

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年3月15日提出
【計算期間】	第33特定期間(自 2021年6月16日至 2021年12月15日)
【ファンド名】	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型
【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
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券、不動産投信)))

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

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

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

年12回(毎月)

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

**1** 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

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

**2** 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

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

**3** 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

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

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

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



#### 「財産3分法」とは？

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行います。

【世界の財産3分法ファンド】  
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス  
(円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2021年12月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。  
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)





## 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

### 各資産の値動きの特徴



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

### ご参考:設定来のファンドと各資産の推移(マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)~2021年12月,月末値)



※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。  
 ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。  
 ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



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

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



### ご参考:各指数の利回り

(2021年12月末現在)



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

※ 各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。  
※ 上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

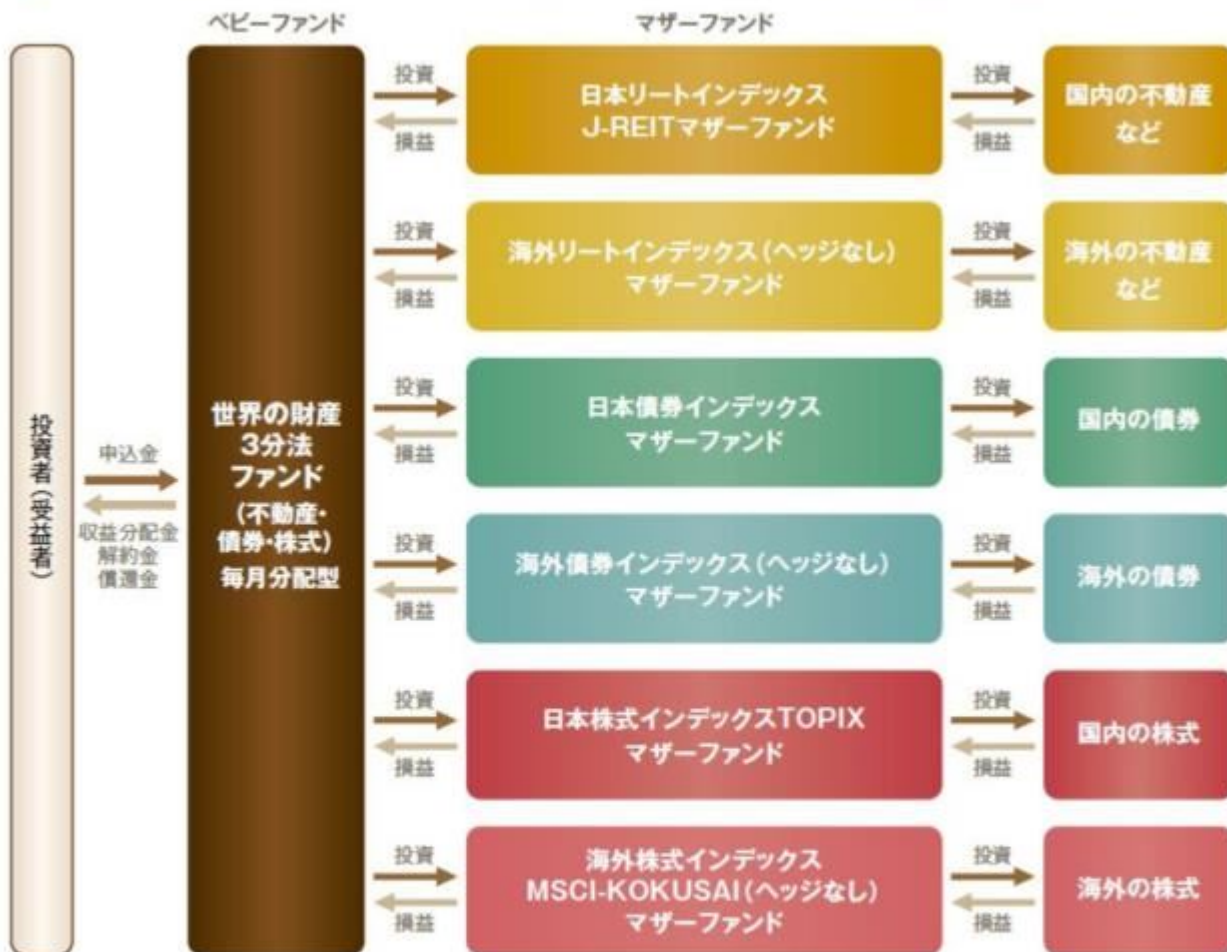
### 各指数(インデックス)の著作権などの権利について

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



## ■ファンドの仕組み

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



### (主な投資制限)

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

### (分配方針)

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



## 収益分配金に関する留意事項

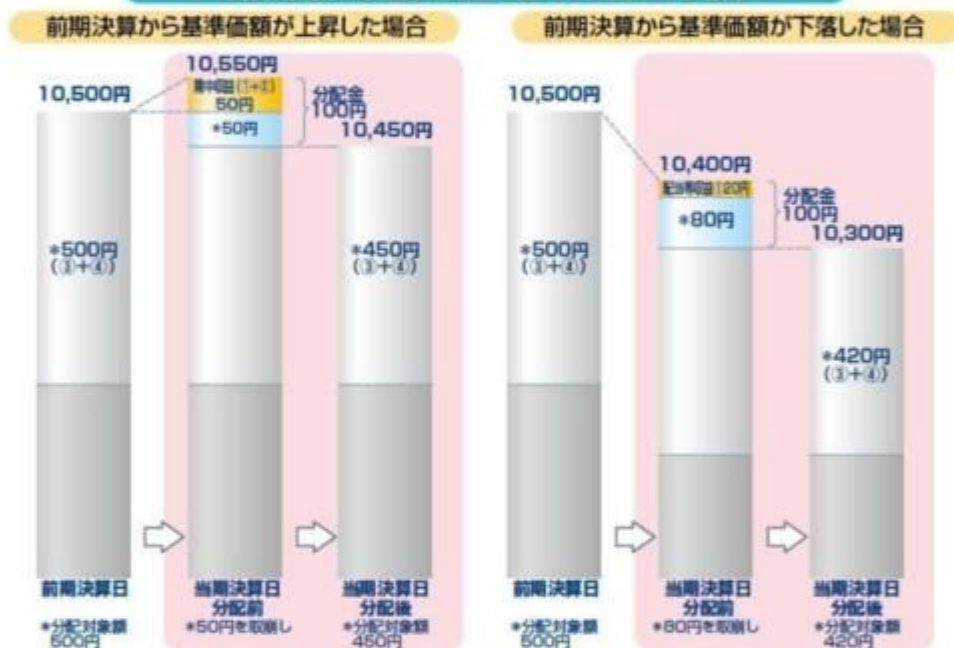
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



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

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

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

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

### 信託金限度額

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

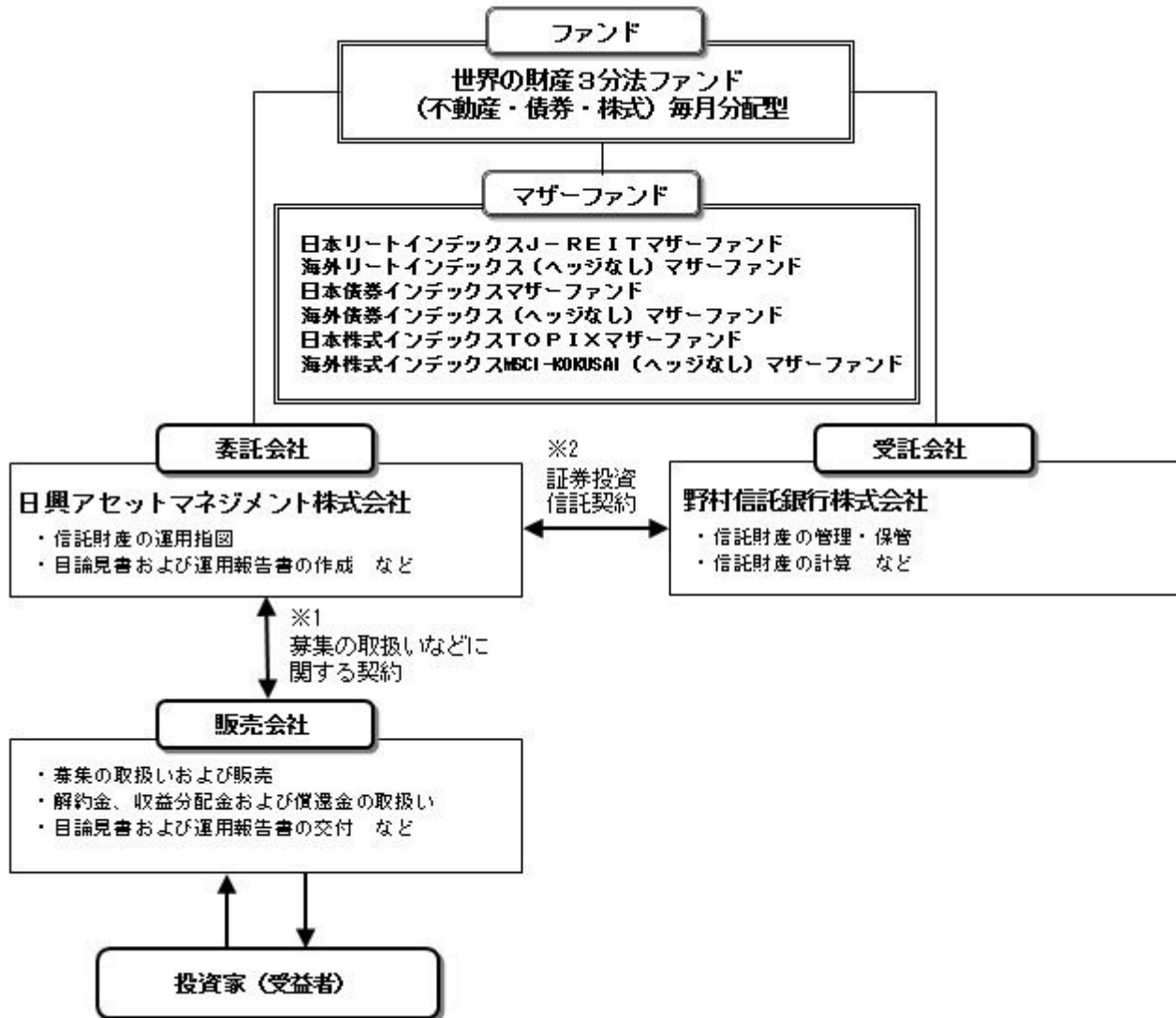
## ・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

## （3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2021年12月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

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

### （2）【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
- 2) 証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
- 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
- 6) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
- 7) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
- 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 10) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの

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

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

次の取引ができます。

1) 外国為替予約取引

2) 資金の借入

#### <日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) 金銭債権

3) 約束手形

4) 為替手形

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

1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー

2) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

3) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの

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

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

1) 預金

2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

#### <海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) 金銭債権

3) 約束手形

4) 為替手形

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

1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー

2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの

3) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

4) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券



以外のもの

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引

- 3) 金利先渡取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 公社債の空売
- 6) 公社債の借入

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの次の取引ができます。
  - 1) 先物取引等
  - 2) スワップ取引
  - 3) 金利先渡取引
  - 4) 為替先渡取引
  - 5) 有価証券の貸付

- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引



- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引

## 投資対象とする投資信託証券の概要

## &lt;日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)の投資信託証券(以下「不動産投資信託証券」といいます。)に投資を行ない、S & P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S &amp; P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動した投資成果をめざします。</li> <li>不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。</li> <li>有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。</li> <li>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%(1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

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

\* NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行され

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

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

#### < 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

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



決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）
-----	-----------------------

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

#### < 日本株式インデックス T O P I X マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
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。

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース) <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカンツリーファンド等を含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</li> <li>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。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%(1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

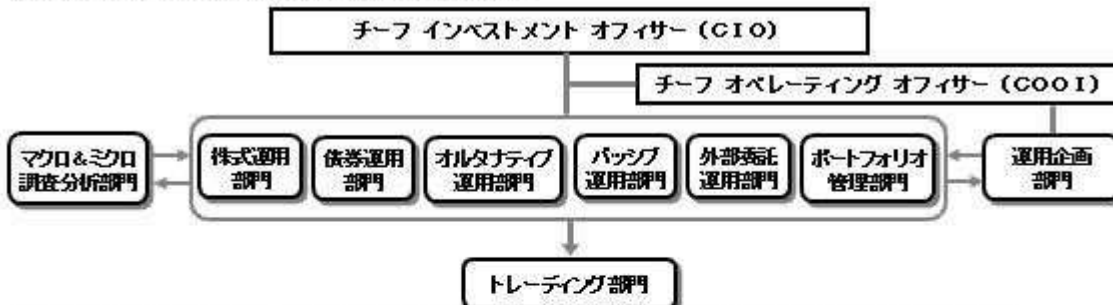
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

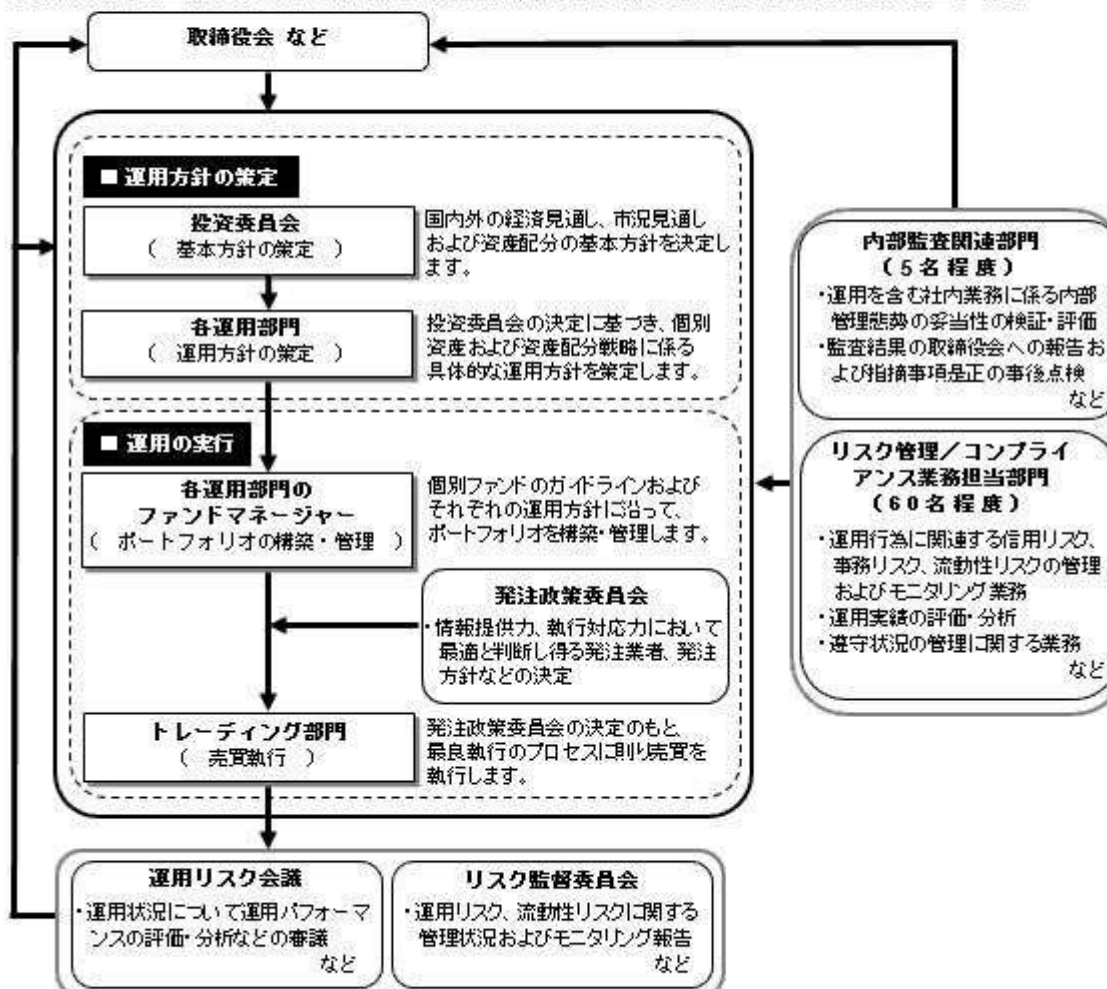
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### （3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



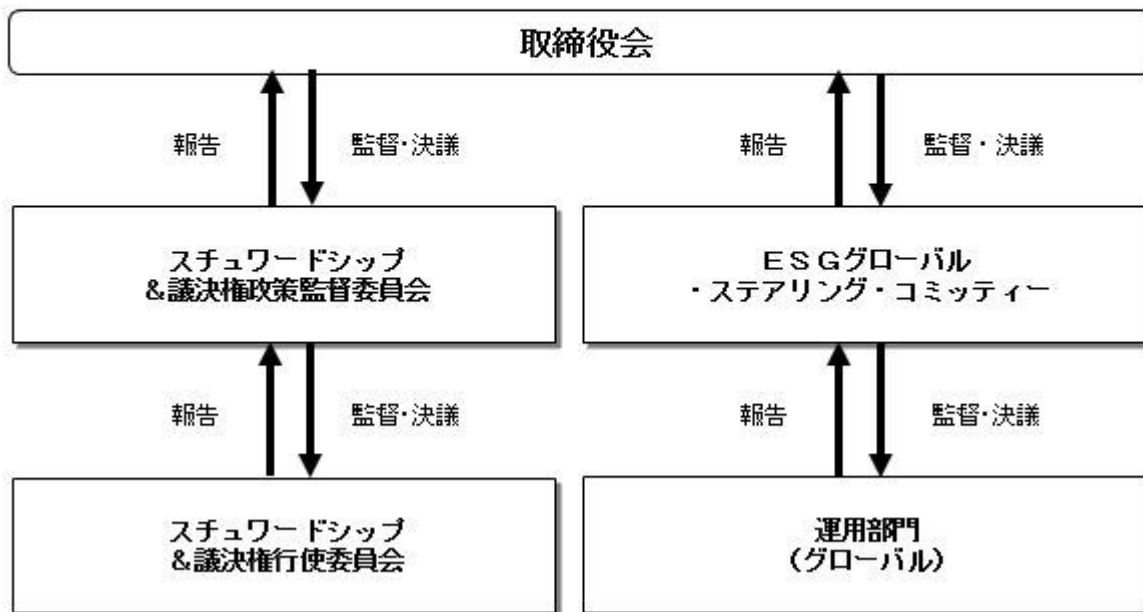
#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2021年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

## 1) 分配対象額の範囲

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

## 2) 分配対象額についての分配方針

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

## 3) 留保益の運用方針

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

## 収益分配金の支払い

## &lt;分配金再投資コース&gt;

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

## &lt;分配金受取りコース&gt;

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

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

## &lt;世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型&gt;

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

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

ん。

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

<日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド>

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

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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



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

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

#### <日本株式インデックストップIXマザーファンド>

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

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

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

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

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

可能なものについてはこの限りではありません。

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

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

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

#### <その他の留意事項>

##### ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

##### ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

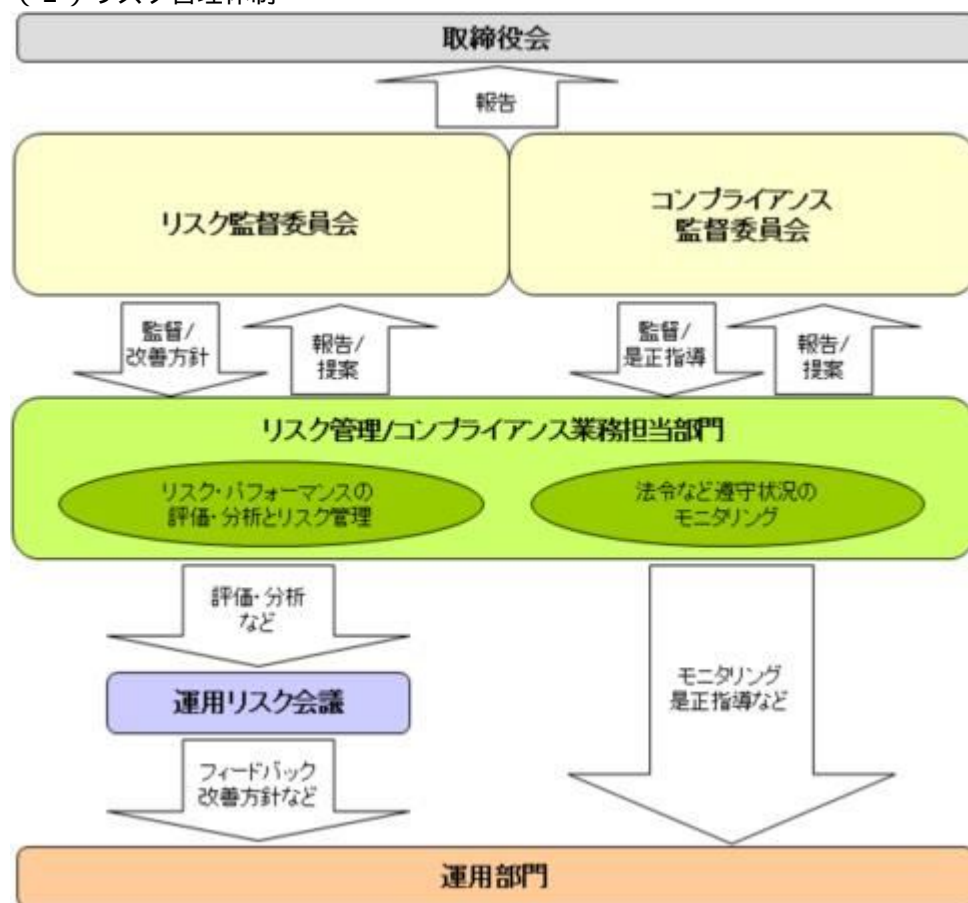
##### ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

基準価額が大きく変動する可能性があります。

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

## (2) リスク管理体制



### 全社リスク管理

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。



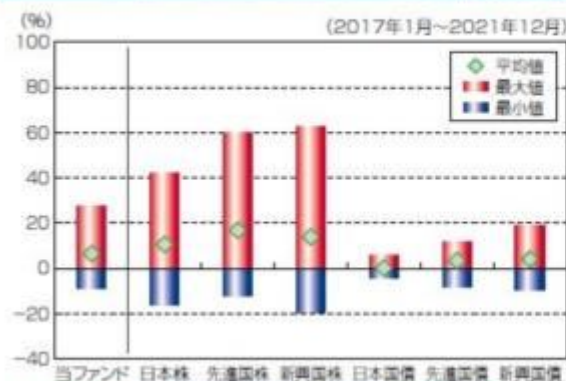
## 法令など遵守状況のモニタリング

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いません。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・監督を行いません。

上記体制は2021年12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	6.6%	10.6%	16.8%	13.9%	0.1%	3.3%	4.0%
最大値	27.4%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-8.7%	-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2017年1月から2021年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

#### <各資産クラスの指数>

日本株 …… 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

先進国株 …… MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

#### 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 …… NOMURA-BPI国債

先進国債 …… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

### 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

#### 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

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

#### MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

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

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

#### NOMURA-BPI国債

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



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

#### FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

### 4【手数料等及び税金】

#### (1)【申込手数料】

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

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

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

#### (2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

#### (3)【信託報酬等】

信託報酬

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

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

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

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

#### 支払時期

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

#### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

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

その他これに類する標章の使用料。

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

#### <投資対象とする投資信託証券に係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

ないため、表示することができません。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）<sup>\*</sup>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。

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

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

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

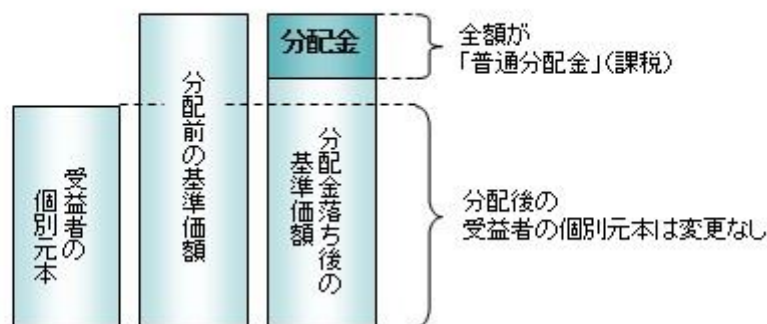
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益

