1.45%-27/10/31	1,600,000.00	1,749,163.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	910,000.00	911,481.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,470,000.00	1,605,792.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,475,000.00	1,615,853.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,155,000.00	1,570,031.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,745,000.00	2,500,972.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,345,000.00	1,482,215.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,470,000.00	1,523,815.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,420,000.00	1,455,588.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,430,000.00	1,644,095.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,660,000.00	1,806,559.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,455,000.00	1,424,084.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	810,000.00	818,045.73	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,500,000.00	2,345,787.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,370,000.00	1,657,631.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,415,000.00	1,637,329.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,400,000.00	2,115,577.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	674,299.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,260,000.00	2,158,841.16	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	1,047,031.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,400,000.00	2,373,791.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	300,000.00	302,906.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	990,000.00	1,847,284.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,170,000.00	1,644,836.31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	1,352,312.41
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	1,119,187.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	1,363,249.04
BUNDES OBLIGATION-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,769,493.25
BUNDES OBLIGATION-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,121,966.17
BUNDES OBLIGATION-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,324,022.70
BUNDES OBLIGATION-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,389,311.53
BUNDES OBLIGATION-0.0%-25/04/11	1,550,000.00	1,586,750.50
BUNDES OBLIGATION-0.0%-25/10/10	660,000.00	677,315.10
BUNDES OBLIGATION-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
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	460,357.84
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	285,255.00
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	487,437.62
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	112,000.00	113,482.43
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	525,000.00	568,238.47
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	413,794.66
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	400,000.00	397,273.20
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	220,000.00	219,446.92
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	325,000.00	482,097.20
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	329,675.32
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	232,402.00
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	435,715.23
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	2,830,000.00	2,859,344.27
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,090,142.40
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,282,721.76
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,630,000.00	3,988,825.50
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25	1,140,000.00	1,158,044.48
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,429,517.69
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,824,000.00	3,036,930.16
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,758,000.00	2,959,811.13
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,635,000.00	2,687,697.36
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,710,751.22
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,550,000.00	3,222,014.25
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,770,000.00	2,943,845.20
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,838,968.20
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,623,260.05
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,275,000.00	2,377,538.80
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	3,010,000.00	3,115,494.48
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	360,000.00	367,538.40
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,615,000.00	2,820,104.91

FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,350,000.00	3,985,052.80
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,250,000.00	3,475,017.00
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,030,000.00	3,246,102.01
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,745,000.00	3,933,337.95
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,780,000.00	2,925,263.34
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,780,000.00	2,809,720.98
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	3,275,000.00	4,016,345.37
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	3,169,000.00	3,181,863.54
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,560,000.00	4,073,772.08
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,165,000.00	2,151,683.08
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,540,000.00	4,129,073.27
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,745,000.00	3,096,299.61
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,735,000.00	2,785,827.04
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,825,000.00	3,203,018.90
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,810,000.00	2,900,353.05
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,340,000.00	2,895,019.92
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,338,716.75
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	960,000.00	948,182.40
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,630,000.00	2,608,557.46
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,830,000.00	2,449,041.42
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	2,090,000.00	2,535,629.80
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	2,370,000.00	2,384,132.31
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,300,000.00	2,564,814.20
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,140,000.00	2,364,686.04
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,109,088.75
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	440,000.00	467,444.20
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	500,000.00	548,838.85
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	760,000.00	914,295.96
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	775,000.00	828,775.70
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	505,416.87
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	559,798.20
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	700,000.00	766,472.98
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	651,000.00	789,314.71
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	177,000.00	180,114.49
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	650,000.00	733,312.45
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	555,000.00	548,653.57
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	399,739.94
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	314,045.81
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	468,358.80
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	251,598.00
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	589,000.00	776,478.70
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	519,000.00	624,126.04
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	374,448.67

NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	525,000.00	577,061.62
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,070,000.00	1,116,676.61
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	980,000.00	996,299.36
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,085,000.00	1,165,342.29
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,305,000.00	1,347,827.49
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,240,000.00	1,303,432.19
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	968,000.00	993,316.08
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,125,000.00	1,205,215.65
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	825,000.00	1,133,398.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	1,036,027.19
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	280,000.00	286,562.64
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	765,000.00	798,115.32
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	875,000.00	892,653.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	580,000.00	588,798.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,025,000.00	1,325,757.55
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,846,895.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	100,000.00	98,503.94
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	1,073,000.00	1,158,546.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,240,000.00	2,158,356.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,248,000.00	2,076,356.25
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	685,000.00	651,444.59
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	240,086.45
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	702,603.49
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	190,163.32
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	720,000.00	750,576.24
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	434,515.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	577,090.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	950,000.00	996,591.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	564,825.72
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	914,228.67
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	200,000.00	204,064.40
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	761,167.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	600,000.00	744,209.40
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	1,003,000.00	1,066,389.60
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	721,091.28
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	945,315.60
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	706,019.16
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	640,000.00	674,988.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	740,000.00	748,874.08
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	668,860.10
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	610,000.00	787,240.31
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	215,000.00	214,658.58

		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,030,000.00	1,654,134.68
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	260,000.00	243,627.71
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	464,000.00	754,073.08
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	637,201.90
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	335,000.00	362,181.90
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	312,000.00	675,230.07
ユーロ小計			408,884,000.00	481,184,189.03 (63,193,919,545)
英債券	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	870,992.72
		UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,710,000.00	1,708,033.50
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,310,000.00	1,355,801.26
		UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,530,000.00	1,520,908.74
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,130,000.00	1,147,901.46
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	932,936.90
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,387,489.05
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	819,632.12
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	1,010,000.00	995,829.70
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	859,436.09
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,590,000.00	1,652,964.00
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,109,073.78
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	845,000.00	820,811.03
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	890,000.00	951,588.00
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	974,169.70
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	868,198.00
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,220,000.00	1,178,703.00
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,451,372.98
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,260,000.00	1,191,267.00
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,839,060.60
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	120,000.00	120,020.61
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,355,972.57
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,057,000.00	1,005,629.80
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,370,000.00	1,970,254.54
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,586,926.32
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,010,000.00	1,606,287.84
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,481,367.12
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	1,456,416.21
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	595,000.00	615,047.69
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,333,453.83
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,615,000.00	2,314,539.18
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,450,000.00	2,180,373.99
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	416,819.61
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,275,000.00	2,171,286.75

		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,460,000.00	1,613,095.60
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	791,548.20
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	1,603,870.43
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	540,000.00	488,625.48
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,107,000.00	1,911,622.95
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	747,758.22
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,062,000.00	2,066,280.30
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,332,470.67
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	926,000.00	1,845,666.16
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	830,000.00	720,824.78
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	980,000.00	1,975,068.48
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,405,000.00	1,415,748.25
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	937,923.00
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,177,000.00	1,870,017.60
英債券小計			50,057,000.00	63,571,085.81 (9,738,454,635)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,960,000.00	7,199,570.16
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,220,000.00	5,699,420.98
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,200,000.00	5,458,258.00
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	4,119,350.32
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	4,400,000.00	4,602,444.00
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,571,716.68
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	2,174,418.00
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,385,000.00	5,090,583.36
スウェーデンクローナ小計			33,515,000.00	36,915,761.50 (489,133,839)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,520,000.00	5,594,903.08
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,511,282.44
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,390,000.00	3,430,171.50
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,756,438.02
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,640,000.00	2,679,309.60
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	2,823,844.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	2,815,995.85
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,550,000.00	3,507,577.50
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,987,266.00
ノルウェークローネ小計			29,740,000.00	30,106,787.99 (400,119,212)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.25%-22/11/15	4,400,000.00	4,441,663.15
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	4,040,000.00	4,219,121.48
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,260,000.00	1,281,609.00
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,110,000.00	5,578,722.92
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,510,000.00	4,739,879.21