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。

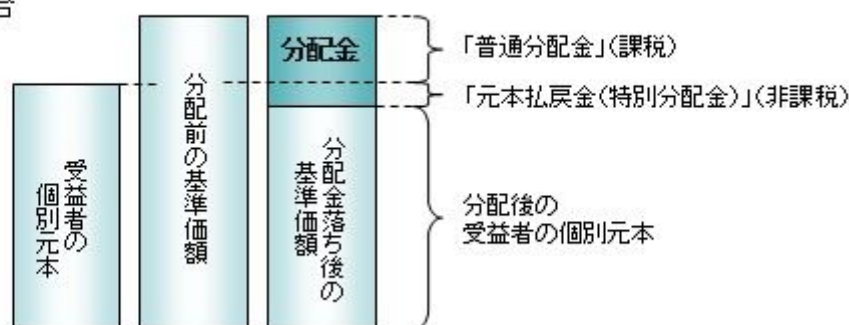
八) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <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3月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

以下の運用状況は2021年12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	36,288,918,468	98.27
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		637,945,497	1.73
合計(純資産総額)		36,926,863,965	100.00

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,161,831,991	2.8313	6,120,794,917	2.9966	6,478,145,744	17.54
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOUSA I(ヘッジなし)マザーファンド	1,473,164,013	4.0986	6,037,910,024	4.2928	6,323,998,475	17.13
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	3,075,597,828	1.9270	5,926,677,417	1.9375	5,958,970,791	16.14
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,291,197,187	2.5790	5,908,998,997	2.5857	5,924,348,566	16.04
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,129,431,068	1.4162	5,848,101,345	1.4123	5,831,995,497	15.79
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,190,889,191	2.5889	5,672,206,721	2.6343	5,771,459,395	15.63

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.27
合計	98.27

### 【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14特定期間末 (2012年 6月15日)	55,918	56,146	0.4910	0.4930
第15特定期間末 (2012年12月17日)	55,668	55,874	0.5402	0.5422
第16特定期間末 (2013年 6月17日)	57,765	57,856	0.6378	0.6388
第17特定期間末 (2013年12月16日)	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18特定期間末 (2014年 6月16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19特定期間末 (2014年12月15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20特定期間末 (2015年 6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末 (2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末 (2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末 (2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末 (2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288

第25特定期間末	(2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末	(2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末	(2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末	(2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末	(2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末	(2020年 6月15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31特定期間末	(2020年12月15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32特定期間末	(2021年 6月15日)	34,941	34,975	1.0217	1.0227
第33特定期間末	(2021年12月15日)	36,248	36,283	1.0365	1.0375
	2020年12月末日	31,348		0.9024	
	2021年 1月末日	31,364		0.9130	
	2月末日	31,708		0.9346	
	3月末日	32,524		0.9749	
	4月末日	33,152		0.9886	
	5月末日	33,962		0.9984	
	6月末日	34,931		1.0145	
	7月末日	35,474		1.0187	
	8月末日	36,094		1.0291	
	9月末日	35,847		1.0199	
	10月末日	36,669		1.0474	
	11月末日	36,008		1.0297	
	12月末日	36,926		1.0583	

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

### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	0.0130
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	0.0120
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	0.0070
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060



第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	0.0060
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	0.0060

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	7.03
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	12.46
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	19.36
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	8.10
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	7.91
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	15.38
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2.04

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第14特定期間	2011年12月16日～2012年 6月15日	787,842,918	13,892,127,349
第15特定期間	2012年 6月16日～2012年12月17日	645,492,480	11,463,657,624
第16特定期間	2012年12月18日～2013年 6月17日	755,347,566	13,250,917,932
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725

第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	2,277,192,099	2,890,774,812
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2,642,144,579	1,866,998,446

（参考）

## 日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2021年12月30日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	76,099,684,450	98.83
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		899,613,525	1.17
合計（純資産総額）		76,999,297,975	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	7,600	730,359.98	5,550,735,886	670,000	5,092,000,000	6.61
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,971	355,919.22	3,904,789,765	407,000	4,465,197,000	5.80
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,706	694,304.85	4,656,008,390	653,000	4,379,018,000	5.69

日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	21,720	189,463.4	4,115,145,105	198,900	4,320,108,000	5.61
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	10,069	331,254.98	3,335,406,458	348,500	3,509,046,500	4.56
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	21,686	181,989.46	3,946,623,587	161,800	3,508,794,800	4.56
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	33,836	116,723.27	3,949,448,755	99,100	3,353,147,600	4.35
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	6,705	367,193.22	2,462,030,600	380,000	2,547,900,000	3.31
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	13,362	210,227.2	2,809,055,890	179,800	2,402,487,600	3.12
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	9,521	206,328.71	1,964,455,709	222,100	2,114,614,100	2.75
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	15,097	157,856.58	2,383,160,900	135,200	2,041,114,400	2.65
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,407	445,538.59	1,963,488,598	399,000	1,758,393,000	2.28
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	20,356	91,308.27	1,858,671,253	85,700	1,744,509,200	2.27
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	8,210	181,640.82	1,491,271,172	202,600	1,663,346,000	2.16
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,493	592,692.58	1,477,582,622	645,000	1,607,985,000	2.09
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	4,382	326,812.03	1,432,090,343	356,500	1,562,183,000	2.03
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,316	635,158	1,471,025,929	663,000	1,535,508,000	1.99
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,574	501,100.77	1,790,934,185	416,000	1,486,784,000	1.93
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,075	780,694.94	1,619,942,002	711,000	1,475,325,000	1.92
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	7,887	155,992.59	1,230,313,598	161,100	1,270,595,700	1.65
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	7,886	163,981.06	1,293,154,682	156,100	1,231,004,600	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,351	519,209.17	1,220,660,778	497,000	1,168,447,000	1.52
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	20,545	69,148.9	1,420,664,250	56,200	1,154,629,000	1.50
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	6,256	181,741.53	1,136,975,070	173,100	1,082,913,600	1.41
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	29,517	45,863.08	1,353,740,549	36,400	1,074,418,800	1.40
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	9,062	119,733.78	1,085,027,554	118,500	1,073,847,000	1.39
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	3,019	352,781.39	1,065,047,037	341,500	1,030,988,500	1.34
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,580	233,648.72	1,070,111,182	222,300	1,018,134,000	1.32
日本	投資証券	NTT都市開発リート投資法人 投資証券	6,428	162,813.39	1,046,564,476	155,200	997,625,600	1.30
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,418	789,844.87	1,120,000,033	700,000	992,600,000	1.29

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.83
合計	98.83

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2021年12月30日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	56,486,789,897	72.34
	カナダ	1,360,783,287	1.74
	ドイツ	206,865,398	0.26
	イタリア	17,077,476	0.02
	フランス	1,229,434,571	1.57
	オランダ	113,295,343	0.15
	スペイン	286,635,773	0.37
	ベルギー	965,239,425	1.24
	アイルランド	81,547,807	0.10
	イギリス	3,938,497,720	5.04
	オーストラリア	5,426,807,826	6.95
	ニュージーランド	166,865,075	0.21
	香港	1,028,846,514	1.32
	シンガポール	2,488,805,321	3.19
	韓国	130,457,864	0.17
	イスラエル	57,045,576	0.07
ガーンジー	182,194,755	0.23	
	小計	74,167,189,628	94.99
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,913,210,632	5.01
合計（純資産総額）		78,080,400,260	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		3,428,439,330	4.39

(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)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	279,938	14,607.54	4,089,205,533	19,286.55	5,399,039,242	6.91
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	34,112	94,746.57	3,231,995,160	96,846.83	3,303,639,406	4.23
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	57,795	34,027.51	1,966,620,334	42,858.75	2,477,021,595	3.17
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	124,443	15,390.82	1,915,280,585	18,260.57	2,272,400,760	2.91
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	107,531	18,679.24	2,008,598,217	20,158.40	2,167,653,470	2.78
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	214,315	7,835.16	1,679,192,829	8,269.93	1,772,371,762	2.27
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	164,834	9,360.32	1,542,900,240	9,789.35	1,613,618,081	2.07
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	52,928	24,726.99	1,308,750,635	29,048.30	1,537,468,475	1.97
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	675,394	1,731.51	1,169,458,203	2,230.65	1,506,568,166	1.93
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	53,413	22,318.48	1,192,097,015	25,715.02	1,373,516,438	1.76
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	129,293	9,323.52	1,205,466,027	10,415.06	1,346,594,482	1.72
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	50,722	18,545.82	940,681,326	25,927.80	1,315,110,298	1.68
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	225,857	4,379.96	989,244,988	5,195.45	1,173,429,519	1.50
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	43,587	19,895.00	867,163,774	26,260.21	1,144,604,043	1.47
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	144,148	5,726.84	825,513,369	7,492.40	1,080,014,879	1.38
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	43,925	20,562.12	903,191,358	24,201.35	1,063,044,659	1.36
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	455,191	1,713.84	780,128,913	2,199.75	1,001,306,766	1.28
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,657	36,369.32	896,758,421	40,511.19	998,884,515	1.28
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	151,142	6,701.06	1,012,812,396	5,828.06	880,865,158	1.13
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	204,268	4,057.90	828,900,261	4,152.22	848,166,083	1.09
香港	投資証券	LINK REIT	832,900	1,128.67	940,069,243	1,002.26	834,784,436	1.07
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	238,005	3,705.94	882,033,297	3,387.33	806,203,619	1.03
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	38,683	15,726.68	608,355,340	20,434.45	790,465,953	1.01
アメリカ	投資証券	UDR INC	110,113	5,820.01	640,858,981	6,880.49	757,632,100	0.97
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	53,939	14,231.42	767,628,812	13,294.01	717,065,692	0.92
アメリカ	投資証券	WIP CAREY INC	70,542	8,939.35	630,599,938	9,552.41	673,846,177	0.86
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	109,846	5,287.46	580,807,364	6,068.45	666,595,530	0.85
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	64,765	8,833.53	572,103,959	10,061.94	651,662,166	0.83
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	233,481	2,510.88	586,244,314	2,789.23	651,233,377	0.83
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	225,804	2,523.53	569,825,155	2,685.71	606,445,641	0.78

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	94.99
合計	94.99

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	23,300,000.00	2,679,034,000	2,679,835,520	3.43
	加ドル	売建	700,000.00	62,982,500	63,024,080	0.08
	ユーロ	売建	900,000.00	117,486,000	117,470,790	0.15
	英ポンド	売建	1,300,000.00	201,735,950	201,802,250	0.26
	豪ドル	売建	2,600,000.00	216,866,000	216,892,000	0.28
	ニュージーランドドル	売建	100,000.00	7,861,730	7,867,910	0.01
	香港ドル	売建	2,670,000.00	39,366,480	39,382,500	0.05
	シンガポールドル	売建	1,200,000.00	102,132,000	102,164,280	0.13

(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12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	37,831,540,860	77.30
地方債証券	日本	4,603,869,724	9.41
特殊債券	日本	5,192,813,640	10.61
社債券	日本	1,213,387,000	2.48
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		96,836,092	0.20
合計（純資産総額）		48,938,447,316	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	101.03	727,466,400	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	101.54	710,843,000	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	100.94	696,486,000	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	101.02	686,990,400	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	100.98	666,507,600	0.100	2030/3/20	1.36
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	610,000,000	100.85	615,197,200	100.92	615,618,100	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	101.04	596,153,700	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	101.01	596,000,300	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	100.93	555,120,500	0.100	2030/6/20	1.13
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	100.86	539,627,750	101.03	540,547,950	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	101.61	497,918,400	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	115.00	494,517,200	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	101.84	427,736,400	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	116.70	417,807,480	1.700	2032/9/20	0.85
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	355,000,000	117.60	417,504,850	117.45	416,979,450	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	117.42	402,764,320	2.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	400,000,000	100.43	401,727,000	100.59	402,384,000	0.100	2031/3/20	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	101.59	396,204,900	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	101.71	376,352,900	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	116.49	337,835,500	116.50	337,861,600	2.100	2029/9/20	0.69
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	300,000,000	112.60	337,812,000	112.57	337,728,000	1.200	2035/3/20	0.69
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	111.04	333,144,000	110.64	331,938,000	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	101.12	328,643,250	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	113.96	307,710,900	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	101.08	303,246,000	0.100	2028/12/20	0.62
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	300,000,000	100.25	300,750,000	100.42	301,269,000	0.100	2031/6/20	0.62
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	300,000,000	100.36	301,098,000	100.28	300,867,000	0.100	2031/9/20	0.61
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	295,000,000	101.47	299,338,370	101.47	299,338,370	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	110.11	297,313,200	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	111.25	278,127,500	2.300	2026/9/20	0.57

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.30
地方債証券	9.41
特殊債券	10.61

社債券	2.48
合 計	99.80

## 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12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	74,909,954,569	47.36
	カナダ	3,063,936,912	1.94
	メキシコ	1,113,599,993	0.70
	ドイツ	11,405,857,518	7.21
	イタリア	13,797,023,718	8.72
	フランス	15,545,782,212	9.83
	オランダ	2,960,794,729	1.87
	スペイン	9,056,131,504	5.73
	ベルギー	3,506,094,308	2.22
	オーストリア	2,172,970,233	1.37
	フィンランド	939,537,202	0.59
	アイルランド	1,231,307,072	0.78
	イギリス	9,414,865,554	5.95
	スウェーデン	459,068,832	0.29
	ノルウェー	391,066,074	0.25
	デンマーク	694,032,680	0.44
	ポーランド	762,452,746	0.48
	オーストラリア	2,606,728,286	1.65
	シンガポール	705,652,030	0.45
	マレーシア	769,264,098	0.49
中国	698,334,599	0.44	
イスラエル	754,645,925	0.48	
	小計	156,959,100,794	99.24
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,202,627,223	0.76

合計（純資産総額）	158,161,728,017	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		82,811,016	0.05
	売建		23,002,880	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	11,032.93	926,766,461	11,138.06	935,597,845	1.125	2031/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,447.63	915,810,809	11,404.50	912,360,209	0.250	2023/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,480,000	11,518.17	861,559,422	11,619.71	869,154,675	1.625	2031/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,446.51	801,255,827	11,410.79	798,755,489	0.125	2023/7/31	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	12,145.16	740,855,229	12,054.63	735,332,692	2.375	2026/4/30	0.46
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,035,000	22,448.65	681,316,821	22,327.91	677,652,124	4.500	2041/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	10,815.47	660,825,483	10,912.97	666,782,574	0.875	2030/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,935.57	632,585,281	11,848.40	627,965,565	2.500	2023/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	12,563.01	620,612,866	12,521.45	618,559,850	2.875	2028/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,140,000	12,068.78	620,335,677	11,970.16	615,266,586	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,020,000	11,954.66	600,124,223	11,855.59	595,150,901	2.000	2025/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,400.36	582,817,311	12,281.97	577,253,031	3.000	2025/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	12,789.45	576,804,606	12,777.55	576,267,658	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,496.32	574,816,217	11,456.62	572,831,052	0.500	2023/11/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,100,000	13,674.57	560,657,568	13,964.59	572,548,414	3.000	2048/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	11,997.34	575,872,787	11,896.03	571,009,594	2.125	2025/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,408.54	570,427,313	11,363.16	568,158,365	0.250	2024/3/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,383.06	569,153,466	11,349.68	567,484,417	0.125	2024/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,398.66	569,933,083	11,346.99	567,349,630	0.375	2024/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	11,759.44	569,157,233	11,686.66	565,634,344	1.625	2026/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,168.17	558,408,620	11,119.19	555,959,953	0.375	2026/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	12,039.80	556,239,139	11,940.51	551,651,735	2.375	2024/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	10,941.72	547,086,339	10,931.84	546,592,115	0.500	2027/10/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	10,604.30	539,759,114	10,701.80	544,721,737	0.625	2030/8/15	0.34
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,592,000	20,548.79	532,624,883	20,869.44	540,935,962	2.500	2046/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,062.62	536,537,244	11,063.48	536,579,083	0.750	2028/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	11,942.52	540,996,455	11,842.11	536,447,926	2.000	2025/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,750,000	10,961.04	520,649,711	11,270.16	535,332,733	1.875	2051/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	11,375.74	534,660,136	11,329.02	532,463,973	0.250	2024/6/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,550,000	11,701.71	532,427,874	11,639.03	529,576,084	1.375	2023/8/31	0.33

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.24
合 計	99.24

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	720,000.00	82,706,400	82,811,016	0.05
	米ドル	売建	200,000.00	22,998,000	23,002,880	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2021年12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	42,020,109,960	99.46
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		230,008,319	0.54
合計(純資産総額)		42,250,118,279	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	239,040,000	0.57

(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	781,100	1,983.47	1,549,293,500	2,105.50	1,644,606,050	3.89
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	96,600	13,420.38	1,296,409,500	14,475.00	1,398,285,000	3.31
日本	株式	キーエンス	電気機器	14,000	66,964.00	937,496,000	72,280.00	1,011,920,000	2.40
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	113,700	7,391.88	840,457,700	6,972.00	792,716,400	1.88
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,800	51,729.79	506,952,000	66,280.00	649,544,000	1.54
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	954,000	639.82	610,388,280	624.90	596,154,600	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	40,000	12,593.40	503,736,000	13,520.00	540,800,000	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	25,900	19,483.55	504,624,000	19,920.00	515,928,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	30,100	17,292.87	520,515,500	17,110.00	515,011,000	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,700	25,577.71	503,881,000	26,090.00	513,973,000	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	158,300	3,263.00	516,532,900	3,150.00	498,645,000	1.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	90,800	6,475.52	587,977,600	5,434.00	493,407,200	1.17
日本	株式	任天堂	その他製品	8,700	49,257.93	428,544,000	53,650.00	466,755,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	74,200	6,771.19	502,422,800	6,230.00	462,266,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	113,900	3,612.20	411,430,000	3,652.00	415,962,800	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	105,300	3,809.81	401,174,000	3,943.00	415,197,900	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	45,300	8,540.08	386,866,000	9,157.00	414,812,100	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	121,400	3,404.47	413,303,800	3,230.00	392,122,000	0.93
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	121,200	3,181.50	385,598,000	3,137.00	380,204,400	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	110,300	3,669.85	404,784,700	3,362.00	370,828,600	0.88
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	103,800	3,237.51	336,053,600	3,518.00	365,168,400	0.86
日本	株式	第一三共	医薬品	121,200	2,855.17	346,047,300	2,925.00	354,510,000	0.84
日本	株式	S M C	機械	4,500	68,833.77	309,752,000	77,590.00	349,155,000	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	17,400	18,013.67	313,438,000	19,395.00	337,473,000	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	229,300	1,539.69	353,051,850	1,454.50	333,516,850	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	13,500	24,514.33	330,943,500	24,380.00	329,130,000	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	34,000	8,104.12	275,540,200	9,529.00	323,986,000	0.77
日本	株式	三井物産	卸売業	118,000	2,616.60	308,759,100	2,723.50	321,373,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	50,100	6,019.10	301,557,300	6,392.00	320,239,200	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	59,500	4,800.41	285,624,400	5,056.00	300,832,000	0.71

## 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	0.23
		建設業	2.20
		食料品	3.25
		繊維製品	0.46

	パルプ・紙	0.21
	化学	6.71
	医薬品	4.75
	石油・石炭製品	0.40
	ゴム製品	0.68
	ガラス・土石製品	0.78
	鉄鋼	0.74
	非鉄金属	0.69
	金属製品	0.63
	機械	5.51
	電気機器	20.04
	輸送用機器	8.07
	精密機器	2.89
	その他製品	2.21
	電気・ガス業	1.05
	陸運業	2.91
	海運業	0.51
	空運業	0.39
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	7.94
	卸売業	5.25
	小売業	4.06
	銀行業	4.72
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.96
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.82
	サービス業	6.27
合 計		99.46

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2022年03月	買建	12	日本円	237,006,600	239,040,000	0.57

(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12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	181,484,370,227	67.57
	カナダ	9,210,403,414	3.43
	ドイツ	6,823,968,533	2.54
	イタリア	1,421,976,335	0.53
	フランス	8,190,872,013	3.05
	オランダ	5,022,434,949	1.87
	スペイン	1,752,809,008	0.65
	ベルギー	612,442,998	0.23
	オーストリア	170,443,872	0.06
	ルクセンブルク	224,767,742	0.08
	フィンランド	978,577,935	0.36
	アイルランド	5,135,368,319	1.91
	ポルトガル	119,409,941	0.04
	イギリス	10,486,408,977	3.90
	スイス	8,958,385,355	3.34
	スウェーデン	2,870,004,123	1.07
	ノルウェー	510,691,477	0.19
	デンマーク	2,085,362,884	0.78
	ケイマン	443,080,507	0.16
	オーストラリア	4,853,231,686	1.81
	バミューダ	392,456,343	0.15
	ニュージーランド	228,429,945	0.09
	香港	1,720,730,816	0.64
	シンガポール	694,689,650	0.26
	イスラエル	619,754,855	0.23
	ジャージー	838,722,391	0.31
	アラブ首長国連邦	0	0.00
マン島	55,147,458	0.02	
小計		255,904,941,753	95.28
投資証券	アメリカ	5,372,672,389	2.00
	カナダ	15,038,480	0.01
	フランス	114,375,207	0.04
	イギリス	161,147,929	0.06
	オーストラリア	381,624,785	0.14
	香港	87,697,968	0.03
	シンガポール	101,358,029	0.04

	小計	6,233,914,787	2.32
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		6,452,355,814	2.40
合計(純資産総額)		268,591,212,354	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	2,889,144,247	1.08
	買建	ドイツ	518,131,225	0.19

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,945,473,410	0.72
	売建		992,527,488	0.37

(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	641,144	17,120.72	10,976,851,392	20,632.28	13,228,267,401	4.93
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	277,004	35,477.91	9,827,525,474	39,331.08	10,894,868,977	4.06
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,685	382,302.32	6,761,016,631	389,229.98	6,883,532,203	2.56
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	32,665	118,250.91	3,862,666,034	124,933.57	4,080,955,188	1.52
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,685	316,548.84	3,698,873,223	337,365.16	3,942,111,918	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	11,215	319,469.20	3,582,847,080	337,018.95	3,779,667,544	1.41
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	メディア・娯楽	92,620	37,797.87	3,500,838,942	39,444.95	3,653,392,084	1.36
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	97,040	26,833.01	2,603,875,853	34,507.15	3,348,573,855	1.25
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	36,575	51,727.94	1,891,949,573	58,151.81	2,126,902,509	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	115,950	19,659.21	2,279,486,374	18,237.57	2,114,646,381	0.79
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	101,961	18,871.33	1,924,139,820	19,731.68	2,011,861,926	0.75
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	40,910	42,748.33	1,748,834,311	47,254.81	1,933,194,555	0.72

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	94,029	16,206.31	1,523,863,875	18,885.13	1,775,750,246	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	51,335	33,376.50	1,713,382,812	34,443.88	1,768,177,052	0.66
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	109,210	14,695.05	1,604,847,066	16,140.03	1,762,653,594	0.66
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	65,582	26,858.32	1,761,422,356	25,093.91	1,645,709,029	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	294,249	5,464.60	1,607,953,145	5,133.34	1,510,480,927	0.56
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,057	89,477.65	1,436,742,723	91,813.78	1,474,253,946	0.55
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	217,710	4,979.21	1,084,025,072	6,622.85	1,441,861,022	0.54
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	34,245	41,475.06	1,420,313,491	41,555.57	1,423,070,693	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,303	44,950.39	1,227,280,684	47,901.98	1,307,867,869	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	70,642	19,748.93	1,395,104,196	17,813.14	1,258,356,359	0.47
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	15,955	60,224.47	960,881,451	77,363.60	1,234,336,273	0.46
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,519	74,419.09	1,378,167,131	65,479.73	1,212,619,227	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	17,205	77,180.72	1,327,894,294	70,224.31	1,208,209,267	0.45
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	163,200	6,346.80	1,035,798,347	7,356.67	1,200,610,045	0.45
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,663	41,023.03	1,011,751,068	47,781.60	1,178,437,808	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	15,299	69,947.11	1,070,120,875	76,227.20	1,166,200,003	0.43
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	164,191	7,398.08	1,214,699,204	7,033.47	1,154,832,965	0.43
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	17,174	56,471.36	969,839,298	65,304.90	1,121,546,445	0.42