		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,830,000.00	2,991,437.35	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,150,000.00	1,154,814.93	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,080,000.00	19,938,978.54	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	1,292,538.00	
デンマーククローネ小計			35,680,000.00	45,638,764.58	(805,980,582)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,103,759.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-23/04/25	1,430,000.00	1,377,733.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,750,000.00	1,795,325.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	2,101,053.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,430,000.00	2,398,215.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,347,724.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,690,000.00	2,740,894.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,090,000.00	3,061,911.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,750,000.00	1,550,517.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,340,000.00	2,310,633.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,260,429.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	670,079.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	3,145,000.00	3,132,797.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,125,000.00	1,864,050.00	
		ポーランドズロチ小計			29,215,000.00
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-22/11/21	1,360,000.00	1,388,659.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,650,000.00	1,770,870.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	855,000.00	898,445.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,535,000.00	1,504,062.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,220,000.00	1,309,670.36	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,110,000.00	1,068,383.46	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,280,000.00	1,445,765.88	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,340,000.00	1,287,768.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,270,000.00	1,494,238.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,160,000.00	1,246,412.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	1,050,000.00	1,097,846.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	840,000.00	906,110.77	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,130,000.00	1,260,370.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,200,000.00	1,298,336.16	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,750,000.00	1,860,983.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,700,000.00	1,591,973.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,678,000.00	1,636,609.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,920,000.00	1,777,784.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,491,022.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	790,000.00	780,485.74	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,316,663.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	574,148.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	903,496.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	748,616.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	890,000.00	932,334.18	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	870,000.00	945,350.09	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	855,277.59	
豪ドル小計			32,175,000.00	33,391,686.52 (2,804,901,667)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	630,000.00	639,198.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	563,366.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	300,000.00	307,825.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	570,780.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	410,000.00	428,860.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	349,000.00	340,658.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	487,813.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	475,000.00	523,806.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	308,125.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	541,150.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	587,412.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	210,000.00	207,770.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	405,000.00	465,547.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	514,642.23	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	230,120.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	372,000.00	412,763.76	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	457,000.00	511,154.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	432,000.00	413,208.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	150,000.00	144,971.25	
シンガポールドル小計			7,796,000.00	8,199,173.04 (689,878,419)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	643,387.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	700,000.00	717,465.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	790,848.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	860,959.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	520,000.00	535,650.23	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,650,000.00	1,709,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	806,910.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	950,000.00	985,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,133,550.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,349,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	780,000.00	722,280.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	739,745.44	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,069,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	850,000.00	867,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	890,000.00	945,625.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	637,353.69	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,270,000.00	1,195,705.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	610,811.94	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	748,621.58	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	840,014.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,010,000.00	961,772.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,130,000.00	1,148,362.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	976,190.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,070,000.00	1,128,623.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	462,989.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	960,450.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,220,000.00	1,241,960.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	962,164.38	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,071,617.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	967,816.04	
マレーシアリングット小計			27,210,000.00	27,792,722.60	(759,869,711)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.36%-23/07/02	3,000,000.00	2,994,898.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	3,000,000.00	3,022,140.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	1,000,000.00	976,882.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	3,000,000.00	3,040,200.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	2,000,000.00	2,003,658.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	3,000,000.00	3,023,859.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	2,000,000.00	2,055,390.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	2,000,000.00	2,127,073.00	
中国元小計			19,000,000.00	19,244,100.50	(341,704,021)
イスラエル エルシュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,013,356.20	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,320,000.00	1,396,164.00	
		ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	1,160,000.00	1,159,126.85	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,250,000.00	1,283,159.25	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,534,026.00	
		ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	130,000.00	129,518.37	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,355,390.96	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,303,904.14	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	523,770.32	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,100,000.00	1,391,823.18	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,343,596.50	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,250,000.00	1,349,413.50	

	ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,615,000.00	1,585,526.25	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,160,000.00	1,096,265.87	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,330,000.00	2,097,555.76	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,620,000.00	2,053,674.00	
イスラエルシェケル小計		18,755,000.00	20,616,271.15 (752,778,401)	
合計			159,432,757,316 (159,432,757,316)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 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60）】

【純資産額計算書】

資産総額	15,788,315,027円
負債総額	9,489,082円
純資産総額（ - ）	15,778,825,945円
発行済口数	5,958,013,765口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6483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		

その他有価証券評価差額金	60	1,461
繰延ヘッジ損益	389	115
評価・換算差額等合計	329	1,577
純資産合計	77,402	84,049
負債純資産合計	95,220	107,145

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		99		75
受取配当金	1	4,881	1	2,555
有価証券償還益		-		14
デリバティブ収益		223		-
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		5		-
その他		145		62
営業外収益合計		5,357		2,710
営業外費用				
支払利息		185		122
有価証券償還損		0		-
デリバティブ費用		-		804
時効成立後支払分配金・償還金		1		25
為替差損		-		59
その他		12		42
営業外費用合計		199		1,054
経常利益		14,695		12,367
特別利益				
投資有価証券売却益		164		774
その他		-		0
特別利益合計		164		774
特別損失				
投資有価証券売却損		19		237
投資有価証券評価損		21		5
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		-		125
特別損失合計		41		369
税引前当期純利益		14,818		12,773
法人税、住民税及び事業税		3,307		3,722
法人税等調整額		45		373
法人税等合計		3,353		3,348
当期純利益		11,465		9,424

(3) 【株主資本等変動計算書】

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212

当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	8,252	8,252	71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073

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

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073
当期変動額							
剰余金の配当				2,862	2,862		2,862
当期純利益				9,424	9,424		9,424
自己株式の取得						1,161	1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,561	6,561	1,161	5,399
当期末残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

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

<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対して保証を行っております。</p>	
--	--

（損益計算書関係）

第61期 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	第62期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 4,849百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 2,498百万円</p>

（株主資本等変動計算書関係）

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

（変動事由の概要）

2019年8月13日の取締役会決議による自己株式の取得 88,800株

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	871,200	1,184,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	2,272,000	1,346,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,417,000	2,394,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,417,000	2,939,000	-
合計		15,088,300	-	7,224,600	7,863,700	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(変動事由の概要)