#### 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	3.21
		素材	4.01
		資本財	5.98
		商業・専門サービス	1.23
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	2.47
		耐久消費財・アパレル	1.88

	消費者サービス	1.78
	メディア・娯楽	6.79
	小売	5.40
	食品・生活必需品小売り	1.40
	食品・飲料・タバコ	3.64
	家庭用品・パーソナル用品	1.69
	ヘルスケア機器・サービス	4.69
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.81
	銀行	5.69
	各種金融	4.57
	保険	2.80
	不動産	0.38
	ソフトウェア・サービス	11.96
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.53
	電気通信サービス	1.39
	公益事業	2.77
	半導体・半導体製造装置	5.29
投資証券		2.32
合計		97.60

## 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 EMINI2203	買建	105	米ドル	24,666,535	2,837,144,855	25,118,625	2,889,144,247	1.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2203	買建	105	ユーロ	3,892,700	508,036,276	3,970,050	518,131,225	0.19

(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	13,400,000.00	1,524,975,830	1,540,602,580	0.57
	ユーロ	買建	3,100,000.00	402,067,850	404,870,830	0.15
	米ドル	売建	6,400,000.00	735,936,000	736,092,160	0.27
	加ドル	売建	420,000.00	37,789,500	37,814,448	0.01
	ユーロ	売建	1,050,000.00	137,014,500	137,049,255	0.05
	英ポンド	売建	250,000.00	38,795,375	38,808,125	0.01

	スイスフラン	売建	340,000.00	42,761,800	42,763,500	0.02
--	--------	----	------------	------------	------------	------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 参考情報

## 運用実績

2021年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,583円

純資産総額…………… 369.26億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2011年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもものとして計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2021年8月	2021年9月	2021年10月	2021年11月	2021年12月	最近1年間累計	設定以来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,180円

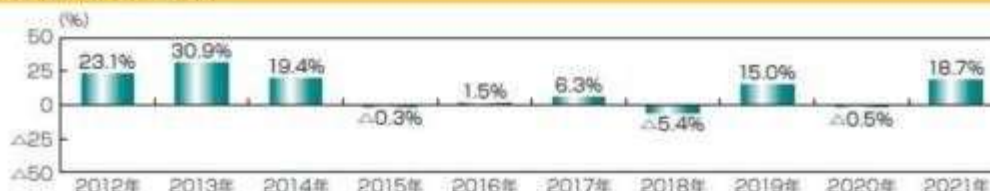
## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	15.6%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.6%
			日本プロロジスリート投資法人 投資証券	日本	5.8%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.7%
			GLP投資法人 投資証券	日本	5.6%
			大和ハウスリート投資法人 投資証券	日本	4.6%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	17.5%	PROLOGIS INC	アメリカ	6.9%
			EQUINIX INC	アメリカ	4.2%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.2%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	2.9%
			DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.8%
			第357回利付国債(10年)	日本	1.5%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	15.8%	第341回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第346回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第350回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第358回利付国債(10年)	日本	1.4%
			US TREASURY N/B(1.125%)	アメリカ	0.6%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.0%	US TREASURY N/B(0.25%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.625%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(0.125%)	アメリカ	0.5%
			US TREASURY N/B(2.375%)	アメリカ	0.5%
			トヨタ自動車	日本	3.9%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.1%	ソニーグループ	日本	3.3%
			キーエンス	日本	2.4%
			リクルートホールディングス	日本	1.9%
			東京エレクトロン	日本	1.5%
			APPLE INC	アメリカ	4.9%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	17.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.1%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.6%
			TESLA INC	アメリカ	1.5%
			ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.5%
			現金その他		1.7%

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

\*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

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

## 2【換金(解約)手続等】

### <解約請求による換金>

#### (1) 解約の受付



販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 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。

## &lt;主な資産の評価方法&gt;

## マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

## 国内上場株式

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

## 外国株式

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

## 公社債（国内・外国）

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

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

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

\*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

## 国内上場不動産投信

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

## 海外上場不動産投信

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

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt;委託会社の照会先&gt;

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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2)【保管】

該当事項はありません。

**(3) 【信託期間】**

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

**(4) 【計算期間】**

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

**(5) 【その他】**

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

信託約款の変更

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

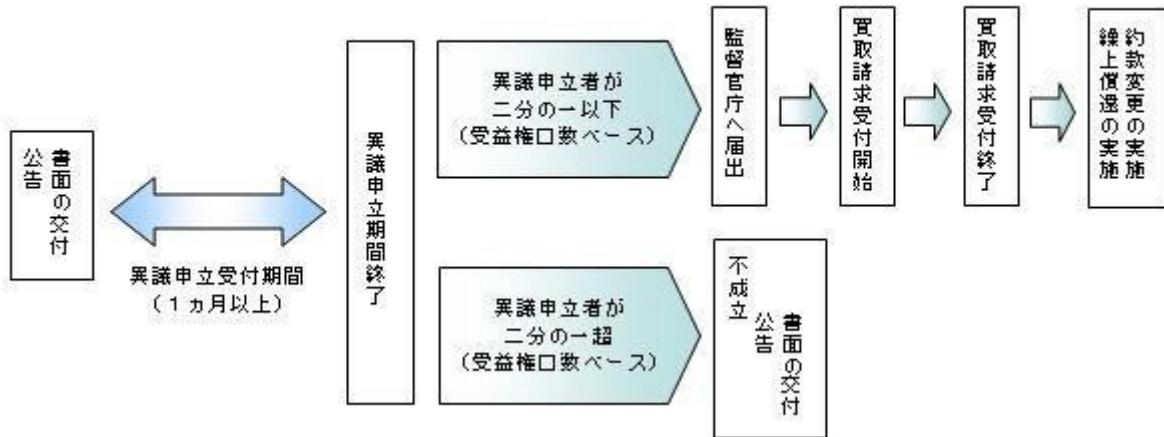
異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告

し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回(6月、12月)および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

### (2) 解約請求権

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

### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

#### 1【財務諸表】

## 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年 6月15日現在	当期 2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	765,193,906	723,847,304
親投資信託受益証券	34,273,521,752	35,608,937,332
未収入金	765,592	16,912,335
流動資産合計	35,039,481,250	36,349,696,971
資産合計	35,039,481,250	36,349,696,971
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	34,197,976	34,973,123
未払解約金	28,769,565	31,092,389
未払受託者報酬	1,487,759	1,647,140
未払委託者報酬	26,779,839	29,648,718
未払利息	76	231
その他未払費用	6,792,271	3,575,884
流動負債合計	98,027,486	100,937,485
負債合計	98,027,486	100,937,485
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	34,197,976,910	34,973,123,043
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	743,476,854	1,275,636,443
(分配準備積立金)	5,819,919,676	6,514,081,633
元本等合計	34,941,453,764	36,248,759,486
純資産合計	34,941,453,764	36,248,759,486
負債純資産合計	35,039,481,250	36,349,696,971

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	前期		当期	
	自	2020年12月16日	自	2021年 6月16日
	至	2021年 6月15日	至	2021年12月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,837,080,908		921,017,583
営業収益合計		4,837,080,908		921,017,583
営業費用				
支払利息		25,604		64,571
受託者報酬		8,877,903		9,902,171
委託者報酬		159,803,335		178,240,229
その他費用		4,303,588		4,236,242
営業費用合計		173,010,430		192,443,213
営業利益又は営業損失 ( )		4,664,070,478		728,574,370
経常利益又は経常損失 ( )		4,664,070,478		728,574,370
当期純利益又は当期純損失 ( )		4,664,070,478		728,574,370
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 ( )		22,652,940		2,153,436
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		3,804,781,398		743,476,854
剰余金増加額又は欠損金減少額		168,202,827		62,928,883
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		168,202,827		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		62,928,883
剰余金減少額又は欠損金増加額		57,455,782		51,805,839
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		51,805,839
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		57,455,782		-
分配金		203,906,331		209,691,261
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		743,476,854		1,275,636,443



## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		前期 2021年 6月15日現在	当期 2021年12月15日現在
1.	期首元本額	34,811,559,623円	34,197,976,910円
	期中追加設定元本額	2,277,192,099円	2,642,144,579円
	期中一部解約元本額	2,890,774,812円	1,866,998,446円
2.	受益権の総数	34,197,976,910口	34,973,123,043口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日		当期 自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2020年12月16日 至 2021年 1月15日		自 2021年 6月16日 至 2021年 7月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	58,350,948円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 31,874,418円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	756,335,709円	C 信託約款に定める収益調整金 1,151,756,073円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	3,157,999,492円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 5,764,463,078円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,972,686,149円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 6,948,093,569円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,147円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,009円
G	分配金額	34,606,352円	G 分配金額 34,579,222円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2021年 1月16日 至 2021年 2月15日		自 2021年 7月16日 至 2021年 8月16日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	42,494,444円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 32,306,974円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	287,974,371円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	759,979,784円	C 信託約款に定める収益調整金 1,274,895,151円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	3,129,925,575円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 5,712,655,559円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,220,374,174円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 7,019,857,684円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,234円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,008円

G	分配金額	34,174,506円	G	分配金額	34,945,295円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2021年 2月16日			自 2021年 8月17日	
	至 2021年 3月15日			至 2021年 9月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	66,496,842円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	64,343,628円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	615,348,371円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	292,435,388円
C	信託約款に定める収益調整金	766,159,513円	C	信託約款に定める収益調整金	1,365,577,902円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	3,371,501,073円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	5,655,309,118円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	4,819,505,799円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,377,666,036円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,427円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,100円
G	分配金額	33,769,576円	G	分配金額	35,120,308円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2021年 3月16日			自 2021年 9月16日	
	至 2021年 4月15日			至 2021年10月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	96,748,488円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	86,000,304円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	519,213,144円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	232,563,143円
C	信託約款に定める収益調整金	798,845,637円	C	信託約款に定める収益調整金	1,411,696,065円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	3,939,477,302円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	5,928,192,106円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,354,284,571円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,658,451,618円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,601円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,181円
G	分配金額	33,424,461円	G	分配金額	35,103,161円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2021年 4月16日			自 2021年10月16日	
	至 2021年 5月17日			至 2021年11月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	36,905,684円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	37,635,922円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	44,632,458円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	420,739,808円
C	信託約款に定める収益調整金	897,893,322円	C	信託約款に定める収益調整金	1,442,503,664円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	4,473,223,433円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,152,673,001円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	5,452,654,897円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,053,552,395円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,616円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,302円
G	分配金額	33,733,460円	G	分配金額	34,970,152円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2021年 5月18日			自 2021年11月16日	
	至 2021年 6月15日			至 2021年12月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	42,422,744円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	21,433,080円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,336,097,738円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	1,018,903,084円	C	信託約款に定める収益調整金	1,492,311,351円

D 信託約款に定める分配準備積立金	4,475,597,170円	D 信託約款に定める分配準備積立金	6,527,621,676円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	6,873,020,736円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	8,041,366,107円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,009円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,299円
G 分配金額	34,197,976円	G 分配金額	34,973,123円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

## (有価証券に関する注記)

前期(2021年6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

当期(2021年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	435,380,921
合計	435,380,921

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

前期 2021年6月15日現在		当期 2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.0217円	1口当たり純資産額	1.0365円
(1万口当たり純資産額)	(10,217円)	(1万口当たり純資産額)	(10,365円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	1,482,800,678	6,077,406,858	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,128,095,902	5,846,209,416	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,291,024,266	5,908,551,582	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,075,583,467	5,926,649,340	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,188,544,809	5,666,142,510	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,184,147,786	6,183,977,626	
	合計	15,350,196,908	35,608,937,332	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

報は監査の対象外であります。

（参考）

## 日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	453,582,248	477,024,660
投資証券	80,908,878,600	74,779,470,600
未収配当金	372,560,049	346,545,983
流動資産合計	81,735,020,897	75,603,041,243
資産合計	81,735,020,897	75,603,041,243
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,444,466	1,774,247
未払利息	45	152
流動負債合計	6,444,511	1,774,399
負債合計	6,444,511	1,774,399
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	30,411,438,906	29,200,487,757
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	51,317,137,480	46,400,779,087
元本等合計	81,728,576,386	75,601,266,844
純資産合計	81,728,576,386	75,601,266,844
負債純資産合計	81,735,020,897	75,603,041,243

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
1.	期首	2020年12月16日	2021年 6月16日
	期首元本額	48,854,624,863円	30,411,438,906円
	期首からの追加設定元本額	1,251,580円	721,992,920円
	期首からの一部解約元本額	18,444,437,537円	1,932,944,069円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,110,212,429円	2,188,544,809円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,479,739,014円	1,439,666,461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）	163,838,222円	148,748,786円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	26,656,397,661円	25,337,188,237円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	1,251,580円	86,339,464円
計	30,411,438,906円	29,200,487,757円	
2.	受益権の総数	30,411,438,906口	29,200,487,757口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日	自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左



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

（有価証券に関する注記）

（2021年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2021年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,116,933,775
合計	4,116,933,775

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年 6月15日現在		2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2.6874円	1口当たり純資産額	2.5890円
(1万口当たり純資産額)	(26,874円)	(1万口当たり純資産額)	(25,890円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,347	186,290,100	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	2,119	255,127,600	
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	3,112	505,700,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	512	55,040,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,310	1,469,160,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	7,867	1,211,518,000	
	産業ファンド投資法人 投資証券	9,498	2,034,471,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	6,689	2,451,518,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,570	996,260,000	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,566	1,494,154,000	
	G L P投資法人 投資証券	21,669	4,125,777,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	3,012	999,984,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,946	4,159,480,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,121	711,835,000	
	O n eリート投資法人 投資証券	1,161	347,139,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	7,868	1,204,590,800	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	6,241	1,057,849,500	
	日本リート投資法人 投資証券	2,064	876,168,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	20,308	1,703,841,200	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,398	180,062,400	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,671	739,599,900	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,427	221,898,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,516	185,861,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	21,635	3,548,140,000	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	1,108	90,191,200	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	8,190	1,599,507,000	

スターアジア不動産投資法人 投資証券	6,914	424,519,600	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	627	87,215,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,487	1,519,557,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	1,080	79,056,000	
投資法人みらい 投資証券	7,627	373,341,650	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	1,570	197,035,000	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,700	846,600,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,591	550,587,500	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	971	111,179,500	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,638	297,566,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,609	446,139,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	7,582	5,277,072,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,690	4,442,160,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	33,757	3,358,821,500	
オリックス不動産投資法人 投資証券	13,331	2,427,575,100	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,397	1,796,174,500	
N T T都市開発リート投資法人 投資証券	6,413	947,200,100	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	4,486	873,872,800	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,646	560,307,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	15,061	2,094,985,100	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	4,782	689,564,400	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	29,447	1,093,956,050	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,345	1,161,947,500	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,334	667,002,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	4,371	1,470,841,500	
福岡リート投資法人 投資証券	3,460	579,204,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,070	1,438,650,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	5,482	468,711,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,414	1,001,112,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	3,022	480,498,000	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,042	242,994,400	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	10,046	3,335,272,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	20,496	1,153,924,800	
大和証券リビング投資法人 投資証券	9,040	1,028,752,000	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	6,208	844,908,800	
合計	388,661	74,779,470,600	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	278,917,322	298,267,351
コール・ローン	31,397,751	27,270,047
投資証券	80,875,661,501	73,285,759,983
未収入金	52,677,105	39,962,733
未収配当金	116,331,888	196,898,157
流動資産合計	81,354,985,567	73,848,158,271
資産合計	81,354,985,567	73,848,158,271
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,789,840	8,994,986
未払利息	3	8
流動負債合計	2,789,843	8,994,994
負債合計	2,789,843	8,994,994
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	31,154,221,388	26,079,655,919
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	50,197,974,336	47,759,507,358
元本等合計	81,352,195,724	73,839,163,277
純資産合計	81,352,195,724	73,839,163,277
負債純資産合計	81,354,985,567	73,848,158,271

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p>
--------------------	---

	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。
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)

		2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
1.	期首	2020年12月16日	2021年 6月16日
	期首元本額	49,314,995,417円	31,154,221,388円
	期首からの追加設定元本額	7,023,988円	702,352,287円
	期首からの一部解約元本額	18,167,798,017円	5,776,917,756円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,203,291,465円	2,184,147,786円
	インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)	17,914,137円	12,659,497円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	28,616,313,831円	23,569,301,752円
	海外先進国REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	316,701,955円	313,546,884円
	計	31,154,221,388円	26,079,655,919円
2.	受益権の総数	31,154,221,388口	26,079,655,919口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日	自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2021年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,401,882,576
合計	3,401,882,576

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2021年 6月15日現在		2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2.6113円	1口当たり純資産額	2.8313円
(1万口当たり純資産額)	(26,113円)	(1万口当たり純資産額)	(28,313円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	34,528	717,837.12	
		AGREE REALTY CORPORATION	27,802	1,883,585.50	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	28,548	679,727.88	
		ALEXANDER'S INC	861	213,355.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	55,549	11,775,832.51	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,348	82,090.24	



AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,412	714,624.12
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	55,567	3,040,070.57
AMERICAN FINANCE TRUST INC	47,860	391,973.40
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	109,774	4,509,515.92
AMERICOLD REALTY TRUST	104,778	3,325,653.72
APARTMENT INCOME REIT CO	62,801	3,319,032.85
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	56,028	423,011.40
APPLE HOSPITALITY REIT INC	84,397	1,276,082.64
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	23,665	345,745.65
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,463	123,508.33
AVALONBAY COMMUNITIES INC	55,895	13,651,794.80
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,300	128,526.00
BOSTON PROPERTIES INC	56,974	6,510,988.72
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	23,151	109,272.72
BRANDYWINE REALTY TRUST	66,953	883,110.07
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	118,671	2,772,154.56
BROADSTONE NET LEASE INC-A	63,591	1,559,251.32
BRT APARTMENTS CORP	4,777	91,622.86
CAMDEN PROPERTY TRUST	40,211	6,975,402.17
CARETRUST REIT INC	37,532	799,806.92
CEDAR REALTY TRUST INC	5,302	117,651.38
CENTERSPACE	5,329	555,601.54
CHATHAM LODGING TRUST	17,950	236,940.00
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,241	37,577.97
CITY OFFICE REIT INC	17,410	305,197.30
CLIPPER REALTY INC	6,271	56,627.13
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	9,192	409,411.68
COREPOINT LODGING INC	16,184	250,042.80
CORESITE REALTY CORP	17,716	3,011,188.52
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	45,178	1,229,745.16
COUSINS PROPERTIES INC	59,452	2,307,926.64
CTO REALTY GROWTH INC	2,671	148,160.37
CUBESMART	86,054	4,659,824.10
CYRUSONE INC	49,691	4,451,319.78
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	85,427	742,360.63
DIGITAL REALTY TRUST INC	113,176	18,927,554.24
DIGITALBRIDGE GROUP INC	196,334	1,562,818.64
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	96,045	242,033.40
DOUGLAS EMMETT INC	70,326	2,305,989.54
DUKE REALTY CORPORATION	151,395	9,407,685.30
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	32,411	714,986.66

EASTGROUP PROPERTIES INC	16,137	3,481,396.38
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	55,774	499,177.30
EPR PROPERTIES	29,879	1,369,055.78
EQUINIX INC	35,938	28,959,918.54
EQUITY COMMONWEALTH	49,418	1,252,252.12
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	68,460	5,691,764.40
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	136,425	11,877,160.50
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	47,101	1,272,669.02
ESSEX PROPERTY TRUST INC	26,041	9,002,894.52
EXTRA SPACE STORAGE INC	53,540	11,230,550.40
FARMLAND PARTNERS INC	12,266	142,162.94
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	28,028	3,589,826.24
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	51,637	3,258,811.07
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	30,654	862,910.10
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	36,666	216,696.06
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	88,961	4,064,628.09
GEO GROUP INC/THE	49,871	353,585.39
GETTY REALTY CORPORATION	14,956	470,067.08
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	15,026	350,256.06
GLADSTONE LAND CORP	11,110	333,300.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	23,315	379,101.90
GLOBAL NET LEASE INC	38,670	572,316.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	58,592	1,823,968.96
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	87,703	2,931,911.29
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	216,074	7,348,676.74
HERSHA HOSPITALITY TRUST	12,926	113,102.50
HIGHWOODS PROPERTIES INC	41,691	1,836,071.64
HOST HOTELS & RESORTS INC	285,688	4,591,006.16
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,082	1,498,952.28
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	41,989	1,016,973.58
INDUS REALTY TRUST INC	1,801	136,011.52
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	24,522	560,082.48
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	9,514	2,252,915.20
INVITATION HOMES INC	230,802	9,725,996.28
IRON MOUNTAIN INC	115,885	5,597,245.50
JBG SMITH PROPERTIES	46,682	1,308,029.64
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	318,900	251,931.00
KILROY REALTY CORPORATION	42,046	2,809,513.72
KIMCO REALTY CORP	245,424	5,556,399.36
KITE REALTY GROUP TRUST	87,201	1,784,132.46
LEXINGTON REALTY TRUST	110,905	1,690,192.20
LIFE STORAGE INC	31,274	4,419,016.20
LTC PROPERTIES INC	16,127	523,804.96

MACERICH CO/THE	85,117	1,446,137.83
MANULIFE US REAL ESTATE INV	587,447	387,715.02
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	238,795	5,181,851.50
MID-AMERICA APARTMENT COMM	46,422	10,087,500.60
MONMOUTH RE INVST CORP	37,914	793,540.02
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	70,416	3,195,478.08
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	32,489	2,075,072.43
NATL HEALTH INVESTORS INC	18,383	991,211.36
NETSTREIT CORP	15,274	326,252.64
NEXPOINT RESIDENTIAL	9,000	687,240.00
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	18,872	440,283.76
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	95,921	2,673,318.27
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,172	211,884.76
ORION OFFICE REIT INC	22,153	422,236.18
PARAMOUNT GROUP INC	64,586	544,459.98
PARK HOTELS & RESORTS INC	94,422	1,666,548.30
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	52,554	1,102,582.92
PENN REAL ESTATE INVEST TST	28,444	29,012.88
PHYSICIANS REALTY TRUST	87,492	1,594,104.24
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	48,586	865,802.52
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,541	362,936.54
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,481	97,561.80
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	19,828	277,790.28
PRIME US REIT	241,600	200,528.00
PROLOGIS INC	295,852	46,960,587.96
PS BUSINESS PARKS INC	8,018	1,370,035.66
PUBLIC STORAGE	61,035	21,502,020.15
REALTY INCOME CORP	220,751	14,854,334.79
REGENCY CENTERS CORP	61,187	4,396,897.82
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	48,322	897,822.76
RETAIL VALUE INC	7,745	47,244.50
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	55,089	4,130,022.33
RLJ LODGING TRUST	67,030	845,248.30
RPT REALTY	32,459	413,852.25
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,957	1,746,240.21
SABRA HEALTH CARE REIT INC	88,631	1,166,383.96
SAFEHOLD INC	5,188	368,711.16
SAUL CENTERS INC	5,338	270,903.50
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	15,691	209,317.94
SERVICE PROPERTIES TRUST	66,462	571,573.20
SIMON PROPERTY GROUP INC	131,465	19,842,012.45
SITE CENTERS CORP	71,842	1,054,640.56

	SL GREEN REALTY CORP	26,922	1,912,269.66
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	47,525	2,242,704.75
	STAG INDUSTRIAL INC	64,781	2,920,327.48
	STORE CAPITAL CORP	97,925	3,305,948.00
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43,023	385,486.08
	SUN COMMUNITIES INC	46,433	9,085,080.78
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	88,041	957,886.08
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	42,173	800,443.54
	TERRENO REALTY CORP	28,163	2,245,435.99
	UDR INC	111,769	6,548,545.71
	UMH PROPERTIES INC	17,618	437,631.12
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	5,482	316,146.94
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,834	788,181.72
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	12,179	241,265.99
	VENTAS INC	157,434	7,512,750.48
	VERIS RESIDENTIAL INC	30,953	552,511.05
	VICI PROPERTIES INC	245,809	6,796,618.85
	VORNADO REALTY TRUST	63,793	2,605,306.12
	WASHINGTON REIT	34,308	867,992.40
	WELLTOWER INC	169,099	13,898,246.81
	WHITESTONE REIT	18,449	172,682.64
	WP CAREY INC	73,943	5,839,278.71
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	46,241	766,675.78
米ドル小計		10,523,460	492,567,566.12 (56,054,189,024)
加ドル	投資証券		
	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	24,573	1,065,976.74
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,541	314,807.23
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	8,129	109,253.76
	BOARDWALK EQUITIES INC	9,108	489,828.24
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	16,491	65,304.36
	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	34,012	1,937,663.64
	CHOICE PROPERTIES REIT	63,576	919,944.72
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,819	366,414.40
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	22,892	381,380.72
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	41,374	676,878.64
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	10,824	247,328.40
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	21,405	92,041.50
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	42,417	740,176.65
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	12,880	1,312,343.20
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	54,744	861,670.56
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	6,419	58,348.71
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	28,079	458,530.07

		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	21,937	493,582.50
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	8,324	177,883.88
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	8,608	146,249.92
		NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	6,560	80,425.60
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	40,098	533,704.38
		PLAZA RETAIL REIT	24,148	110,114.88
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	61,025	1,336,447.50
		SLATE GROCERY REIT	10,399	139,554.58
		SLATE OFFICE REIT	17,319	84,689.91
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	27,768	855,809.76
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	31,492	690,619.56
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	16,592	118,798.72
加ドル小計			720,553	14,865,772.73 (1,316,215,517)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	14,435	1,634,042.00
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	71,324	1,390,818.00
		ALTAREA	1,797	278,535.00
		BEFIMMO S.C.A.	10,178	339,436.30
		CARE PROPERTY INVEST	11,264	291,174.40
		CARMILA	18,402	248,795.04
		COFINIMMO	11,240	1,546,624.00
		COIMA RES SPA	9,091	66,455.21
		COVIVIO	18,823	1,300,669.30
		CROMWELL REIT EUR	128,760	325,762.80
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,849	269,568.74
		GECINA SA	21,768	2,566,447.20
		HAMBORNER REIT AG	29,292	287,325.22
		HIBERNIA REIT PLC	267,926	337,586.76
		ICADE	12,928	798,950.40
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	24,346	87,767.33
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	108,238	856,162.58
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,163	286,596.60
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	184,442	294,738.31
		KLEPIERRE	78,705	1,526,483.47
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	27,037	139,510.92
		MERCIALYS	20,777	174,838.45
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	134,387	1,282,858.30
		MONTEA	3,930	497,538.00
		NSI NV	7,423	259,433.85
		RETAIL ESTATES	4,434	313,483.80
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	46,559	2,740,928.33
		VASTNED RETAIL	7,414	172,746.20

		WAREHOUSES DE PAUW SCA	55,770	2,231,915.40
		WERELDHAVE NV	15,092	182,613.20
		XIOR STUDENT HOUSING NV	7,207	344,854.95
ユーロ小計			1,378,001	23,074,660.06 (2,958,863,659)
英ポンド	投資証券	AEW UK REIT PLC	72,924	82,112.42
		ASSURA PLC	1,091,269	739,334.74
		BIG YELLOW GROUP PLC	68,884	1,154,495.84
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	320,813	321,454.62
		BRITISH LAND COMPANY PLC	374,697	1,928,190.76
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	333,290	530,597.68
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	275,176	258,665.44
		CUSTODIAN REIT PLC	177,803	184,915.12
		DERWENT LONDON PLC	44,801	1,502,177.53
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	240,434	200,281.52
		GCP STUDENT LIVING PLC	185,605	394,410.62
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	98,891	699,159.37
		HAMMERSON PLC	1,709,740	542,842.45
		HOME REIT PLC	105,775	128,516.62
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	132,073	157,166.87
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	300,549	2,246,904.32
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	364,591	1,003,354.43
		LXI REIT PLC	286,301	418,572.06
		NEWRIVER REIT PLC	142,157	122,112.86
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	217,572	212,132.70
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	544,071	811,209.86
		PRS REIT PLC/THE	199,014	210,954.84
		REGIONAL REIT LTD	182,387	165,060.23
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	83,882	1,150,022.22
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	238,747	121,760.97
		SEGRO PLC	479,562	6,646,729.32
		SHAFTESBURY PLC	116,129	694,451.42
		STANDARD LIFE INV PROP INC	170,595	130,505.17
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	338,791	409,937.11
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	160,560	154,458.72
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	684,664	1,628,130.99
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	331,358	247,524.42		
UNITE GROUP PLC	159,152	1,687,011.20		
WORKSPACE GROUP PLC	50,872	408,756.52		
英ポンド小計			11,041,875	27,293,910.96 (4,110,190,051)

豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	149,466	542,561.58	
		ARENA REIT	130,339	581,311.94	
		AVENTUS GROUP	168,461	601,405.77	
		BWP TRUST	207,632	865,825.44	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	255,099	846,928.68	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	222,686	895,197.72	
		CENTURIA OFFICE REIT	190,677	448,090.95	
		CHARTER HALL GROUP	186,279	4,088,824.05	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	252,192	1,318,964.16	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	208,707	912,049.59	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	134,624	530,418.56	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	592,510	512,521.15	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	85,752	294,129.36	
		DEXUS/AU	434,834	4,961,455.94	
		GDI PROPERTY GROUP	212,838	237,314.37	
		GOODMAN GROUP	673,663	17,602,814.19	
		GPT GROUP	771,228	4,156,918.92	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	125,339	535,197.53	
		HOME CONSORTIUM	75,005	579,038.60	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	229,544	342,020.56	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	75,847	269,256.85	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	144,272	917,569.92	
		IRONGATE GROUP	222,692	350,739.90	
		MIRVAC GROUP	1,587,661	4,683,599.95	
		NATIONAL STORAGE REIT	447,753	1,146,247.68	
		RURAL FUNDS GROUP	156,673	488,819.76	
		SCENTRE GROUP	2,080,987	6,492,679.44	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	433,996	1,267,268.32			
STOCKLAND	958,378	4,255,198.32			
VICINITY CENTRES	1,554,912	2,721,096.00			
WAYPOINT REIT	313,823	878,704.40			
豪ドル小計		13,283,869	64,324,169.60	(5,205,111,804)	
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	532,455	1,405,681.20	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	237,475	751,608.37	
ニュージーランドドル小計			769,930	2,157,289.57	(165,420,964)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	755,000	2,982,250.00	
		FORTUNE REIT	576,000	4,521,600.00	
		LINK REIT	840,200	56,545,460.00	
		PROSPERITY REIT	495,000	1,499,850.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	409,000	1,709,620.00	

		YUEXIU REAL ESTATE IN-RTS(N)	260,110	13,005.50	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	703,000	2,284,750.00	
香港ドル小計			4,038,310	69,556,535.50 (1,014,829,852)	
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	180,225	255,919.50	
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	558,494	494,267.19	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,345,132	3,954,688.08	
		ASCOTT TRUST	745,692	745,692.00	
		CAPITALAND CHINA TRUST	441,885	517,005.45	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,995,092	4,010,134.92	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	294,400	335,616.00	
		EC WORLD REIT	122,900	98,934.50	
		ESR-REIT	1,094,372	525,298.56	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	446,000	265,370.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	560,340	170,903.70	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	422,205	954,183.30	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,167,960	1,751,940.00	
		IREIT GLOBAL	254,933	163,157.12	
		KEPPEL DC REIT	517,277	1,262,155.88	
		KEPPEL REIT	782,500	892,050.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	383,500	331,727.50	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	884,031	1,803,423.24	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	781,108	2,101,180.52	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,154,914	2,171,238.32	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST(N)	41,873	78,721.24	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	834,900	868,296.00	
		OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I	991,435	431,274.22	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	156,200	781,000.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	234,200	196,728.00	
		SPH REIT	416,200	401,633.00	
STARHILL GLOBAL REIT	587,300	372,935.50			
SUNTEC REIT	859,700	1,263,759.00			
シンガポールドル小計			18,254,768	27,199,232.74 (2,259,984,248)	
韓国ウォ ン	投資証券	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,316	286,850,280.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L(N)	22,088	139,817,040.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,383	65,452,250.00	
		JR REIT XXVII	58,060	312,362,800.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17,547	114,230,970.00	
		LOTTE REIT CO LTD	52,265	294,251,950.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,250	77,106,250.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,889	174,893,110.00	



韓国ウォン小計			244,798	1,464,964,650.00 (140,783,102)
イスラエル エルシュケ ル	投資証券	REIT 1 LTD	77,868	1,658,588.40
イスラエルシュケル小計			77,868	1,658,588.40 (60,171,762)
合計				73,285,759,983 (73,285,759,983)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 156銘柄	100.0%	76.5%
加ドル	投資証券 29銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	4.0%
英ポンド	投資証券 35銘柄	100.0%	5.6%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.1%
ニュージーランドドル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.2%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券 28銘柄	100.0%	3.1%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	246,245,378	106,635,154
国債証券	35,720,287,750	37,524,136,555

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
地方債証券	4,675,703,282	4,605,713,063
特殊債券	4,996,105,850	5,196,563,125
社債券	1,822,777,000	1,214,065,000
未収入金	-	100,680,000
未収利息	132,944,059	135,774,239
前払費用	3,553,722	2,400,248
流動資産合計	47,597,617,041	48,885,967,384
資産合計	47,597,617,041	48,885,967,384
負債の部		
流動負債		
未払金	100,031,000	-
未払解約金	13,925,868	10,546,966
未払利息	24	34
流動負債合計	113,956,892	10,547,000
負債合計	113,956,892	10,547,000
純資産の部		
元本等		
元本	33,583,669,363	34,511,107,270
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	13,899,990,786	14,364,313,114
元本等合計	47,483,660,149	48,875,420,384
純資産合計	47,483,660,149	48,875,420,384
負債純資産合計	47,597,617,041	48,885,967,384

## 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)

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
1. 期首	2020年12月16日	2021年 6月16日
期首元本額	31,533,513,015円	33,583,669,363円
期首からの追加設定元本額	2,826,979,509円	1,926,329,524円

期首からの一部解約元本額	776,823,161円	998,891,617円
元本の内訳		
DCインデックスバランス(株式20)	3,882,149,311円	4,215,072,621円
DCインデックスバランス(株式40)	3,519,934,207円	3,876,100,217円
DCインデックスバランス(株式60)	2,565,886,843円	2,828,692,190円
DCインデックスバランス(株式80)	415,102,120円	468,466,795円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,157,077,210円	2,255,495,297円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,014,077,724円	4,128,095,902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)	1,674,097,610円	1,703,336,062円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,828,914円	5,064,550円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	25,501,500円	30,168,828円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	98,168,303円	99,222,763円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	250,623,214円	244,684,329円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,101,720,877円	4,006,663,218円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,451,622,339円	1,450,041,417円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,430,645,642円	1,435,883,956円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	796,392,418円	807,572,901円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	115,009,682円	116,348,085円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,751,351,150円	6,499,708,722円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	329,480,299円	340,489,417円
計	33,583,669,363円	34,511,107,270円
2. 受益権の総数	33,583,669,363口	34,511,107,270口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日	自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2021年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	157,889,890
地方債証券	2,046,820
特殊債券	396,750
社債券	551,000
合計	155,688,820

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2021年 6月15日現在		2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.4139円	1口当たり純資産額	1.4162円
(1万口当たり純資産額)	(14,139円)	(1万口当たり純資産額)	(14,162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

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	100,635,500	
	第2回利付国債(40年)	140,000,000	194,986,400	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	119,153,850	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	133,997,500	
	第5回利付国債(40年)	75,000,000	102,281,250	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	148,028,100	
	第7回利付国債(40年)	80,000,000	103,783,200	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	115,590,300	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	119,059,200	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	133,580,000	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	145,308,800	
	第12回利付国債(40年)	175,000,000	164,414,250	
	第13回利付国債(40年)	180,000,000	168,627,600	
	第14回利付国債(40年)	150,000,000	149,769,000	
	第325回利付国債(10年)	210,000,000	211,466,850	
	第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,247,200	
	第327回利付国債(10年)	65,000,000	65,601,900	
	第328回利付国債(10年)	115,000,000	116,035,000	
	第329回利付国債(10年)	230,000,000	233,180,900	
	第330回利付国債(10年)	210,000,000	213,391,500	
	第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,009,600	
	第333回利付国債(10年)	210,000,000	213,420,900	
	第334回利付国債(10年)	120,000,000	122,174,400	
	第335回利付国債(10年)	490,000,000	498,413,300	
	第336回利付国債(10年)	80,000,000	81,498,400	
	第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,380,700	
	第338回利付国債(10年)	390,000,000	396,630,000	
	第339回利付国債(10年)	370,000,000	376,778,400	
	第340回利付国債(10年)	420,000,000	428,248,800	
	第341回利付国債(10年)	700,000,000	711,704,000	
	第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,194,700	
	第343回利付国債(10年)	245,000,000	247,329,950	
	第344回利付国債(10年)	50,000,000	50,490,500	
	第345回利付国債(10年)	610,000,000	616,295,200	
	第346回利付国債(10年)	690,000,000	697,472,700	
	第347回利付国債(10年)	160,000,000	161,817,600	
	第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,069,200	
	第349回利付国債(10年)	590,000,000	597,316,000	
	第350回利付国債(10年)	680,000,000	688,778,800	
	第351回利付国債(10年)	535,000,000	542,008,500	

第352回利付国債(10年)	590,000,000	598,029,900	
第353回利付国債(10年)	300,000,000	304,236,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	329,751,500	
第355回利付国債(10年)	250,000,000	253,590,000	
第356回利付国債(10年)	200,000,000	202,810,000	
第357回利付国債(10年)	720,000,000	729,856,800	
第358回利付国債(10年)	660,000,000	668,481,000	
第359回利付国債(10年)	550,000,000	556,809,000	
第360回利付国債(10年)	200,000,000	202,284,000	
第361回利付国債(10年)	70,000,000	70,694,400	
第362回利付国債(10年)	250,000,000	252,080,000	
第363回利付国債(10年)	200,000,000	201,326,000	
第364回利付国債(10年)	200,000,000	201,068,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	61,174,500	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	83,881,700	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	96,405,600	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	61,608,500	
第8回利付国債(30年)	80,000,000	94,760,800	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	137,412,720	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	189,418,320	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	45,270,750	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,234,000	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	140,286,300	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	51,150,400	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	52,356,400	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	89,973,100	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	92,190,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	72,683,050	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	90,102,040	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	77,964,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	224,046,400	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	119,185,240	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	193,708,800	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	234,984,640	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	194,600,070	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	157,386,000	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	213,358,400	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	173,452,050	
第34回利付国債(30年)	180,000,000	238,570,200	
第35回利付国債(30年)	168,000,000	217,227,360	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	175,147,650	
第37回利付国債(30年)	161,000,000	206,305,400	

第38回利付国債(30年)	95,000,000	120,232,000	
第39回利付国債(30年)	115,000,000	148,137,250	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	114,308,100	
第41回利付国債(30年)	90,000,000	112,643,100	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	169,138,800	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	194,401,000	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	188,323,500	
第45回利付国債(30年)	160,000,000	194,220,800	
第46回利付国債(30年)	160,000,000	194,347,200	
第47回利付国債(30年)	165,000,000	204,255,150	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	101,462,800	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	167,189,400	
第50回利付国債(30年)	95,000,000	100,512,850	
第51回利付国債(30年)	90,000,000	84,864,600	
第52回利付国債(30年)	130,000,000	128,303,500	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	105,920,850	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	115,969,700	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	115,892,700	
第56回利付国債(30年)	90,000,000	94,649,400	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	105,091,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	104,893,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	174,086,800	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	128,449,200	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	101,968,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	116,100,000	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	84,551,400	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	93,789,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	102,995,200	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	168,652,800	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	108,545,800	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	138,135,200	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	111,478,400	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	111,214,400	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	121,334,400	
第72回利付国債(30年)	80,000,000	80,796,000	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	137,077,655	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	33,606,210	
第60回利付国債(20年)	295,000,000	299,522,350	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	27,379,080	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	31,897,450	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	55,920,240	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	104,071,000	



第66回利付国債(20年)	34,000,000	35,315,800	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	35,550,400	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	82,086,420	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	110,582,160	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	118,872,320	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	120,220,700	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	125,896,560	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,724,200	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	22,383,480	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	42,766,000	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	171,923,200	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	65,008,200	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	142,845,300	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	332,691,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,764,800	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	278,772,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	66,664,200	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	66,676,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	55,828,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	92,928,140	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	109,974,620	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	50,997,600	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	105,984,060	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	132,565,680	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	34,344,600	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	76,389,720	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	94,237,020	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,725,570	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	37,744,410	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	88,501,490	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,312,360	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	150,139,600	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	152,867,200	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	30,936,330	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	113,719,200	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,317,250	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	93,210,400	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	339,242,000	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	61,090,120	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	147,858,750	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	160,251,750	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	404,314,680	

第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,746,900	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	34,728,000	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	193,888,400	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	25,729,880	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	19,732,920	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	232,108,500	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	106,315,200	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	60,127,500	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	124,325,250	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	58,740,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	76,562,200	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	99,313,150	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	175,669,500	
第131回利付国債(20年)	12,000,000	13,936,920	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	157,108,950	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	35,211,900	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	141,142,800	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	34,980,000	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	254,280,400	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	233,766,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	137,758,800	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	266,434,300	
第140回利付国債(20年)	358,000,000	419,432,800	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	228,978,750	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	148,142,500	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	109,573,920	
第144回利付国債(20年)	430,000,000	496,460,800	
第145回利付国債(20年)	355,000,000	418,676,350	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	159,645,600	
第147回利付国債(20年)	98,000,000	114,968,700	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	104,686,200	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	133,980,750	
第150回利付国債(20年)	140,000,000	161,609,000	
第151回利付国債(20年)	140,000,000	158,254,600	
第152回利付国債(20年)	300,000,000	339,402,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	309,268,800	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	181,307,200	
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	163,641,600	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	149,053,500	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	176,050,300	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	157,368,000	

	第160回利付国債(20年)	140,000,000	148,930,600	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	125,707,200	
	第162回利付国債(20年)	150,000,000	157,008,000	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	172,561,950	
	第164回利付国債(20年)	255,000,000	262,295,550	
	第165回利付国債(20年)	170,000,000	174,661,400	
	第166回利付国債(20年)	100,000,000	105,876,000	
	第167回利付国債(20年)	160,000,000	163,984,000	
	第168回利付国債(20年)	100,000,000	100,649,000	
	第169回利付国債(20年)	160,000,000	158,027,200	
	第170回利付国債(20年)	140,000,000	138,020,400	
	第171回利付国債(20年)	170,000,000	167,283,400	
	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	199,304,000	
	第175回利付国債(20年)	140,000,000	141,846,600	
	第176回利付国債(20年)	160,000,000	161,846,400	
	第177回利付国債(20年)	150,000,000	148,788,000	
	第178回利付国債(20年)	120,000,000	121,088,400	
国債証券 合計		34,414,000,000	37,524,136,555	
地方債証券	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,529,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	101,488,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	101,422,000	
	第736回東京都公募公債	100,000,000	101,382,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,859,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	102,009,000	
	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	101,960,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	203,024,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	203,430,000	
	平成26年度第12回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,916,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	100,987,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	200,000,000	203,228,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	106,549,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	100,726,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,370,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,291,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,440,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	101,533,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,614,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,473,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,126,000	

	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,540,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,914,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,410,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	100,642,918	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	100,479,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,861,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	101,071,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	101,824,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	40,000,000	40,171,440	
	第486回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	203,112,000	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,748,000	
	第51回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,012,705	
	第53回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,037,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,988,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	100,058,000	
	平成25年度第2回福井県公募公債	200,000,000	202,512,000	
地方債証券 合計		4,540,000,000	4,605,713,063	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,575,925	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,381,000	
	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,766,000	
	第5回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,540,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	202,804,000	
	第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,638,200	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,411,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	200,094,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,990,000	
	第17回道路債券	100,000,000	101,551,000	
	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	111,962,000	
	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	113,564,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,888,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,512,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,278,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,326,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,373,000	
	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	101,657,000	
	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	100,087,000	
	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	201,042,000	
	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	100,948,000	

	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,883,000	
	第13回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,550,000	
	第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,882,000	
	F54回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,563,000	
	第56回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,635,000	
	第60回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,760,000	
	第62回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,621,000	
	F63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,510,000	
	第74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,840,000	
	第81回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,756,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,194,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,714,000	
	F101回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,376,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,406,000	
	F290回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,612,000	
	第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	100,850,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,856,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	101,642,000	
	第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,297,000	
	第357回信金中金債(5年)	100,000,000	99,972,000	
	第363回信金中金債(5年)	100,000,000	99,900,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	101,976,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	100,380,000	
特殊債券 合計		5,100,000,000	5,196,563,125	
社債券	第15回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,547,000	
	第25回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付)	100,000,000	101,456,000	
	第21回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,362,000	
	第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,375,000	
	第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,482,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,490,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	201,636,000	
	第20回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,435,000	
	第26回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,073,000	
	第19回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,209,000	
社債券 合計		1,200,000,000	1,214,065,000	
合計		45,254,000,000	48,540,477,743	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	85,726,636	61,986,827
コール・ローン	93,723,484	48,048,218
国債証券	157,224,720,729	156,876,621,690
派生商品評価勘定	-	258,144
未収入金	-	81,893,903
未収利息	894,291,366	818,045,134
前払費用	15,198,463	18,989,205
流動資産合計	158,313,660,678	157,905,843,121
<b>資産合計</b>		
158,313,660,678		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	89,650
未払解約金	86,760,800	93,646,319
未払利息	9	15
流動負債合計	86,760,809	93,735,984
<b>負債合計</b>		
86,760,809		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	61,765,152,571	61,191,933,864
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	96,461,747,298	96,620,173,273
元本等合計	158,226,899,869	157,812,107,137
<b>純資産合計</b>		
158,226,899,869		
<b>負債純資産合計</b>		
158,313,660,678		

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

		2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
1.	期首	2020年12月16日	2021年 6月16日
	期首元本額	62,161,310,314円	61,765,152,571円
	期首からの追加設定元本額	1,654,984,705円	3,395,651,409円
	期首からの一部解約元本額	2,051,142,448円	3,968,870,116円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	14,223,403,295円	15,021,626,084円
	DCインデックスバランス(株式20)	330,974,579円	356,781,056円
	DCインデックスバランス(株式40)	433,736,361円	473,360,426円
	DCインデックスバランス(株式60)	568,664,896円	621,705,070円
	DCインデックスバランス(株式80)	459,978,672円	514,101,494円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	21,607,122,055円	19,742,737,608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	2,225,911,412円	2,291,024,266円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	14,933,451,248円	14,330,021,810円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	909,513,094円	884,686,139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)	158,364,070円	157,019,480円
	財産3分法(適格機関投資家専用)	768,180円	52,645,473円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,703,044円	2,776,752円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	2,862,916円	3,297,985円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,050,990円	6,061,878円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	10,684,961円	10,315,096円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	781,105,925円	1,734,024,463円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	762,476,464円	734,471,822円