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

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見

積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	-	-	-
未収委託者報酬	16,912	-	-	-
未収収益	1,412	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,698	24,698	-
(2) 未収委託者報酬	24,738	24,738	-
(3) 未収収益	891	891	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,403	2,403	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,905	22,905	-
(6) 未払金	(9,834)	(9,834)	-
(7) 未払費用	(4,660)	(4,660)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(188)	(188)	-
ヘッジ会計が適用されているもの デリバティブ取引計	(453) (642)	(453) (642)	- -

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上流動負債のその他

に含まれております。

- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式(貸借対照表計上額23,094百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

合計	1,913	-	41	41
----	-------	---	----	----

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,808	-	15	15
合計		1,808	-	15	15

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第62期(2021年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
----	--	---------------	-------------------------	-------------	---------------

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,713	-	112	112
	合計	1,713	-	112	112

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751

(退職給付関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

退職給付債務	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31

貸借対照表に計上された負債の額	1,395
-----------------	-------

退職給付引当金	1,395
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,395
-----------------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
------	-----

利息費用	1
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	6
----------------	---

確定給付制度に係る退職給付費用	154
-----------------	-----

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,363
-------------	-------

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	6
--------------	---

退職給付の支払額	86
----------	----

退職給付債務の期末残高	1,429
-------------	-------

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

退職給付債務	1,429
--------	-------

未積立退職給付債務	1,429
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	27
-------------	----

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

退職給付引当金	1,456
---------	-------

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	2
----------------	---

確定給付制度に係る退職給付費用	147
-----------------	-----

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	1,184,700	1,346,000
付与	0	0

失効	752,400	330,000
権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第61期 (2020年3月31日)		第62期 (2021年3月31日)	
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
(単位：百万円)		(単位：百万円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	822	賞与引当金	929
投資有価証券評価損	102	投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	427	退職給付引当金	446
固定資産減価償却費	96	固定資産減価償却費	90
その他	744	その他	978
繰延税金資産小計	3,624	繰延税金資産小計	3,972
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,194	繰延税金資産合計	2,541
繰延税金負債		繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172	繰延ヘッジ利益	51
繰延税金負債合計	172	その他有価証券評価差額金	645
繰延税金資産の純額	2,022	繰延税金負債合計	696
		繰延税金資産の純額	1,845
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率 (調整)	30.6%	法定実効税率 (調整)	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.3%
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	9.6%	受取配当金等永久に益金に参入されな い項目	5.7%
その他	1.0%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%

(関連当事者情報)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業 の内容	議決権等 の所有 (被所有 割合(%))	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
							資金の貸付 (米国ドル 貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500 千)

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,783 (USD 17,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	30,151百万円
負債合計	5,919百万円
純資産合計	24,231百万円

営業収益	19,946百万円
税引前当期純利益	7,020百万円
当期純利益	5,194百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	395円50銭	432円90銭
1株当たり当期純利益金額	58円61銭	48円45銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,465	9,424
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	11,465	9,424
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,599	194,509
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株	2011年度ストックオプション(1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	77,402	84,049
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	77,402	84,049
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,558	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

第63期中間会計期間
(2021年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		12,200
未払費用		4,648
未払法人税等		2,426
未払消費税等	3	2,260
賞与引当金		2,224
役員賞与引当金		2
その他		1,090
流動負債合計		24,855

固定負債

退職給付引当金		1,501
賞与引当金		261
その他		341
固定負債合計		2,104

負債合計		26,960
------	--	--------

純資産の部

株主資本

資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		66,282
利益剰余金合計		66,282

自己株式		2,067
------	--	-------

株主資本合計		86,798
--------	--	--------

評価・換算差額等

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472
当中間期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
中間純利益				9,517	9,517		9,517
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	4,326	4,326	-	4,326
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	66,282	66,282	2,067	86,798

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他	繰延ヘッジ	評価・換算	

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

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>

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

(会計方針の変更)

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

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち33百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち0百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、266百万円は、流動負債のその他に含まれております。
- (3) 時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に244百万円、投資有価証券に24,313百万円となります。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

(2) 通貨関連

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

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

（持分法損益等）

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

（収益認識関係）

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

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

（ストックオプション等関係）

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

[関連情報]

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

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

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

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益(百万円)	9,517
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	9,517
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)39,600株、 2016年度ストックオプション(1)88,000株、 2016年度ストックオプション(2)860,000株、 2017年度ストックオプション(1)1,624,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期中間会計期間 (2021年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	88,500
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	88,500
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

定めるものを除きます。)。

- (3) 通常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	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
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	

日本生命保険相互会社	1,400,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
富国生命保険相互会社	128,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

載。

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021年6月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年12月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式60）の2020年11月7日から2021年11月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の2021年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月3日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞 廣 篤 典

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記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。