		2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,901,981円	61,320,675円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	88,119,511円	87,538,839円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	88,562,550円	88,677,118円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	63,794,369円	63,909,573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	3,772,615,369円	3,671,000,312円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	272,386,629円	282,830,445円
	計	61,765,152,571円	61,191,933,864円
2.	受益権の総数	61,765,152,571口	61,191,933,864口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項



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

(有価証券に関する注記)

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2021年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,091,978,072
合計	2,091,978,072

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2021年 6月15日現在)

該当事項はありません。

（2021年12月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	99,021,352	-	98,852,858	168,494
	メキシコペソ	32,154,888	-	31,896,744	258,144
	ユーロ	31,413,900	-	31,417,060	3,160
	英ポンド	35,452,564	-	35,539,054	86,490
	合計	99,021,352	-	98,852,858	168,494

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年 6月15日現在		2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2.5618円	1口当たり純資産額	2.5790円
(1万口当たり純資産額)	(25,618円)	(1万口当たり純資産額)	(25,790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-2.0%-22/11/30	3,410,000.00	3,465,444.21	
		US TREASURY N/B-1.625%-22/12/15	2,040,000.00	2,066,877.61	
		US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	3,900,000.00	3,972,058.35	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/01/15	3,000,000.00	3,037,441.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/01/31	2,000,000.00	2,031,250.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-23/01/31	1,580,000.00	1,615,765.98	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/01/31	3,000,000.00	2,991,914.07	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	2,300,000.00	2,343,574.19	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/02/15	1,500,000.00	1,517,519.40	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/02/28	3,100,000.00	3,141,716.70	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/02/28	880,000.00	903,632.75	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/03/15	2,000,000.00	2,001,953.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-23/03/31	2,000,000.00	2,027,148.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/03/31	2,130,000.00	2,186,078.85	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/04/15	3,500,000.00	3,490,224.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/04/30	1,160,000.00	1,178,306.19	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/04/30	3,600,000.00	3,711,867.12	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	2,650,000.00	2,697,099.51	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/05/15	2,970,000.00	2,954,627.93	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,524,462.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,342,478.41	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,490,136.72	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,519,804.65	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	2,350,000.00	2,425,869.98	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,662,255.47	
		US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	3,033,515.40	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	3,106,581.90	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/31	7,000,000.00	6,949,687.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,468,523.04	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	3,860,000.00	3,830,823.84	
US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	4,550,000.00	4,609,896.20			

US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,975,273.43	
US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,533,740.00	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	686,644.86	
US TREASURY N/B-0.25%-23/09/30	3,500,000.00	3,477,304.67	
US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,387,175.77	
US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,731,410.05	
US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	937,423.80	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	4,159,531.20	
US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	8,000,000.00	7,938,593.76	
US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,756,317.02	
US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,887,914.70	
US TREASURY N/B-0.5%-23/11/30	5,000,000.00	4,984,570.30	
US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,966,835.93	
US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	2,063,203.00	
US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,566,484.37	
US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	2,064,687.40	
US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,614,500.00	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,443,472.45	
US TREASURY N/B-0.125%-24/02/15	5,000,000.00	4,935,937.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,545,351.45	
US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,688,068.75	
US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,941,992.20	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	3,977,760.10	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	2,056,484.20	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	3,101,835.90	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,515,727.95	
US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,600,000.00	2,564,351.55	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	3,980,053.12	
US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,630,050.79	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,366,484.26	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,719,953.74	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,571,313.93	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	2,640,000.00	2,700,740.59	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,801,009.75	
US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,932,910.15	

US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,456,886.63	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,321,472.57	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	2,082,376.56	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,234,976.48	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,130,449.13	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	1,860,000.00	1,889,280.30	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	1,650,000.00	1,711,681.62	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,447,523.42	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,522,863.02	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,972,511.60	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,329,706.95	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,569,081.90	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,549,350.25	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,666,961.37	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,172,173.38	
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,544,571.79	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,250,000.00	2,365,488.22	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	1,570,000.00	1,542,770.31	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,332,171.82	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,100,869.14	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	4,800,000.00	4,968,937.44	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,220,033.16	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	1,962,871.87	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,449,095.99	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,530,618.62	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,908,242.18	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	5,020,000.00	5,180,208.28	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	3,177,304.50	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,700,000.00	5,027,163.71	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	320,000.00	309,662.49	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,498,929.60	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	3,800,000.00	3,671,898.42	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,140,000.00	5,356,040.36	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,408,429.57	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,315,930.46	

US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	2,116,484.20	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,958,109.37	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	5,000,000.00	4,837,500.00	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	2,155,429.62	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,368,571.44	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,886,282.31	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,546,773.43	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	2,161,290.10	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,355,000.00	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	6,100,000.00	6,405,952.82	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,686,912.50	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,926,023.25	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,850,135.12	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,744,656.26	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	2,058,828.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	2,960,000.00	3,048,106.17	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	3,172,005.45	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	4,050,468.40	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,934,960.93	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,649,362.50	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,950,312.50	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,494,406.25	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	3,150,318.56	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,922,018.75	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	2,049,765.60	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	2,000,000.00	2,025,312.40	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	360,000.00	377,873.42	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	993,476.56	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,170,958.59	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	960,234.38	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,733,526.38	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,533,750.00	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,300,000.00	3,161,296.87	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,901,562.50	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	3,112,162.35	

US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,100,000.00	2,007,386.72	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,590,000.00	4,351,714.46	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	5,000,000.00	4,766,015.60	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,860,000.00	3,648,957.59	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	3,179,375.66	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	211,122.65	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,797,578.13	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	5,000,000.00	4,825,781.25	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	4,335,937.20	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,783,321.87	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	3,960,000.00	3,935,559.35	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,347,884.37	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	5,399,265.37	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	4,269,093.75	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	3,275,250.00	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,850,307.80	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,602,937.50	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,835,558.58	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,964,375.00	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	4,000,000.00	3,996,250.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,345,525.00	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	5,031,820.98	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	1,870,000.00	2,029,242.09	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,880,000.00	4,150,084.08	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,140,000.00	3,197,648.20	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	2,890,000.00	2,972,692.14	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	4,379,246.18	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,471,660.85	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	4,309,041.78	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,769,091.38	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	5,841,971.46	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	660,000.00	888,808.53	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	8,400,000.00	8,200,664.05	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	7,623,755.87	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,650,000.00	4,576,617.18	

US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	3,000,000.00	2,982,656.25	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	1,117,343.68	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	1,108,154.25	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	937,319.48	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	1,022,287.46	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	1,018,062.48	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	2,015,443.30	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	2,032,263.95	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	1,059,492.15	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	989,771.82	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	2,257,489.31	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	3,284,328.12	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,924,424.92	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	1,700,000.00	1,502,242.19	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,413,487.02	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,856,722.66	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	2,232,363.15	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	700,000.00	700,820.26	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	1,240,395.62	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	3,000,000.00	3,185,859.30	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	1,268,474.97	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	690,000.00	675,553.12	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	609,511.70	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	923,187.44	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	2,308,515.60	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	2,154,196.26	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	2,412,673.70	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	2,562,117.09	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	2,799,783.43	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	1,424,081.19	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,200,000.00	2,806,202.96	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	2,646,935.52	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,781,831.83	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	3,300,000.00	3,684,913.98	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,700,343.68	



		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	2,390,000.00	2,850,634.97	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	2,700,000.00	3,293,577.99	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,800,000.00	3,143,218.68	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	2,500,000.00	2,809,375.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	2,311,669.89	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	2,000,000.00	2,406,796.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,800,000.00	3,448,156.04	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	2,680,000.00	3,309,695.21	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	2,369,609.20	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	3,367,951.45	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	3,418,271.45	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	3,054,187.44	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	5,108,984.17	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	3,930,875.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	4,133,765.46	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	3,682,734.30	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	3,220,454.82	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	3,476,117.11	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	3,837,304.41	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	2,126,044.92	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	2,300,902.93	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	2,853,281.25	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	4,795,737.27	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	4,620,187.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	2,081,406.20	
米ドル小計			628,090,000.00	656,643,736.57 (74,726,057,221)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/02/01	770,000.00	765,785.79	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-23/03/01	2,210,000.00	2,236,199.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/05/01	740,000.00	734,268.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,029,860.34	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/08/01	810,000.00	801,722.61	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,497,453.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	500,000.00	495,896.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	811,332.37	

		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	950,000.00	933,466.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,120,000.00	1,159,271.68	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	804,138.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	220,000.00	217,807.48	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	611,933.09	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	985,702.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	2,165,000.00	2,111,418.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	955,079.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	779,019.01	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,440,000.00	1,421,676.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	640,983.85	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	738,244.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	720,000.00	946,491.84	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	574,000.00	612,474.64	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	2,179,785.17	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,005,000.00	929,129.53	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	620,000.00	623,846.48	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	785,000.00	1,128,200.43	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	600,000.00	870,979.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	740,000.00	1,015,134.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	990,000.00	1,324,096.29	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	945,000.00	1,141,334.14	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,703,000.00	2,834,563.11	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	370,000.00	363,632.67	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	421,291.64	
		加ドル小計	32,267,000.00	34,122,220.73 (3,021,181,423)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	12,100,000.00	12,131,460.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	16,200,000.00	16,525,620.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	17,900,000.00	18,327,921.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	16,700,000.00	18,033,390.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	23,113,281.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,600,000.00	20,889,687.50	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	19,870,000.00	21,276,423.43	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	16,900,000.00	17,367,390.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,300,000.00	5,437,468.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	5,100,000.00	6,227,578.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	14,150,000.00	15,107,335.93	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	12,500,000.00	12,371,093.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	13,709,940.62	
		メキシコペソ小計	195,140,000.00	200,518,592.46 (1,075,521,574)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	248,782.24	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	855,000.00	893,393.77	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	615,000.00	625,212.69	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	975,000.00	1,056,502.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	840,000.00	868,481.88	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,265,000.00	1,327,680.75	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	818,263.63	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	1,132,000.00	1,210,398.92	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	930,000.00	994,815.42	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	507,263.13	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,320,000.00	1,823,502.12	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	1,039,846.36	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,120,000.00	1,220,278.08	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	820,131.68	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	1,106,340.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	390,000.00	391,107.99	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	660,000.00	939,748.26	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	805,000.00	922,232.15	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	739,390.06	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,305,000.00	2,145,254.26	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	500,349.95	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	535,000.00	673,864.60	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	329,030.79	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,187,000.00	2,033,543.47	

BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	665,000.00	1,145,293.59
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	770,000.00	955,887.24
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	720,000.00	921,097.85
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	610,878.98
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	737,839.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	555,000.00	534,972.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%-23/01/31	1,425,000.00	1,522,186.42
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-23/04/30	1,313,000.00	1,323,196.23
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-23/07/30	1,290,000.00	1,308,981.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,495,000.00	1,636,262.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,185,000.00	1,320,976.38
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,340,000.00	1,478,771.74
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-24/05/31	1,000,000.00	1,011,025.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,180,000.00	1,202,348.02
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,520,000.00	1,663,205.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,430,000.00	1,449,569.55
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,450,000.00	1,550,156.57
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,490,000.00	1,764,623.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,575,000.00	1,730,491.87
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,270,000.00	1,285,522.17
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,335,000.00	1,466,898.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,490,000.00	1,919,963.34
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,720,000.00	1,853,035.12

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,611,052.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,315,000.00	1,383,360.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,600,000.00	1,747,507.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	910,000.00	912,818.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,470,000.00	1,606,514.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,475,000.00	1,617,426.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,155,000.00	1,567,352.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,745,000.00	2,502,066.67	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,345,000.00	1,485,418.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,470,000.00	1,530,763.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,420,000.00	1,463,608.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,430,000.00	1,650,189.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,660,000.00	1,813,930.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,455,000.00	1,433,892.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	810,000.00	823,386.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,500,000.00	2,354,712.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,370,000.00	1,666,406.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,415,000.00	1,649,267.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,400,000.00	2,132,783.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%- 37/07/30	670,000.00	681,381.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,260,000.00	2,178,828.54	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%- 40/10/31	1,000,000.00	1,061,699.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,300,000.00	2,228,517.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 42/07/30	300,000.00	307,922.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	990,000.00	1,868,030.01	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,170,000.00	1,675,019.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	985,000.00	1,377,359.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 50/10/31	1,170,000.00	1,147,090.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	848,000.00	1,388,124.27	
BUNDESobligation-0.0%-23/04/14	1,750,000.00	1,766,796.50	
BUNDESobligation-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,120,231.32	
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,322,216.09	
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,388,188.72	
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,550,000.00	1,585,712.00	
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	865,000.00	887,157.84	
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,644,120.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,900,000.00	1,949,504.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,720,000.00	1,774,632.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	1,850,000.00	1,934,999.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	790,000.00	905,669.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	1,230,000.00	1,297,147.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	1,875,000.00	1,976,932.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,830,000.00	1,914,990.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,770,000.00	1,838,525.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	1,740,000.00	1,847,615.52	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	2,685,000.00	2,813,861.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	2,320,000.00	2,388,558.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,125,000.00	2,218,699.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	910,000.00	1,279,353.53	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	2,090,000.00	2,219,345.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,150,000.00	1,189,134.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,596,086.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,845,000.00	1,967,480.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,318,024.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,759,435.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,080,000.00	1,118,550.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,975,000.00	2,086,004.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,830,000.00	1,900,272.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,230,000.00	1,921,517.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,410,000.00	1,466,027.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,700,000.00	1,767,938.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	420,000.00	439,176.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,731,391.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	2,420,000.00	2,513,295.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	160,000.00	165,826.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	415,840.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,475,000.00	2,454,149.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	1,237,312.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	1,028,885.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,983,203.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	2,244,743.41
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,680,000.00	3,291,353.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,658,743.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	2,325,000.00	3,788,441.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,592,000.00	4,343,023.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	2,793,453.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,330,000.00	1,364,548.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	360,000.00	373,672.44
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-22/12/15	650,000.00	654,457.70
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/09/15	1,315,000.00	1,331,248.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	297,732.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.05%- 23/01/15	600,000.00	603,813.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/01	910,000.00	926,058.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 23/03/15	1,200,000.00	1,221,832.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	1,025,000.00	1,096,295.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 23/06/15	1,000,000.00	1,016,924.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,700,000.00	1,844,959.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 23/08/15	990,000.00	1,002,593.79



BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,310,000.00	1,377,533.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,160,000.00	1,182,710.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	1,011,646.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/15	1,110,000.00	1,117,107.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,825,480.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/04/15	1,360,000.00	1,367,548.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,129,677.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,360,000.00	1,427,851.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/08/15	200,000.00	200,833.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,450,000.00	1,605,650.39	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,318,945.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,080,000.00	1,164,750.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,506,554.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,792,955.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	765,000.00	804,640.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,370,254.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	1,066,744.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,300,000.00	1,427,162.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,480,000.00	1,596,208.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	1,150,000.00	1,170,182.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,730,000.00	2,053,629.37	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,220,000.00	1,213,886.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,230,000.00	1,311,087.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,329,873.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	969,141.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,565,000.00	1,647,632.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,216,858.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,281,594.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,395,000.00	1,530,077.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,145,000.00	1,184,517.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,960,000.00	2,662,072.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,785,000.00	1,960,233.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,216,394.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	660,000.00	660,828.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,706,636.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,255,000.00	1,454,178.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,380,000.00	1,629,252.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	2,050,000.00	2,790,544.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,740,000.00	2,137,215.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,330,000.00	1,400,446.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	1,186,371.03	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,452,000.00	1,558,973.19	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,375,000.00	1,382,521.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,125,000.00	3,130,290.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,245,000.00	1,213,349.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	780,000.00	781,786.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,610,000.00	1,724,116.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,575,000.00	2,371,014.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	1,314,315.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	2,304,651.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	1,050,000.00	1,327,457.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	928,756.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	1,100,000.00	1,250,089.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,205,000.00	3,031,233.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,489,959.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,600,000.00	2,501,467.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	610,000.00	772,502.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,520,000.00	2,414,796.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	872,189.73
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,345,000.00	2,163,341.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	433,366.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	1,485,296.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,270,000.00	1,543,051.27

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,135,000.00	1,562,242.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	850,000.00	1,252,475.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	1,060,000.00	1,227,877.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	850,000.00	841,506.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	680,000.00	801,411.28	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	330,000.00	340,061.04	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	370,000.00	374,301.99	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	323,000.00	343,747.58	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	285,000.00	290,255.68	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	425,000.00	496,105.05	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	320,000.00	337,891.84	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	535,000.00	559,872.15	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	102,334.10	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	421,910.80	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	459,747.94	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	285,650.55	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	460,000.00	488,495.62	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	112,000.00	113,872.52	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	525,000.00	570,609.37	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	365,000.00	416,206.21	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	400,000.00	401,337.20	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	220,000.00	223,863.08	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	342,000.00	516,757.89	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	338,443.30	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	240,776.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	452,027.79	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-23/03/25	2,490,000.00	2,510,723.77	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	960,000.00	1,080,177.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	3,160,000.00	3,270,075.44	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,630,000.00	3,965,524.53	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25	1,140,000.00	1,156,222.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,425,611.00	

FRANCE (GOVT OF) -2.25%-24/05/25	2,824,000.00	3,025,771.97	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	2,758,000.00	2,951,244.78	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-25/03/25	2,635,000.00	2,682,887.42	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,705,724.36	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,550,000.00	3,206,900.40	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	2,770,000.00	2,937,094.71	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,836,747.00	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,610,402.89	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	2,350,000.00	2,452,269.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	3,010,000.00	3,114,347.67	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-27/02/25	360,000.00	367,358.40	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	2,615,000.00	2,818,253.49	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,350,000.00	3,979,759.80	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	3,250,000.00	3,480,191.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	3,030,000.00	3,253,674.60	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,745,000.00	3,930,831.76	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	2,780,000.00	2,936,438.94	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,780,000.00	2,825,010.98	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,275,000.00	4,030,064.35	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	3,049,000.00	3,080,026.31	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,490,000.00	4,017,150.54	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-31/11/25	2,165,000.00	2,169,555.16	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,540,000.00	4,145,412.08	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,745,000.00	3,122,415.54	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	1,735,000.00	2,802,875.15	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,755,000.00	3,156,800.22	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,810,000.00	2,937,315.06	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,060,000.00	2,588,849.38	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	3,035,000.00	5,400,236.20	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	960,000.00	970,490.88	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,630,000.00	2,642,526.66	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,830,000.00	2,498,275.74	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	2,160,000.00	2,681,182.08	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	2,370,000.00	2,449,489.80	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,300,000.00	2,618,328.70	

FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,140,000.00	2,423,482.68	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	1,137,623.85	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	440,000.00	465,172.40	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	500,000.00	546,022.50	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	760,000.00	907,769.84	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	775,000.00	825,265.72	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	504,290.36	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	559,460.20	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	700,000.00	765,995.30	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	651,000.00	791,329.56	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	177,000.00	181,176.88	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	575,000.00	651,134.60	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	555,000.00	553,344.43	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	355,000.00	401,713.74	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	315,598.47	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	470,905.50	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	254,268.75	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	589,000.00	787,292.74	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	519,000.00	633,891.03	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	355,000.00	372,597.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	525,000.00	572,343.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,070,000.00	1,112,727.24	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	980,000.00	993,797.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,044,000.00	1,116,470.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,305,000.00	1,344,478.86	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,240,000.00	1,302,244.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	968,000.00	993,662.63	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	1,025,000.00	1,098,451.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	825,000.00	1,131,189.67	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	1,038,582.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	280,000.00	287,351.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	765,000.00	801,472.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	875,000.00	898,402.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	580,000.00	593,111.48	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,025,000.00	1,334,755.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,150,000.00	1,872,149.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	100,000.00	100,690.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	1,073,000.00	1,189,296.03	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,240,000.00	2,199,368.16	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,279,000.00	2,178,805.90	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	685,000.00	674,194.12	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	248,269.49	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	712,620.06	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	196,570.42	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/04/20	430,000.00	433,811.95	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	570,000.00	576,270.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	895,000.00	935,662.53	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	564,185.25	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	855,000.00	912,203.77	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	200,000.00	203,638.52	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	758,861.49	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	600,000.00	740,436.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	1,003,000.00	1,063,657.42	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	720,018.29	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	680,000.00	940,527.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	706,591.83	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	640,000.00	676,556.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	740,000.00	752,081.24	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	672,300.68	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	610,000.00	792,524.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	215,000.00	217,400.47	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	980,000.00	1,588,609.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	260,000.00	248,545.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	464,000.00	767,341.62	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	651,535.39	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	335,000.00	369,888.91	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	282,000.00	624,168.92	
	ユーロ小計	401,541,000.00	474,234,351.79 (60,811,070,930)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	932,885.20

UK TREASURY-0.125%-23/01/31	1,710,000.00	1,708,013.90	
UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,310,000.00	1,353,311.74	
UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,530,000.00	1,520,299.80	
UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,130,000.00	1,147,279.96	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	930,431.42	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,380,437.39	
UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	819,495.87	
UK TREASURY-0.125%-26/01/30	1,010,000.00	996,286.22	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	858,658.08	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	1,200,000.00	1,249,608.00	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,108,161.60	
UK TREASURY-0.125%-28/01/31	845,000.00	824,643.61	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	890,000.00	955,237.00	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	974,684.45	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	874,401.26	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	1,220,000.00	1,190,891.28	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,459,695.20	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,330,000.00	1,271,955.05	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,854,160.74	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	120,000.00	121,314.00	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,369,841.64	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,057,000.00	1,017,626.75	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,170,000.00	1,698,957.00	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,606,195.50	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,010,000.00	1,625,968.70	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,500,774.30	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	1,474,925.10	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	595,000.00	626,813.46	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,410,000.00	2,371,628.46	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,435,000.00	2,092,495.47	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,450,000.00	2,218,137.50	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	427,496.25	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,275,000.00	2,211,607.86	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,460,000.00	1,650,340.20	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	811,858.95	



		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	1,635,308.20	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	540,000.00	506,536.20	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,107,000.00	1,959,643.28	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	774,924.28	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	1,062,000.00	2,132,759.37	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	1,386,028.89	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	826,000.00	1,711,059.00	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	830,000.00	768,431.59	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	980,000.00	2,075,003.00	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,405,000.00	1,415,692.05	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	885,000.00	935,659.17	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	1,107,000.00	1,856,494.35	
英ポンド小計			49,187,000.00	63,394,058.29	(9,546,511,237)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,500,000.00	6,716,881.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	5,220,000.00	5,695,834.84	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,200,000.00	5,465,772.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	4,138,020.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	4,400,000.00	4,644,970.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,597,716.83	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	2,195,019.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,185,000.00	4,872,997.76	
スウェーデンクローナ小計			32,855,000.00	36,327,212.03	(452,273,789)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,520,000.00	5,601,795.36	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,340,000.00	4,517,766.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,390,000.00	3,442,036.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,769,140.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,640,000.00	2,690,212.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,740,000.00	2,840,284.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,770,000.00	2,833,987.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,550,000.00	3,529,765.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	2,004,504.00	
ノルウェークローネ小計			29,740,000.00	30,229,491.06	(377,868,638)

デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	3,340,000.00	3,476,819.76	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,260,000.00	1,279,945.80	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	4,610,000.00	5,015,062.26	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,510,000.00	4,739,085.45	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,830,000.00	2,997,988.80	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,150,000.00	1,162,855.96	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	11,080,000.00	20,235,762.99	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	1,350,843.00	
デンマーククローネ小計			30,080,000.00	40,258,364.02	(694,054,195)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-23/01/25	2,100,000.00	2,093,091.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-23/04/25	1,330,000.00	1,279,792.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,750,000.00	1,787,100.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	2,088,414.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,130,000.00	2,086,697.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,334,592.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,690,000.00	2,695,433.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,090,000.00	2,989,853.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,750,000.00	1,514,607.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,160,000.00	2,070,230.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,260,000.00	2,194,821.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	647,601.69	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,965,000.00	2,862,974.35	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,125,000.00	1,812,837.50	
ポーランドズロチ小計			28,455,000.00	27,458,047.24	(760,272,141)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,350,000.00	1,443,824.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	755,000.00	792,572.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,535,000.00	1,508,021.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,220,000.00	1,308,689.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,110,000.00	1,071,106.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,280,000.00	1,444,977.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,140,000.00	1,100,220.93	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,270,000.00	1,496,321.36	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	1,160,000.00	1,252,299.46	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	950,000.00	1,000,971.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	840,000.00	914,528.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,130,000.00	1,273,439.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	1,090,000.00	1,194,592.69	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,650,000.00	1,781,865.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,700,000.00	1,625,062.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,548,000.00	1,543,276.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,920,000.00	1,823,914.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,480,000.00	1,435,079.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	790,000.00	802,641.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,347,665.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	593,572.06	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	935,719.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	780,269.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	890,000.00	975,482.27	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	870,000.00	996,175.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	910,753.68	
豪ドル小計			29,675,000.00	31,353,047.11	(2,537,088,572)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.75%-23/02/01	630,000.00	637,875.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	545,000.00	561,786.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	360,000.00	368,703.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	569,484.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	410,000.00	427,630.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	349,000.00	340,065.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	487,249.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	475,000.00	524,542.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	309,720.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	500,000.00	544,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	592,380.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	210,000.00	210,184.94	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	405,000.00	470,610.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	523,955.82	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	234,960.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	372,000.00	421,509.48	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	439,000.00	501,338.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	432,000.00	419,472.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	150,000.00	147,048.75	
シンガポールドル小計			7,838,000.00	8,293,014.09 (689,066,540)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	630,000.00	642,789.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	700,000.00	717,465.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	788,058.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	857,971.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	520,000.00	536,493.77	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,650,000.00	1,707,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	805,701.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	950,000.00	982,359.37	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,136,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,350,360.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	885,000.00	819,454.68	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	753,863.04	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,093,950.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	850,000.00	885,328.12	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	890,000.00	964,259.37	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	644,900.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,270,000.00	1,213,643.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	570,000.00	623,377.82	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	720,000.00	761,338.08	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	857,826.63	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,010,000.00	986,643.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,130,000.00	1,148,249.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	972,712.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	920,000.00	970,188.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	464,886.58	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	961,875.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,220,000.00	1,239,520.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	966,973.28			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,083,149.75			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	988,400.46			

マレーシアリングット小計			27,165,000.00	27,926,338.34 (750,263,420)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.36%-23/07/02	3,000,000.00	2,995,146.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-23/10/18	3,000,000.00	3,046,564.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	3,000,000.00	3,022,552.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	2,000,000.00	1,995,990.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	2,000,000.00	2,020,823.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	1,000,000.00	978,912.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	3,000,000.00	3,038,710.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	3,000,000.00	3,042,051.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,001,093.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	4,000,000.00	4,015,144.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	3,000,000.00	3,026,321.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,001,960.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	2,000,000.00	2,053,893.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	2,000,000.00	2,059,602.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	1,000,000.00	1,012,246.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	2,000,000.00	2,126,803.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	2,000,000.00	2,106,705.00			
中国元小計			38,000,000.00	38,544,518.20 (688,863,774)	
イスラエル スケジュール	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.25%-22/11/30	1,000,000.00	1,011,786.30	
		ISRAEL FIXED BOND-4.25%-23/03/31	1,210,000.00	1,275,935.92	
		ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	1,160,000.00	1,162,532.15	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,250,000.00	1,285,229.50	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,536,852.36	
		ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	130,000.00	130,696.38	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,368,449.68	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,307,106.07	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	531,588.88	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	1,100,000.00	1,406,948.95	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,366,720.91	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,150,000.00	1,268,352.36	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,615,000.00	1,621,789.61	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,160,000.00	1,130,667.08	

	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,260,000.00	2,041,240.57	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,620,000.00	2,131,580.44	
イスラエルシェケル小計		18,475,000.00	20,577,477.16 (746,528,236)	
合計			156,876,621,690 (156,876,621,690)	

(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 231銘柄	100.0%	47.7%
加ドル	国債証券 33銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 332銘柄	100.0%	38.8%
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%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
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。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	113,099,844	210,304,672
株式	39,658,539,130	41,523,001,320
派生商品評価勘定	2,824,000	3,693,950
未収配当金	241,649,762	4,783,878
流動資産合計	40,016,112,736	41,741,783,820
資産合計	40,016,112,736	41,741,783,820
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	355,000	2,250,000
未払解約金	3,468,252	1,134,316
未払利息	11	67
流動負債合計	3,823,263	3,384,383
負債合計	3,823,263	3,384,383
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	21,062,249,461	21,660,098,146
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	18,950,040,012	20,078,301,291
元本等合計	40,012,289,473	41,738,399,437
純資産合計	40,012,289,473	41,738,399,437
負債純資産合計	40,016,112,736	41,741,783,820

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
1.	期首	2020年12月16日	2021年 6月16日
	期首元本額	21,288,735,361円	21,062,249,461円
	期首からの追加設定元本額	1,145,710,249円	1,559,967,577円
	期首からの一部解約元本額	1,372,196,149円	962,118,892円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	674,884,947円	713,535,414円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,768,086,641円	1,891,794,953円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,497,192,186円	3,728,234,867円
	DCインデックスバランス（株式80）	3,751,992,346円	4,102,788,647円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,340,664,541円	1,432,042,255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	3,013,674,301円	3,075,583,467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）	633,500,537円	636,617,068円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	43,611,526円	44,981,652円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	35,027,324円	39,061,126円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	49,066,520円	47,318,716円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	43,386,695円	41,000,535円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,102,985,720円	2,900,045,612円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	251,031,064円	243,251,470円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	719,456,282円	691,633,341円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,090,176,263円	1,054,250,147円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,047,512,568円	1,017,958,876円
	計	21,062,249,461円	21,660,098,146円
2.	受益権の総数	21,062,249,461口	21,660,098,146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	516,935,000円	650,530,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日	自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2021年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	669,593,846
合計	669,593,846

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2021年 6月15日現在)

(単位:円)

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

(2021年12月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	214,540,000	-	218,240,000	3,700,000
合計		214,540,000	-	218,240,000	3,700,000

(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)

2021年 6月15日現在		2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.8997円	1口当たり純資産額	1.9270円
(1万口当たり純資産額)	(18,997円)	(1万口当たり純資産額)	(19,270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	3,090.00	2,163,000	
日本水産	20,700	533.00	11,033,100	
マルハニチロ	3,200	2,419.00	7,740,800	
雪国まいたけ	1,600	1,195.00	1,912,000	
カネコ種苗	600	1,415.00	849,000	
サカタのタネ	2,500	3,370.00	8,425,000	
ホクト	1,700	1,905.00	3,238,500	
ホクリヨウ	400	698.00	279,200	
住石ホールディングス	3,600	131.00	471,600	
日鉄鉱業	500	6,420.00	3,210,000	
三井松島ホールディングス	900	1,412.00	1,270,800	
I N P E X	83,200	987.00	82,118,400	
石油資源開発	2,400	2,575.00	6,180,000	
K & O エナジーグループ	1,000	1,473.00	1,473,000	
ヒノキヤグループ	500	2,334.00	1,167,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,270.00	15,810,000	
ミライト・ホールディングス	6,700	1,963.00	13,152,100	
サンヨーホームズ	300	724.00	217,200	

日本アクア	900	720.00	648,000
ファーストコーポレーション	700	697.00	487,900
ベステラ	500	1,285.00	642,500
キャンディル	500	505.00	252,500
スペースバリューホールディングス	2,300	1,148.00	2,640,400
ダイセキ環境ソリューション	400	1,609.00	643,600
第一カッター興業	600	1,342.00	805,200
安藤・間	11,400	888.00	10,123,200
東急建設	6,100	658.00	4,013,800
コムシスホールディングス	6,700	2,584.00	17,312,800
ピーアールホールディングス	2,900	346.00	1,003,400
高松コンストラクショングループ	1,300	1,969.00	2,559,700
東建コーポレーション	600	9,180.00	5,508,000
ソネック	300	1,011.00	303,300
ヤマウラ	1,000	946.00	946,000
オリエンタル白石	7,200	229.00	1,648,800
大成建設	13,900	3,545.00	49,275,500
大林組	48,000	880.00	42,240,000
清水建設	44,900	720.00	32,328,000
飛島建設	1,300	1,011.00	1,314,300
長谷工コーポレーション	14,300	1,428.00	20,420,400
松井建設	1,900	762.00	1,447,800
銭高組	200	3,840.00	768,000
鹿島建設	35,200	1,348.00	47,449,600
不動テトラ	1,100	1,707.00	1,877,700
大末建設	600	1,164.00	698,400
鉄建建設	1,100	1,823.00	2,005,300
西松建設	2,900	3,475.00	10,077,500
三井住友建設	10,900	423.00	4,610,700
大豊建設	700	3,725.00	2,607,500
ナカノフドー建設	1,300	329.00	427,700
奥村組	2,800	3,265.00	9,142,000
東鉄工業	2,200	2,469.00	5,431,800
イチケン	400	1,890.00	756,000
富士ピー・エス	700	518.00	362,600
浅沼組	600	5,280.00	3,168,000
戸田建設	19,900	735.00	14,626,500
熊谷組	2,500	2,893.00	7,232,500
北野建設	300	2,036.00	610,800
植木組	500	1,480.00	740,000
矢作建設工業	2,200	769.00	1,691,800
ピーエス三菱	1,600	599.00	958,400

日本ハウスホールディングス	3,400	422.00	1,434,800
大東建託	4,900	12,990.00	63,651,000
新日本建設	2,100	835.00	1,753,500
N I P P O	4,000	3,995.00	15,980,000
東亜道路工業	300	4,740.00	1,422,000
日本道路	500	8,240.00	4,120,000
東亜建設工業	1,200	2,436.00	2,923,200
日本国土開発	4,800	561.00	2,692,800
若築建設	800	1,934.00	1,547,200
東洋建設	5,500	579.00	3,184,500
五洋建設	19,000	685.00	13,015,000
福田組	500	4,340.00	2,170,000
住友林業	12,300	2,331.00	28,671,300
日本基礎技術	1,500	602.00	903,000
巴コーポレーション	2,200	459.00	1,009,800
大和ハウス工業	44,300	3,283.00	145,436,900
ライト工業	3,000	2,020.00	6,060,000
積水ハウス	52,000	2,346.00	121,992,000
日特建設	1,100	671.00	738,100
北陸電気工事	900	1,095.00	985,500
ユアテック	2,900	654.00	1,896,600
日本リーテック	1,000	1,566.00	1,566,000
四電工	600	1,771.00	1,062,600
中電工	2,200	2,112.00	4,646,400
関電工	7,900	854.00	6,746,600
きんでん	10,700	1,762.00	18,853,400
東京エネシス	1,700	1,100.00	1,870,000
トーエネック	500	3,345.00	1,672,500
住友電設	1,200	2,066.00	2,479,200
日本電設工業	2,700	1,675.00	4,522,500
エクシオグループ	7,300	2,474.00	18,060,200
新日本空調	1,300	2,329.00	3,027,700
九電工	3,700	3,595.00	13,301,500
三機工業	3,100	1,431.00	4,436,100
日揮ホールディングス	14,800	966.00	14,296,800
中外炉工業	500	1,574.00	787,000
ヤマト	1,500	778.00	1,167,000
太平電業	1,100	2,860.00	3,146,000
高砂熱学工業	4,400	1,936.00	8,518,400
三晃金属工業	200	2,303.00	460,600
朝日工業社	300	3,280.00	984,000
明星工業	3,200	716.00	2,291,200

大気社	2,400	3,140.00	7,536,000
ダイダン	1,100	2,288.00	2,516,800
日比谷総合設備	1,600	2,018.00	3,228,800
フィル・カンパニー	300	2,227.00	668,100
テスホールディングス	900	2,412.00	2,170,800
インフロニア・ホールディングス	20,500	1,025.00	21,012,500
東洋エンジニアリング	2,100	717.00	1,505,700
レイズネクスト	2,400	1,192.00	2,860,800
ニッポン	4,500	1,653.00	7,438,500
日清製粉グループ本社	17,300	1,700.00	29,410,000
日東富士製粉	200	3,590.00	718,000
昭和産業	1,400	2,637.00	3,691,800
鳥越製粉	1,400	708.00	991,200
中部飼料	1,800	941.00	1,693,800
フィード・ワン	2,100	688.00	1,444,800
東洋精糖	300	1,101.00	330,300
日本甜菜製糖	800	1,694.00	1,355,200
D M三井製糖ホールディングス	1,400	1,951.00	2,731,400
塩水港精糖	1,800	211.00	379,800
日新製糖	700	1,707.00	1,194,900
森永製菓	3,600	3,765.00	13,554,000
中村屋	400	3,660.00	1,464,000
江崎グリコ	4,200	3,760.00	15,792,000
名糖産業	700	1,725.00	1,207,500
井村屋グループ	900	2,345.00	2,110,500
不二家	900	2,335.00	2,101,500
山崎製パン	11,500	1,571.00	18,066,500
第一屋製パン	300	565.00	169,500
モロゾフ	200	5,620.00	1,124,000
亀田製菓	900	4,475.00	4,027,500
寿スピリッツ	1,500	5,870.00	8,805,000
カルビー	7,000	2,681.00	18,767,000
森永乳業	2,800	5,520.00	15,456,000
六甲バター	1,100	1,624.00	1,786,400
ヤクルト本社	11,400	6,020.00	68,628,000
明治ホールディングス	10,100	7,010.00	70,801,000
雪印メグミルク	3,700	2,106.00	7,792,200
プリマハム	1,900	2,459.00	4,672,100
日本ハム	5,900	4,025.00	23,747,500
林兼産業	500	517.00	258,500
丸大食品	1,500	1,500.00	2,250,000
S Foods	1,400	3,430.00	4,802,000

柿安本店	500	2,740.00	1,370,000
伊藤ハム米久ホールディングス	9,900	656.00	6,494,400
サッポロホールディングス	5,200	2,251.00	11,705,200
アサヒグループホールディングス	36,100	4,503.00	162,558,300
キリンホールディングス	56,400	1,869.00	105,411,600
宝ホールディングス	10,400	1,239.00	12,885,600
オエノンホールディングス	4,400	371.00	1,632,400
養命酒製造	500	1,780.00	890,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,700	1,339.00	14,327,300
サントリー食品インターナショナル	10,300	4,195.00	43,208,500
ダイドーグループホールディングス	800	4,825.00	3,860,000
伊藤園	4,700	6,050.00	28,435,000
キーコーヒー	1,500	2,018.00	3,027,000
ユニカフェ	500	1,037.00	518,500
ジャパンフーズ	200	1,218.00	243,600
日清オイリオグループ	1,900	2,878.00	5,468,200
不二製油グループ本社	3,300	2,311.00	7,626,300
J - オイルミルズ	1,400	1,660.00	2,324,000
キッコーマン	11,000	8,980.00	98,780,000
味の素	33,900	3,515.00	119,158,500
ブルドックソース	700	2,185.00	1,529,500
キューピー	8,000	2,471.00	19,768,000
ハウス食品グループ本社	5,700	2,952.00	16,826,400
カゴメ	5,800	3,020.00	17,516,000
焼津水産化学工業	800	965.00	772,000
アリアケジャパン	1,400	6,630.00	9,282,000
ピエトロ	200	1,771.00	354,200
エバラ食品工業	400	2,674.00	1,069,600
やまみ	200	1,885.00	377,000
ニチレイ	7,300	2,689.00	19,629,700
東洋水産	7,400	4,910.00	36,334,000
イトアンドホールディングス	600	2,175.00	1,305,000
大冷	200	1,937.00	387,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	631.00	567,900
日清食品ホールディングス	6,000	8,660.00	51,960,000
永谷園ホールディングス	700	1,966.00	1,376,200
一正蒲鉾	600	837.00	502,200
フジッコ	1,700	1,893.00	3,218,100
ロック・フィールド	1,600	1,505.00	2,408,000
日本たばこ産業	82,200	2,373.50	195,101,700
ケンコーマヨネーズ	800	1,343.00	1,074,400
わらべや日洋ホールディングス	1,000	2,025.00	2,025,000

なとり	900	2,002.00	1,801,800
イフジ産業	300	941.00	282,300
ピクルスコーポレーション	700	1,888.00	1,321,600
ファーマフーズ	1,400	2,185.00	3,059,000
ユーグレナ	7,800	720.00	5,616,000
紀文食品	900	989.00	890,100
ミヨシ油脂	600	1,323.00	793,800
理研ビタミン	1,600	1,672.00	2,675,200
片倉工業	1,700	2,180.00	3,706,000
ゲンゼ	1,000	4,095.00	4,095,000
東洋紡	5,900	1,256.00	7,410,400
ユニチカ	4,100	299.00	1,225,900
富士紡ホールディングス	700	4,035.00	2,824,500
倉敷紡績	1,300	1,965.00	2,554,500
シキボウ	800	908.00	726,400
日本毛織	4,500	915.00	4,117,500
ダイトウボウ	2,300	101.00	232,300
トーア紡コーポレーション	500	430.00	215,000
ダイドーリミテッド	1,900	156.00	296,400
帝国繊維	1,700	2,122.00	3,607,400
帝人	14,100	1,384.00	19,514,400
東レ	108,300	692.80	75,030,240
住江織物	300	1,537.00	461,100
日本フェルト	800	444.00	355,200
イチカワ	200	1,357.00	271,400
日東製網	200	1,424.00	284,800
アツギ	1,200	592.00	710,400
ダイニック	600	706.00	423,600
セーレン	3,100	2,465.00	7,641,500
ソトー	500	822.00	411,000
東海染工	200	1,133.00	226,600
小松マテーレ	2,500	1,260.00	3,150,000
ワコールホールディングス	3,700	2,091.00	7,736,700
ホギメディカル	2,000	3,205.00	6,410,000
クラウディアホールディングス	400	234.00	93,600
T S Iホールディングス	5,000	340.00	1,700,000
マツオカコーポレーション	500	1,220.00	610,000
ワールド	1,900	1,163.00	2,209,700
三陽商会	700	901.00	630,700
ナイガイ	500	311.00	155,500
オンワードホールディングス	9,000	295.00	2,655,000
ルックホールディングス	500	1,302.00	651,000



ゴールドウイン	2,700	6,410.00	17,307,000
デサント	2,900	4,155.00	12,049,500
キング	700	572.00	400,400
ヤマトインターナショナル	1,300	295.00	383,500
特種東海製紙	900	4,070.00	3,663,000
王子ホールディングス	62,600	554.00	34,680,400
日本製紙	7,200	1,113.00	8,013,600
三菱製紙	2,200	317.00	697,400
北越コーポレーション	9,900	750.00	7,425,000
中越パルプ工業	600	966.00	579,600
巴川製紙所	400	798.00	319,200
大王製紙	7,200	1,885.00	13,572,000
阿波製紙	400	348.00	139,200
レンゴー	14,200	864.00	12,268,800
トーモク	900	1,770.00	1,593,000
ザ・パック	1,100	2,848.00	3,132,800
北の達人コーポレーション	5,400	356.00	1,922,400
クラレ	21,800	1,005.00	21,909,000
旭化成	99,200	1,098.00	108,921,600
共和レザー	1,000	640.00	640,000
昭和電工	12,900	2,535.00	32,701,500
住友化学	109,900	536.00	58,906,400
住友精化	600	3,095.00	1,857,000
日産化学	8,100	6,460.00	52,326,000
ラサ工業	500	1,691.00	845,500
クレハ	1,200	8,190.00	9,828,000
多木化学	600	6,170.00	3,702,000
テイカ	1,100	1,297.00	1,426,700
石原産業	2,500	1,170.00	2,925,000
片倉コープアグリ	300	1,157.00	347,100
日本曹達	1,900	3,340.00	6,346,000
東ソー	21,600	1,703.00	36,784,800
トクヤマ	4,800	1,852.00	8,889,600
セントラル硝子	2,400	2,041.00	4,898,400
東亜合成	8,500	1,204.00	10,234,000
大阪ソーダ	1,400	2,909.00	4,072,600
関東電化工業	3,200	1,028.00	3,289,600
デンカ	5,400	3,675.00	19,845,000
信越化学工業	25,700	19,725.00	506,932,500
日本カーバイド工業	500	1,300.00	650,000
堺化学工業	1,000	2,295.00	2,295,000
第一稀元素化学工業	1,400	1,289.00	1,804,600

エア・ウォーター	14,100	1,804.00	25,436,400
日本酸素ホールディングス	14,400	2,571.00	37,022,400
日本化学工業	500	2,635.00	1,317,500
東邦アセチレン	300	1,245.00	373,500
日本パーカライジング	7,500	1,138.00	8,535,000
高圧ガス工業	2,400	788.00	1,891,200
四国化成工業	2,000	1,415.00	2,830,000
戸田工業	300	3,575.00	1,072,500
ステラ ケミファ	800	2,564.00	2,051,200
保土谷化学工業	500	5,620.00	2,810,000
日本触媒	2,500	5,290.00	13,225,000
大日精化工業	1,200	2,257.00	2,708,400
カネカ	3,900	3,810.00	14,859,000
三菱瓦斯化学	13,900	1,927.00	26,785,300
三井化学	13,600	3,205.00	43,588,000
J S R	13,900	4,405.00	61,229,500
東京応化工業	2,600	7,120.00	18,512,000
大阪有機化学工業	1,300	3,365.00	4,374,500
三菱ケミカルホールディングス	100,100	825.20	82,602,520
K Hネオケム	2,500	3,015.00	7,537,500
ダイセル	21,500	806.00	17,329,000
住友ベークライト	2,300	5,660.00	13,018,000
積水化学工業	31,300	1,940.00	60,722,000
日本ゼオン	13,400	1,275.00	17,085,000
アイカ工業	4,100	3,565.00	14,616,500
宇部興産	7,000	1,982.00	13,874,000
積水樹脂	2,200	2,095.00	4,609,000
タキロンシーアイ	3,300	549.00	1,811,700
旭有機材	800	1,676.00	1,340,800
ニチバン	900	1,851.00	1,665,900
リケンテクノス	3,700	512.00	1,894,400
大倉工業	800	2,223.00	1,778,400
積水化成成品工業	2,000	488.00	976,000
群栄化学工業	300	3,600.00	1,080,000
タイガースポリマー	800	458.00	366,400
ミライアル	500	1,827.00	913,500
ダイキアクシス	600	856.00	513,600
ダイキョーニシカワ	3,200	557.00	1,782,400
竹本容器	500	810.00	405,000
森六ホールディングス	800	1,866.00	1,492,800
恵和	400	5,260.00	2,104,000
日本化薬	11,700	1,187.00	13,887,900

カーリットホールディングス	1,500	677.00	1,015,500
日本精化	1,200	2,237.00	2,684,400
扶桑化学工業	1,300	4,785.00	6,220,500
トリケミカル研究所	1,500	3,610.00	5,415,000
A D E K A	6,900	2,586.00	17,843,400
日油	5,100	5,860.00	29,886,000
新日本理化	2,500	255.00	637,500
ハリマ化成グループ	1,100	805.00	885,500
花王	33,800	6,022.00	203,543,600
第一工業製薬	600	3,185.00	1,911,000
石原ケミカル	800	1,348.00	1,078,400
日華化学	500	862.00	431,000
ニイタカ	300	2,168.00	650,400
三洋化成工業	900	5,260.00	4,734,000
有機合成薬品工業	1,100	276.00	303,600
大日本塗料	1,800	849.00	1,528,200
日本ペイントホールディングス	56,200	1,301.00	73,116,200
関西ペイント	15,500	2,627.00	40,718,500
神東塗料	1,200	179.00	214,800
中国塗料	3,500	920.00	3,220,000
日本特殊塗料	1,100	837.00	920,700
藤倉化成	1,900	497.00	944,300
太陽ホールディングス	2,200	3,300.00	7,260,000
D I C	6,300	2,940.00	18,522,000
サカタインクス	3,000	1,031.00	3,093,000
東洋インキS Cホールディングス	3,200	1,951.00	6,243,200
T & K T O K A	1,200	809.00	970,800
富士フイルムホールディングス	26,800	8,515.00	228,202,000
資生堂	28,500	6,539.00	186,361,500
ライオン	18,400	1,597.00	29,384,800
高砂香料工業	1,100	2,805.00	3,085,500
マンダム	3,200	1,419.00	4,540,800
ミルボン	1,900	5,690.00	10,811,000
ファンケル	6,200	3,535.00	21,917,000
コーセー	2,900	13,420.00	38,918,000
コタ	1,000	1,567.00	1,567,000
ポーラ・オルビスホールディングス	6,500	2,036.00	13,234,000
ノエビアホールディングス	1,300	5,430.00	7,059,000
アジュバンホールディングス	300	1,157.00	347,100
新日本製薬	400	1,193.00	477,200
エステー	1,000	1,530.00	1,530,000
アグロ カネショウ	500	1,292.00	646,000

コニシ	2,500	1,760.00	4,400,000	
長谷川香料	2,600	2,816.00	7,321,600	
星光PMC	900	701.00	630,900	
小林製薬	4,300	9,090.00	39,087,000	
荒川化学工業	1,300	1,204.00	1,565,200	
メック	1,100	4,090.00	4,499,000	
日本高純度化学	400	2,608.00	1,043,200	
タカラバイオ	4,000	2,659.00	10,636,000	
JCU	1,700	5,170.00	8,789,000	
新田ゼラチン	1,000	603.00	603,000	
OATアグリオ	300	2,066.00	619,800	
デクセリアルズ	3,900	3,920.00	15,288,000	
アース製薬	1,200	6,320.00	7,584,000	
北興化学工業	1,400	895.00	1,253,000	
大成ラミック	500	2,846.00	1,423,000	
クミアイ化学工業	5,600	780.00	4,368,000	
日本農薬	2,700	486.00	1,312,200	
アキレス	1,000	1,265.00	1,265,000	
有沢製作所	2,200	948.00	2,085,600	
日東電工	9,200	8,600.00	79,120,000	
レック	2,000	842.00	1,684,000	
三光合成	1,700	377.00	640,900	
きもと	2,400	213.00	511,200	
藤森工業	1,400	3,845.00	5,383,000	
前澤化成工業	1,000	1,305.00	1,305,000	
未来工業	500	1,607.00	803,500	
ウェーブロックホールディングス	600	763.00	457,800	
JSP	900	1,626.00	1,463,400	
エフピコ	2,800	3,985.00	11,158,000	
天馬	1,300	2,623.00	3,409,900	
信越ポリマー	2,700	1,106.00	2,986,200	
東リ	3,800	227.00	862,600	
ニフコ	5,100	3,350.00	17,085,000	
バルカー	1,200	2,535.00	3,042,000	
ユニ・チャーム	29,500	4,900.00	144,550,000	
ショーエイコーポレーション	400	680.00	272,000	
協和キリン	17,900	3,200.00	57,280,000	
武田薬品工業	120,100	3,092.00	371,349,200	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	132,400	1,803.00	238,717,200	
大日本住友製薬	9,400	1,332.00	12,520,800	
塩野義製薬	19,200	7,677.00	147,398,400	
わかもと製薬	2,000	294.00	588,000	

日本新薬	4,000	8,040.00	32,160,000
中外製薬	47,800	3,744.00	178,963,200
科研製薬	2,400	4,170.00	10,008,000
エーザイ	18,300	6,943.00	127,056,900
ロート製薬	7,800	3,425.00	26,715,000
小野薬品工業	35,100	2,791.00	97,964,100
久光製薬	4,000	4,025.00	16,100,000
持田製薬	1,900	3,465.00	6,583,500
参天製薬	28,500	1,402.00	39,957,000
扶桑薬品工業	500	2,567.00	1,283,500
日本ケミファ	200	1,983.00	396,600
ツムラ	4,700	3,310.00	15,557,000
日医工	4,700	702.00	3,299,400
キッセイ薬品工業	2,700	2,213.00	5,975,100
生化学工業	2,700	963.00	2,600,100
栄研化学	2,700	1,925.00	5,197,500
日水製薬	600	1,087.00	652,200
鳥居薬品	800	2,862.00	2,289,600
JCRファーマ	4,300	2,225.00	9,567,500
東和薬品	2,200	2,771.00	6,096,200
富士製薬工業	900	1,032.00	928,800
ゼリア新薬工業	2,800	1,974.00	5,527,200
第一三共	120,000	2,815.00	337,800,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,100	1,792.00	5,555,200
大幸薬品	2,400	758.00	1,819,200
ダイト	1,000	3,005.00	3,005,000
大塚ホールディングス	31,800	4,182.00	132,987,600
大正製薬ホールディングス	3,600	5,430.00	19,548,000
ペプチドリーム	8,000	2,615.00	20,920,000
あすか製薬ホールディングス	1,800	954.00	1,717,200
サワイグループホールディングス	3,300	4,525.00	14,932,500
日本コークス工業	13,000	125.00	1,625,000
ニチレキ	2,000	1,447.00	2,894,000
ユシロ化学工業	800	1,099.00	879,200
ビーピー・カストロール	500	1,406.00	703,000
富士石油	4,000	255.00	1,020,000
MORESCO	500	1,142.00	571,000
出光興産	17,000	2,954.00	50,218,000
ENEOSホールディングス	230,000	431.20	99,176,000
コスモエネルギーホールディングス	4,400	2,325.00	10,230,000
横浜ゴム	8,800	1,836.00	16,156,800
TOYO TIRE	8,000	1,812.00	14,496,000

ブリヂストン	44,000	4,934.00	217,096,000
住友ゴム工業	13,700	1,209.00	16,563,300
藤倉コンポジット	1,200	819.00	982,800
オカモト	900	4,170.00	3,753,000
フコク	700	987.00	690,900
ニッタ	1,600	2,924.00	4,678,400
住友理工	3,000	604.00	1,812,000
三ツ星ベルト	1,900	2,051.00	3,896,900
バンドー化学	2,400	893.00	2,143,200
日東紡績	2,300	2,963.00	6,814,900
A G C	14,000	5,650.00	79,100,000
日本板硝子	7,400	511.00	3,781,400
石塚硝子	300	1,956.00	586,800
日本山村硝子	600	802.00	481,200
日本電気硝子	6,200	3,015.00	18,693,000
オハラ	600	1,561.00	936,600
住友大阪セメント	2,800	3,620.00	10,136,000
太平洋セメント	8,700	2,369.00	20,610,300
日本ヒューム	1,500	695.00	1,042,500
日本コンクリート工業	3,200	273.00	873,600
三谷セキサン	700	8,260.00	5,782,000
アジアパイルホールディングス	2,300	433.00	995,900
東海カーボン	12,800	1,199.00	15,347,200
日本カーボン	800	4,330.00	3,464,000
東洋炭素	1,000	3,330.00	3,330,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,825.00	3,860,000
T O T O	10,900	5,350.00	58,315,000
日本碍子	16,600	1,903.00	31,589,800
日本特殊陶業	11,600	1,978.00	22,944,800
ダントーホールディングス	1,000	214.00	214,000
M A R U W A	500	15,020.00	7,510,000
品川リフラクトリーズ	400	3,620.00	1,448,000
黒崎播磨	300	4,155.00	1,246,500
ヨータイ	1,000	1,240.00	1,240,000
イソライト工業	800	873.00	698,400
東京窯業	2,100	307.00	644,700
ニッカトー	700	695.00	486,500
フジインコーポレーテッド	1,200	7,640.00	9,168,000
クニミネ工業	500	1,055.00	527,500
エーアンドエーマテリアル	300	902.00	270,600
ニチアス	3,600	2,775.00	9,990,000
ニチハ	2,100	3,040.00	6,384,000

日本製鉄	67,700	1,888.00	127,817,600
神戸製鋼所	28,100	581.00	16,326,100
合同製鐵	800	1,382.00	1,105,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	40,800	1,451.00	59,200,800
東京製鐵	5,100	1,377.00	7,022,700
共英製鋼	1,700	1,337.00	2,272,900
大和工業	2,900	3,720.00	10,788,000
東京鐵鋼	700	1,324.00	926,800
大阪製鐵	800	1,206.00	964,800
淀川製鋼所	2,000	2,505.00	5,010,000
丸一鋼管	5,300	2,567.00	13,605,100
モリ工業	500	2,743.00	1,371,500
大同特殊鋼	2,500	4,155.00	10,387,500
日本高周波鋼業	700	337.00	235,900
日本冶金工業	1,100	2,206.00	2,426,600
山陽特殊製鋼	1,600	2,041.00	3,265,600
愛知製鋼	800	2,522.00	2,017,600
日立金属	16,300	2,124.00	34,621,200
日本金属	400	985.00	394,000
大平洋金属	1,000	2,088.00	2,088,000
新日本電工	9,800	300.00	2,940,000
栗本鐵工所	700	1,571.00	1,099,700
虹技	200	1,007.00	201,400
日本鑄鉄管	200	1,096.00	219,200
三菱製鋼	1,000	1,015.00	1,015,000
日亜鋼業	2,100	275.00	577,500
日本精線	300	4,790.00	1,437,000
エンビプロ・ホールディングス	600	1,832.00	1,099,200
シンニッタン	2,000	223.00	446,000
新家工業	400	1,665.00	666,000
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,434.00	3,298,200
日本軽金属ホールディングス	3,800	1,684.00	6,399,200
三井金属鉱業	4,100	3,045.00	12,484,500
東邦亜鉛	900	2,184.00	1,965,600
三菱マテリアル	10,000	2,030.00	20,300,000
住友金属鉱山	19,300	4,407.00	85,055,100
DOWAホールディングス	4,100	4,600.00	18,860,000
古河機械金属	2,500	1,250.00	3,125,000
エス・サイエンス	8,500	27.00	229,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	793.00	1,427,400
東邦チタニウム	2,700	880.00	2,376,000
UACJ	2,300	2,453.00	5,641,900

C Kサンエツ	300	4,000.00	1,200,000
古河電気工業	4,700	2,276.00	10,697,200
住友電気工業	56,500	1,528.50	86,360,250
フジクラ	16,800	578.00	9,710,400
昭和電線ホールディングス	1,300	1,818.00	2,363,400
タツタ電線	2,700	469.00	1,266,300
カナレ電気	300	1,741.00	522,300
平河ヒューテック	900	1,236.00	1,112,400
リョービ	1,900	1,105.00	2,099,500
アーレスティ	1,800	365.00	657,000
アサヒホールディングス	6,000	1,992.00	11,952,000
稲葉製作所	800	1,348.00	1,078,400
宮地エンジニアリンググループ	500	3,275.00	1,637,500
トーカロ	3,900	1,490.00	5,811,000
アルファC o	600	1,121.00	672,600
SUMCO	23,300	2,263.00	52,727,900
川田テクノロジーズ	300	3,880.00	1,164,000
RS Technologies	500	6,290.00	3,145,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,866.00	373,200
信和	1,000	801.00	801,000
東洋製罐グループホールディングス	9,600	1,416.00	13,593,600
ホッカンホールディングス	800	1,456.00	1,164,800
コロナ	900	905.00	814,500
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,144.00	5,574,400
駒井ハルテック	300	2,080.00	624,000
高田機工	100	2,708.00	270,800
三和ホールディングス	14,200	1,233.00	17,508,600
文化シャッター	4,800	1,043.00	5,006,400
三協立山	1,900	723.00	1,373,700
アルインコ	1,100	965.00	1,061,500
東洋シャッター	400	611.00	244,400
LIXIL	23,800	3,145.00	74,851,000
日本フィルコン	1,100	541.00	595,100
ノーリツ	2,900	1,744.00	5,057,600
長府製作所	1,600	2,074.00	3,318,400
リンナイ	2,800	10,670.00	29,876,000
ダイニチ工業	700	780.00	546,000
日東精工	1,900	616.00	1,170,400
三洋工業	200	1,840.00	368,000
岡部	3,100	734.00	2,275,400
ジーテクト	1,900	1,423.00	2,703,700
東プレ	2,800	1,154.00	3,231,200



高周波熱錬	2,700	580.00	1,566,000
東京製鋼	900	918.00	826,200
サンコール	1,300	457.00	594,100
モリテック スチール	1,100	378.00	415,800
パイオラックス	2,200	1,784.00	3,924,800
エイチワン	1,400	662.00	926,800
日本発條	13,900	1,017.00	14,136,300
中央発條	800	869.00	695,200
アドバネクス	200	1,250.00	250,000
立川ブラインド工業	700	1,194.00	835,800
三益半導体工業	1,200	2,425.00	2,910,000
日本ドライケミカル	400	1,908.00	763,200
日本製鋼所	4,600	3,715.00	17,089,000
三浦工業	6,500	4,015.00	26,097,500
タクマ	5,100	1,423.00	7,257,300
ツガミ	3,600	1,666.00	5,997,600
オークマ	1,800	5,140.00	9,252,000
芝浦機械	1,700	3,820.00	6,494,000
アマダ	23,800	1,145.00	27,251,000
アイダエンジニアリング	3,900	984.00	3,837,600
滝澤鉄工所	400	1,228.00	491,200
F U J I	6,900	2,667.00	18,402,300
牧野フライス製作所	1,600	3,970.00	6,352,000
オーエスジー	7,000	1,805.00	12,635,000
ダイジェット工業	200	982.00	196,400
旭ダイヤモンド工業	4,000	641.00	2,564,000
D M G 森精機	8,900	1,995.00	17,755,500
ソディック	3,400	824.00	2,801,600
ディスコ	2,200	32,700.00	71,940,000
日東工器	800	1,786.00	1,428,800
日進工具	1,200	1,560.00	1,872,000
パンチ工業	1,400	509.00	712,600
富士ダイス	800	656.00	524,800
豊和工業	900	794.00	714,600
O K K	700	845.00	591,500
東洋機械金属	1,000	505.00	505,000
津田駒工業	300	668.00	200,400
島精機製作所	2,200	2,093.00	4,604,600
オプトラン	1,900	2,419.00	4,596,100
N C ホールディングス	500	1,550.00	775,000
イワキポンプ	1,000	1,027.00	1,027,000
フリーー	1,300	1,255.00	1,631,500

ヤマシンフィルタ	3,100	507.00	1,571,700
日阪製作所	1,800	839.00	1,510,200
やまびこ	2,900	1,314.00	3,810,600
野村マイクロ・サイエンス	400	4,925.00	1,970,000
平田機工	700	6,030.00	4,221,000
ペガサスミシン製造	1,600	498.00	796,800
マルマエ	600	2,773.00	1,663,800
タツモ	700	1,520.00	1,064,000
ナブテスコ	8,600	3,230.00	27,778,000
三井海洋開発	1,600	1,418.00	2,268,800
レオン自動機	1,600	1,378.00	2,204,800
S M C	4,500	76,470.00	344,115,000
ホソカワミクロン	1,100	3,185.00	3,503,500
ユニオンツール	500	3,960.00	1,980,000
オイレス工業	2,100	1,778.00	3,733,800
日精エー・エス・ビー機械	500	3,140.00	1,570,000
サトーホールディングス	2,000	2,208.00	4,416,000
技研製作所	1,300	4,235.00	5,505,500
日本エアージェット	700	1,275.00	892,500
カワタ	500	904.00	452,000
日精樹脂工業	1,100	1,020.00	1,122,000
オカダアイヨン	500	1,492.00	746,000
ワイエイシイホールディングス	600	881.00	528,600
小松製作所	69,300	2,620.50	181,600,650
住友重機械工業	8,700	2,627.00	22,854,900
日立建機	6,100	3,250.00	19,825,000
日工	2,100	621.00	1,304,100
巴工業	600	2,321.00	1,392,600
井関農機	1,400	1,429.00	2,000,600
T O W A	1,300	3,235.00	4,205,500
丸山製作所	300	1,579.00	473,700
北川鉄工所	700	1,509.00	1,056,300
ローツェ	700	11,790.00	8,253,000
タカキタ	600	665.00	399,000
クボタ	74,500	2,536.50	188,969,250
荏原実業	700	2,500.00	1,750,000
三菱化工機	500	2,241.00	1,120,500
月島機械	2,800	1,170.00	3,276,000
帝国電機製作所	1,000	1,498.00	1,498,000
新東工業	3,300	710.00	2,343,000
澁谷工業	1,300	2,999.00	3,898,700
アイチ コーポレーション	2,300	815.00	1,874,500

小森コーポレーション	3,900	724.00	2,823,600
鶴見製作所	1,200	1,592.00	1,910,400
住友精密工業	200	2,092.00	418,400
酒井重工業	300	2,810.00	843,000
荏原製作所	6,300	6,390.00	40,257,000
石井鐵工所	200	2,983.00	596,600
西島製作所	1,400	921.00	1,289,400
北越工業	1,400	997.00	1,395,800
ダイキン工業	19,500	26,350.00	513,825,000
オルガノ	400	7,500.00	3,000,000
トーヨーカネツ	600	2,560.00	1,536,000
栗田工業	8,300	5,280.00	43,824,000
椿本チエイン	2,000	3,030.00	6,060,000
大同工業	700	956.00	669,200
木村化工機	1,300	881.00	1,145,300
アネスト岩田	2,300	916.00	2,106,800
ダイフク	8,400	9,740.00	81,816,000
サムコ	400	2,779.00	1,111,600
加藤製作所	700	818.00	572,600
油研工業	300	1,723.00	516,900
タダノ	8,000	1,074.00	8,592,000
フジテック	5,600	2,537.00	14,207,200
C K D	4,500	2,353.00	10,588,500
キトー	1,300	1,911.00	2,484,300
平和	4,200	1,906.00	8,005,200
理想科学工業	1,300	2,033.00	2,642,900
S A N K Y O	3,300	3,070.00	10,131,000
日本金銭機械	1,600	683.00	1,092,800
マースグループホールディングス	1,000	1,670.00	1,670,000
フクシマガリレイ	1,000	4,720.00	4,720,000
オーイズミ	700	380.00	266,000
ダイコク電機	700	1,202.00	841,400
竹内製作所	2,300	2,687.00	6,180,100
アマノ	4,000	2,656.00	10,624,000
J U K I	2,200	892.00	1,962,400
サンデンホールディングス	2,100	237.00	497,700
ジャノメ	1,300	654.00	850,200
マックス	2,000	1,868.00	3,736,000
グローリー	3,900	2,203.00	8,591,700
新晃工業	1,400	1,928.00	2,699,200
大和冷機工業	2,200	1,233.00	2,712,600
セガサミーホールディングス	15,100	1,882.00	28,418,200

日本ピストンリング	600	1,253.00	751,800
リケン	700	2,526.00	1,768,200
T P R	2,100	1,410.00	2,961,000
ツバキ・ナカシマ	3,300	1,469.00	4,847,700
ホシザキ	4,500	8,720.00	39,240,000
大豊工業	1,300	793.00	1,030,900
日本精工	28,700	771.00	22,127,700
N T N	32,800	232.00	7,609,600
ジェイテクト	14,600	1,053.00	15,373,800
不二越	1,300	4,060.00	5,278,000
日本トムソン	4,200	661.00	2,776,200
T H K	8,900	2,761.00	24,572,900
ユーシン精機	1,200	748.00	897,600
前澤給装工業	1,200	1,034.00	1,240,800
イーグル工業	1,900	1,082.00	2,055,800
前澤工業	900	603.00	542,700
日本ピラー工業	1,500	3,295.00	4,942,500
キッツ	5,100	722.00	3,682,200
マキタ	18,600	5,070.00	94,302,000
三井E & Sホールディングス	5,400	376.00	2,030,400
日立造船	12,900	792.00	10,216,800
三菱重工業	24,000	2,626.50	63,036,000
I H I	9,500	2,245.00	21,327,500
サノヤスホールディングス	1,800	122.00	219,600
スター精密	2,300	1,594.00	3,666,200
日清紡ホールディングス	9,400	877.00	8,243,800
イビデン	8,000	6,790.00	54,320,000
コニカミノルタ	33,400	487.00	16,265,800
ブラザー工業	18,700	2,103.00	39,326,100
ミネベアミツミ	26,300	3,200.00	84,160,000
日立製作所	73,500	6,242.00	458,787,000
東芝	26,700	4,645.00	124,021,500
三菱電機	152,800	1,488.50	227,442,800
富士電機	9,200	6,050.00	55,660,000
東洋電機製造	600	1,065.00	639,000
安川電機	16,500	5,790.00	95,535,000
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,304.00	2,347,200
明電舎	2,600	2,680.00	6,968,000
オリジン	400	1,270.00	508,000
山洋電気	700	5,830.00	4,081,000
デンヨー	1,300	1,750.00	2,275,000
P H C ホールディングス	1,700	2,067.00	3,513,900

東芝テック	1,600	4,515.00	7,224,000
芝浦メカトロニクス	300	8,420.00	2,526,000
マブチモーター	3,600	3,795.00	13,662,000
日本電産	39,600	13,570.00	537,372,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	450.00	360,000
トレックス・セミコンダクター	800	3,235.00	2,588,000
東光高岳	900	1,390.00	1,251,000
ダブル・スコープ	4,400	784.00	3,449,600
ダイヘン	1,700	4,555.00	7,743,500
ヤーマン	2,500	945.00	2,362,500
JVCケンウッド	12,400	167.00	2,070,800
ミマキエンジニアリング	1,400	900.00	1,260,000
I - P E X	700	2,004.00	1,402,800
日新電機	3,600	1,555.00	5,598,000
大崎電気工業	2,800	451.00	1,262,800
オムロン	12,700	11,740.00	149,098,000
日東工業	2,100	1,609.00	3,378,900
I D E C	1,900	2,711.00	5,150,900
正興電機製作所	500	1,180.00	590,000
不二電機工業	300	1,169.00	350,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,100	2,464.00	12,566,400
サクサホールディングス	400	1,342.00	536,800
メルコホールディングス	400	4,240.00	1,696,000
テクノメディカ	300	1,715.00	514,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,263.00	631,500
日本電気	19,400	5,220.00	101,268,000
富士通	13,700	19,890.00	272,493,000
沖電気工業	6,200	887.00	5,499,400
岩崎通信機	600	846.00	507,600
電気興業	800	2,602.00	2,081,600
サンケン電気	1,400	6,000.00	8,400,000
ナカヨ	300	1,232.00	369,600
アイホン	900	2,093.00	1,883,700
ルネサスエレクトロニクス	82,900	1,423.00	117,966,700
セイコーエプソン	19,000	1,957.00	37,183,000
ワコム	11,900	938.00	11,162,200
アルバック	2,800	6,490.00	18,172,000
アクセル	600	1,007.00	604,200
E I Z O	1,200	4,105.00	4,926,000
日本信号	3,900	924.00	3,603,600
京三製作所	3,300	468.00	1,544,400
能美防災	2,000	2,208.00	4,416,000

ホーチキ	1,100	1,305.00	1,435,500	
星和電機	700	512.00	358,400	
エレコム	3,500	1,498.00	5,243,000	
パナソニック	163,000	1,221.00	199,023,000	
シャープ	17,400	1,270.00	22,098,000	
アンリツ	9,800	1,780.00	17,444,000	
富士通ゼネラル	4,200	2,790.00	11,718,000	
ソニーグループ	95,700	14,000.00	1,339,800,000	代用有価証券 35,000株
T D K	22,200	4,550.00	101,010,000	
帝国通信工業	700	1,305.00	913,500	
タムラ製作所	5,900	663.00	3,911,700	
アルプスアルパイン	13,500	1,056.00	14,256,000	
池上通信機	500	704.00	352,000	
日本電波工業	1,400	1,719.00	2,406,600	
鈴木	700	880.00	616,000	
メイコー	1,200	4,245.00	5,094,000	
日本トリム	300	3,480.00	1,044,000	
ローランド ディー . ジー .	900	3,010.00	2,709,000	
フォスター電機	1,600	728.00	1,164,800	
S M K	400	2,276.00	910,400	
ヨコオ	1,100	2,849.00	3,133,900	
ホシデン	3,700	1,207.00	4,465,900	
ヒロセ電機	2,400	19,830.00	47,592,000	
日本航空電子工業	3,500	2,001.00	7,003,500	
T O A	1,700	799.00	1,358,300	
マクセル	3,100	1,444.00	4,476,400	
古野電気	1,800	1,173.00	2,111,400	
ユニデンホールディングス	300	3,415.00	1,024,500	
スミダコーポレーション	1,500	1,226.00	1,839,000	
アイコム	600	2,429.00	1,457,400	
リオン	600	2,334.00	1,400,400	
本多通信工業	1,200	434.00	520,800	
横河電機	15,300	2,075.00	31,747,500	
新電元工業	600	3,640.00	2,184,000	
アズビル	9,000	5,190.00	46,710,000	
東亜ディーケーケー	800	858.00	686,400	
日本光電工業	6,300	3,295.00	20,758,500	
チノー	500	1,666.00	833,000	
共和電業	1,500	398.00	597,000	
日本電子材料	800	2,313.00	1,850,400	
堀場製作所	2,800	6,750.00	18,900,000	
アドバンテスト	11,400	10,050.00	114,570,000	

小野測器	700	496.00	347,200
エスベック	1,300	2,102.00	2,732,600
キーエンス	13,800	72,240.00	996,912,000
日置電機	700	8,640.00	6,048,000
シスメックス	12,900	14,750.00	190,275,000
日本マイクロニクス	2,700	1,763.00	4,760,100
メガチップス	1,400	4,900.00	6,860,000
O B A R A G R O U P	700	3,480.00	2,436,000
澤藤電機	200	1,728.00	345,600
原田工業	800	998.00	798,400
コーセル	1,900	900.00	1,710,000
イリソ電子工業	1,300	4,435.00	5,765,500
オブテックスグループ	2,500	1,627.00	4,067,500
千代田インテグレ	700	2,082.00	1,457,400
アイ・オー・データ機器	600	763.00	457,800
レーザーテック	6,700	30,360.00	203,412,000
スタンレー電気	10,700	3,030.00	32,421,000
岩崎電気	600	2,366.00	1,419,600
ウシオ電機	7,800	1,987.00	15,498,600
岡谷電機産業	1,100	319.00	350,900
ハリオス テクノ ホールディング	1,400	275.00	385,000
エノモト	400	1,737.00	694,800
日本セラミック	1,400	2,847.00	3,985,800
遠藤照明	700	1,063.00	744,100
古河電池	1,100	1,451.00	1,596,100
双信電機	700	676.00	473,200
山一電機	1,100	2,221.00	2,443,100
図研	1,000	3,725.00	3,725,000
日本電子	3,200	8,940.00	28,608,000
カシオ計算機	11,100	1,478.00	16,405,800
ファナック	13,400	24,160.00	323,744,000
日本シイエムケイ	3,000	631.00	1,893,000
エンプラス	400	2,581.00	1,032,400
大真空	2,100	1,433.00	3,009,300
ローム	6,800	10,560.00	71,808,000
浜松ホトニクス	11,000	7,280.00	80,080,000
三井ハイテック	1,500	11,220.00	16,830,000
新光電気工業	4,500	5,420.00	24,390,000
京セラ	21,500	7,233.00	155,509,500
太陽誘電	7,400	6,500.00	48,100,000
村田製作所	44,900	9,185.00	412,406,500
双葉電子工業	2,700	700.00	1,890,000

北陸電気工業	600	1,388.00	832,800	
ニチコン	4,800	1,260.00	6,048,000	
日本ケミコン	1,500	1,916.00	2,874,000	
K O A	2,300	1,594.00	3,666,200	
市光工業	1,800	519.00	934,200	
小糸製作所	8,400	6,430.00	54,012,000	
ミツバ	2,800	449.00	1,257,200	
S C R E E Nホールディングス	2,700	11,690.00	31,563,000	
キャノン電子	1,400	1,607.00	2,249,800	
キャノン	75,900	2,669.00	202,577,100	代用有価証券 10,000株
リコー	42,400	1,028.00	43,587,200	
象印マホービン	4,200	1,612.00	6,770,400	
M U T O Hホールディングス	200	1,675.00	335,000	
東京エレクトロン	9,700	61,370.00	595,289,000	
トヨタ紡織	6,200	2,224.00	13,788,800	
芦森工業	300	921.00	276,300	
ユニプレス	2,400	753.00	1,807,200	
豊田自動織機	12,300	9,390.00	115,497,000	
モリタホールディングス	2,500	1,320.00	3,300,000	
三櫻工業	2,100	962.00	2,020,200	
デンソー	33,600	9,017.00	302,971,200	
東海理化電機製作所	4,100	1,555.00	6,375,500	
川崎重工業	11,100	2,054.00	22,799,400	
名村造船所	4,700	213.00	1,001,100	
日本車輛製造	600	2,080.00	1,248,000	
三菱ロジスネクスト	2,000	1,200.00	2,400,000	
近畿車輛	300	1,002.00	300,600	
日産自動車	179,900	537.60	96,714,240	
いすゞ自動車	47,800	1,495.00	71,461,000	
トヨタ自動車	773,600	2,118.50	1,638,871,600	
日野自動車	19,000	955.00	18,145,000	
三菱自動車工業	56,400	322.00	18,160,800	
エフテック	1,200	518.00	621,600	
レシップホールディングス	700	578.00	404,600	
G M B	300	732.00	219,600	
ファルテック	300	714.00	214,200	
武蔵精密工業	3,400	1,803.00	6,130,200	
日産車体	2,300	725.00	1,667,500	
新明和工業	4,300	871.00	3,745,300	
極東開発工業	2,800	1,550.00	4,340,000	
トピー工業	1,300	1,088.00	1,414,400	
ティラド	500	2,782.00	1,391,000	



タチエス	2,700	1,169.00	3,156,300
NOK	7,400	1,234.00	9,131,600
フタバ産業	3,900	414.00	1,614,600
KYB	1,600	2,954.00	4,726,400
大同メタル工業	3,100	594.00	1,841,400
プレス工業	7,800	388.00	3,026,400
ミクニ	2,200	301.00	662,200
太平洋工業	3,200	1,133.00	3,625,600
河西工業	2,200	286.00	629,200
アイシン	11,200	4,440.00	49,728,000
マツダ	47,800	903.00	43,163,400
今仙電機製作所	1,100	584.00	642,400
本田技研工業	120,200	3,198.00	384,399,600
スズキ	34,900	4,529.00	158,062,100
SUBARU	43,700	2,040.00	89,148,000
安永	800	970.00	776,000
ヤマハ発動機	19,900	2,917.00	58,048,300
TBK	1,900	413.00	784,700
エクセディ	2,300	1,714.00	3,942,200
豊田合成	4,900	2,418.00	11,848,200
愛三工業	2,500	784.00	1,960,000
盟和産業	300	981.00	294,300
日本プラスト	1,400	514.00	719,600
ヨロズ	1,500	1,126.00	1,689,000
エフ・シー・シー	2,500	1,487.00	3,717,500
シマノ	6,200	32,490.00	201,438,000
テイ・エス テック	6,500	1,390.00	9,035,000
ジャムコ	1,000	894.00	894,000
テルモ	43,200	4,648.00	200,793,600
クリエートメディック	500	998.00	499,000
日機装	4,500	878.00	3,951,000
日本エム・ディ・エム	900	1,919.00	1,727,100
島津製作所	19,700	4,925.00	97,022,500
JMS	1,300	610.00	793,000
長野計器	1,100	1,575.00	1,732,500
ブイ・テクノロジー	700	3,400.00	2,380,000
東京計器	1,000	991.00	991,000
愛知時計電機	200	4,885.00	977,000
インターアクション	800	2,380.00	1,904,000
オーバル	1,300	254.00	330,200
東京精密	2,600	4,935.00	12,831,000
マニー	6,100	1,606.00	9,796,600

ニコン	23,300	1,201.00	27,983,300
トプコン	7,200	1,649.00	11,872,800
オリンパス	80,100	2,454.50	196,605,450
理研計器	1,200	5,390.00	6,468,000
タムロン	1,200	2,794.00	3,352,800
H O Y A	29,800	17,605.00	524,629,000
シード	700	557.00	389,900
ノーリツ鋼機	1,400	2,522.00	3,530,800
エー・アンド・デイ	1,400	1,187.00	1,661,800
朝日インテック	16,700	2,459.00	41,065,300
シチズン時計	17,800	510.00	9,078,000
リズム	500	1,238.00	619,000
大研医器	1,300	554.00	720,200
メニコン	5,100	3,650.00	18,615,000
シンシア	200	593.00	118,600
松風	600	2,014.00	1,208,400
セイコーホールディングス	2,100	2,207.00	4,634,700
ニプロ	11,300	1,103.00	12,463,900
中本パックス	500	1,664.00	832,000
スノーピーク	2,000	3,900.00	7,800,000
パラマウントベッドホールディングス	2,900	1,908.00	5,533,200
トランザクション	900	1,015.00	913,500
粧美堂	600	404.00	242,400
ニホンフラッシュ	1,300	1,068.00	1,388,400
前田工織	1,700	3,890.00	6,613,000
永大産業	2,100	289.00	606,900
アートネイチャー	1,300	723.00	939,900
バンダイナムコホールディングス	13,700	9,242.00	126,615,400
アイフィスジャパン	500	674.00	337,000
共立印刷	2,800	147.00	411,600
S H O E I	1,400	4,910.00	6,874,000
フランスベッドホールディングス	2,000	913.00	1,826,000
パイロットコーポレーション	2,600	4,245.00	11,037,000
萩原工業	1,000	1,304.00	1,304,000
トッパン・フォームズ	2,200	1,549.00	3,407,800
フジシールインターナショナル	3,700	2,116.00	7,829,200
タカラトミー	6,400	1,107.00	7,084,800
広済堂ホールディングス	1,000	767.00	767,000
エステールホールディングス	400	639.00	255,600
タカノ	600	665.00	399,000
プロネクサス	1,200	1,092.00	1,310,400
ホクシン	1,300	155.00	201,500

ウッドワン	500	1,047.00	523,500
大建工業	900	2,183.00	1,964,700
凸版印刷	23,200	1,990.00	46,168,000
大日本印刷	18,000	2,826.00	50,868,000
共同印刷	500	3,115.00	1,557,500
N I S S H A	3,100	1,631.00	5,056,100
光村印刷	200	1,451.00	290,200
TAKARA & COMPANY	800	1,803.00	1,442,400
アシックス	13,500	2,680.00	36,180,000
ツツミ	400	2,111.00	844,400
ローランド	1,100	3,970.00	4,367,000
小松ウオール工業	500	1,935.00	967,500
ヤマハ	9,100	5,790.00	52,689,000
河合楽器製作所	400	3,310.00	1,324,000
クリナップ	1,500	538.00	807,000
ピジョン	9,200	2,326.00	21,399,200
兼松サステック	100	1,798.00	179,800
キングジム	1,300	885.00	1,150,500
リンテック	3,300	2,737.00	9,032,100
イトーキ	2,900	365.00	1,058,500
任天堂	8,600	53,400.00	459,240,000
三菱鉛筆	2,500	1,248.00	3,120,000
タカラスタANDARD	3,100	1,473.00	4,566,300
コクヨ	7,300	1,754.00	12,804,200
ナカバヤシ	1,400	507.00	709,800
グローブライド	1,400	3,370.00	4,718,000
オカムラ	5,200	1,337.00	6,952,400
美津濃	1,500	2,254.00	3,381,000
東京電力ホールディングス	114,400	305.00	34,892,000
中部電力	46,700	1,201.00	56,086,700
関西電力	57,900	1,064.00	61,605,600
中国電力	23,800	938.00	22,324,400
北陸電力	13,900	590.00	8,201,000
東北電力	35,700	819.00	29,238,300
四国電力	13,700	816.00	11,179,200
九州電力	31,400	868.00	27,255,200
北海道電力	13,300	518.00	6,889,400
沖縄電力	3,200	1,449.00	4,636,800
電源開発	13,000	1,522.00	19,786,000
エフオン	1,000	615.00	615,000
イーレックス	2,200	2,365.00	5,203,000
レノバ	3,000	4,690.00	14,070,000

東京瓦斯	29,300	2,058.00	60,299,400
大阪瓦斯	27,700	1,897.00	52,546,900
東邦瓦斯	7,000	3,115.00	21,805,000
北海道瓦斯	800	1,511.00	1,208,800
広島ガス	2,900	365.00	1,058,500
西部ガスホールディングス	1,700	2,368.00	4,025,600
静岡ガス	3,900	1,008.00	3,931,200
メタウォーター	1,700	2,010.00	3,417,000
SBSホールディングス	1,100	3,325.00	3,657,500
東武鉄道	14,900	2,632.00	39,216,800
相鉄ホールディングス	4,900	2,043.00	10,010,700
東急	38,500	1,556.00	59,906,000
京浜急行電鉄	19,600	1,142.00	22,383,200
小田急電鉄	22,700	2,181.00	49,508,700
京王電鉄	7,900	5,070.00	40,053,000
京成電鉄	10,600	3,105.00	32,913,000
富士急行	1,800	4,295.00	7,731,000
東日本旅客鉄道	26,900	7,190.00	193,411,000
西日本旅客鉄道	18,500	4,973.00	92,000,500
東海旅客鉄道	12,700	15,915.00	202,120,500
西武ホールディングス	19,900	1,090.00	21,691,000
鴻池運輸	2,500	1,178.00	2,945,000
西日本鉄道	4,200	2,621.00	11,008,200
ハマキョウレックス	1,100	2,919.00	3,210,900
サカイ引越センター	700	4,345.00	3,041,500
近鉄グループホールディングス	14,500	3,235.00	46,907,500
阪急阪神ホールディングス	18,100	3,345.00	60,544,500
南海電気鉄道	6,500	2,135.00	13,877,500
京阪ホールディングス	6,400	2,572.00	16,460,800
神戸電鉄	400	3,195.00	1,278,000
名古屋鉄道	11,900	1,716.00	20,420,400
山陽電気鉄道	1,100	2,029.00	2,231,900
アルプス物流	1,000	1,050.00	1,050,000
日本通運	5,000	6,810.00	34,050,000
ヤマトホールディングス	20,300	2,683.00	54,464,900
山九	4,000	4,745.00	18,980,000
丸運	1,000	258.00	258,000
丸全昭和運輸	1,200	3,270.00	3,924,000
センコーグループホールディングス	7,300	930.00	6,789,000
トナミホールディングス	400	3,835.00	1,534,000
ニッコンホールディングス	4,900	2,149.00	10,530,100
日本石油輸送	200	2,643.00	528,600

福山通運	2,400	4,020.00	9,648,000
セイノーホールディングス	9,900	1,201.00	11,889,900
エスライン	500	912.00	456,000
神奈川中央交通	400	3,335.00	1,334,000
日立物流	2,800	5,290.00	14,812,000
丸和運輸機関	3,100	1,368.00	4,240,800
C & F ロジホールディングス	1,500	1,637.00	2,455,500
九州旅客鉄道	11,200	2,400.00	26,880,000
S Gホールディングス	27,300	2,659.00	72,590,700
日本郵船	12,100	8,040.00	97,284,000
商船三井	8,100	7,760.00	62,856,000
川崎汽船	4,500	6,630.00	29,835,000
N S ユナイテッド海運	900	3,380.00	3,042,000
飯野海運	7,200	528.00	3,801,600
乾汽船	1,200	2,219.00	2,662,800
日本航空	33,100	2,129.00	70,469,900
A N Aホールディングス	36,700	2,329.00	85,474,300
パスコ	300	1,316.00	394,800
トランコム	400	9,170.00	3,668,000
日新	1,200	1,637.00	1,964,400
三菱倉庫	4,600	2,879.00	13,243,400
三井倉庫ホールディングス	1,500	2,413.00	3,619,500
住友倉庫	5,100	1,920.00	9,792,000
澁澤倉庫	900	2,322.00	2,089,800
東陽倉庫	2,400	323.00	775,200
日本トランスシティ	3,300	646.00	2,131,800
ケイヒン	200	1,320.00	264,000
中央倉庫	900	972.00	874,800
川西倉庫	300	1,115.00	334,500
安田倉庫	1,200	979.00	1,174,800
ファイズホールディングス	300	545.00	163,500
東洋埠頭	500	1,485.00	742,500
宇徳	1,000	724.00	724,000
上組	8,000	2,189.00	17,512,000
サンリツ	400	851.00	340,400
キムラユニティー	400	1,332.00	532,800
キューソー流通システム	800	912.00	729,600
近鉄エクスプレス	2,700	3,090.00	8,343,000
東海運	900	308.00	277,200
エーアイティー	900	1,336.00	1,202,400
内外トランスライン	500	2,117.00	1,058,500
日本コンセプト	500	1,798.00	899,000

NEC ネットエイアイ	4,900	1,804.00	8,839,600
クロスキャット	400	1,630.00	652,000
システナ	21,400	454.00	9,715,600
デジタルアーツ	800	8,900.00	7,120,000
日鉄ソリューションズ	2,200	3,605.00	7,931,000
キューブシステム	800	969.00	775,200
WOW WORLD	200	1,472.00	294,400
コア	600	1,609.00	965,400
ラクーンホールディングス	1,100	1,336.00	1,469,600
ソリトンシステムズ	700	1,320.00	924,000
ソフトクリエイティブホールディングス	700	4,175.00	2,922,500
T I S	14,300	3,455.00	49,406,500
J N Sホールディングス	700	487.00	340,900
グリー	9,200	766.00	7,047,200
G M Oペパボ	200	2,493.00	498,600
コーエーテクモホールディングス	4,800	4,760.00	22,848,000
三菱総合研究所	600	3,860.00	2,316,000
ボルテージ	400	360.00	144,000
電算	200	2,385.00	477,000
A G S	800	866.00	692,800
ファインデックス	1,300	1,012.00	1,315,600
ブレインパッド	400	4,820.00	1,928,000
K L a b	2,800	510.00	1,428,000
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,100	972.00	2,041,200
イーブックイニシアティブジャパン	100	4,720.00	472,000
ネクソン	33,800	2,253.00	76,151,400
アイスタイル	4,600	269.00	1,237,400
エムアップホールディングス	400	4,145.00	1,658,000
エイチーム	1,000	909.00	909,000
エニグモ	1,600	784.00	1,254,400
テクノスジャパン	1,200	491.00	589,200
e n i s h	900	368.00	331,200
コロプラ	4,900	671.00	3,287,900
ブロードリーフ	7,300	485.00	3,540,500
クロス・マーケティンググループ	600	970.00	582,000
デジタルハーツホールディングス	700	2,497.00	1,747,900
システム情報	1,100	839.00	922,900
メディアドゥ	500	4,470.00	2,235,000
じげん	4,300	304.00	1,307,200
ブイキューブ	1,500	1,077.00	1,615,500
エンカレッジ・テクノロジー	400	612.00	244,800
サイバーリンクス	500	1,078.00	539,000

フィックスターズ	1,600	899.00	1,438,400
CARTA HOLDINGS	600	2,050.00	1,230,000
オブティム	1,100	1,335.00	1,468,500
セレス	500	2,506.00	1,253,000
SHIFT	800	23,750.00	19,000,000
ティーガイア	1,300	1,604.00	2,085,200
セック	200	2,333.00	466,600
テクマトリックス	2,500	1,977.00	4,942,500
プロシップ	500	1,533.00	766,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,790.00	11,439,000
GMOペイメントゲートウェイ	2,900	14,570.00	42,253,000
ザッパラス	600	575.00	345,000
システムリサーチ	400	1,984.00	793,600
インターネットイニシアティブ	4,000	4,660.00	18,640,000
さくらインターネット	1,600	569.00	910,400
ヴィンクス	400	820.00	328,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	4,235.00	1,270,500
SRAホールディングス	700	2,868.00	2,007,600
システムインテグレータ	500	559.00	279,500
朝日ネット	1,400	610.00	854,000
eBASE	1,800	628.00	1,130,400
アバント	1,600	1,220.00	1,952,000
アドソル日進	500	1,746.00	873,000
ODKソリューションズ	300	688.00	206,400
フリービット	900	966.00	869,400
コムチュア	1,700	3,420.00	5,814,000
サイバーコム	200	1,149.00	229,800
アステリア	1,100	802.00	882,200
アイル	800	1,487.00	1,189,600
マークライنز	700	2,716.00	1,901,200
メディカル・データ・ビジョン	1,900	1,190.00	2,261,000
gumi	2,100	691.00	1,451,100
ショーケース	400	511.00	204,400
モバイルファクトリー	400	879.00	351,600
テラスカイ	500	1,925.00	962,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,305.00	913,500
PCIホールディングス	700	1,154.00	807,800
パイプドHD	300	2,590.00	777,000
アイビーシー	300	730.00	219,000
ネオジャパン	400	1,343.00	537,200
PR TIMES	300	3,045.00	913,500
ラクス	5,200	3,135.00	16,302,000

ランドコンピュータ	400	849.00	339,600
ダブルスタンダード	400	3,025.00	1,210,000
オープンドア	900	1,955.00	1,759,500
マイネット	600	567.00	340,200
アカツキ	700	2,599.00	1,819,300
ベネフィットジャパン	100	2,646.00	264,600
U b i c o mホールディングス	400	2,515.00	1,006,000
カナミックネットワーク	1,600	485.00	776,000
ノムラシステムコーポレーション	800	260.00	208,000
チェンジ	2,800	1,995.00	5,586,000
シンクロ・フード	800	345.00	276,000
オークネット	800	1,603.00	1,282,400
キャピタル・アセット・プランニング	300	791.00	237,300
エイトレッド	200	2,264.00	452,800
マクロミル	3,100	1,018.00	3,155,800
ビーグリー	400	1,803.00	721,200
オロ	500	3,040.00	1,520,000
ユーザーローカル	500	1,592.00	796,000
テモナ	300	496.00	148,800
マネーフォワード	2,300	6,840.00	15,732,000
サインポスト	500	1,230.00	615,000
電算システムホールディングス	600	2,599.00	1,559,400
ソルクシーズ	1,300	468.00	608,400
フェイス	400	692.00	276,800
プロトコーポレーション	1,600	1,330.00	2,128,000
ハイマックス	400	1,075.00	430,000
野村総合研究所	29,000	5,040.00	146,160,000
サイバネットシステム	1,100	725.00	797,500
C Eホールディングス	800	492.00	393,600
日本システム技術	300	2,551.00	765,300
インタージホールディングス	1,800	1,671.00	3,007,800
東邦システムサイエンス	400	1,018.00	407,200
ソースネクスト	6,400	195.00	1,248,000
インフォコム	1,600	1,985.00	3,176,000
シンプレクス・ホールディングス	1,600	2,540.00	4,064,000
HEROZ	400	1,371.00	548,400
ラクスル	1,600	5,140.00	8,224,000
I P S	400	2,018.00	807,200
F I G	1,700	329.00	559,300
システムサポート	400	1,194.00	477,600
イーソル	900	656.00	590,400
アルテリア・ネットワークス	1,900	1,602.00	3,043,800



E d u L a b	200	1,158.00	231,600
東海ソフト	200	1,013.00	202,600
ウイングアーク1 s t	900	2,115.00	1,903,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	2,494.00	997,600
サーバーワークス	300	3,350.00	1,005,000
東名	200	1,121.00	224,200
ヴィッツ	100	1,292.00	129,200
トピラシステムズ	300	864.00	259,200
S a n s a n	5,300	2,589.00	13,721,700
L i n k - U	300	1,081.00	324,300
ギフトィ	1,300	2,259.00	2,936,700
ベース	300	4,055.00	1,216,500
フォーカスシステムズ	1,000	973.00	973,000
クレスコ	1,100	2,011.00	2,212,100
フジ・メディア・ホールディングス	14,400	1,145.00	16,488,000
オービック	4,700	21,650.00	101,755,000
ジャストシステム	2,100	5,420.00	11,382,000
T D C ソフト	1,300	1,097.00	1,426,100
Zホールディングス	218,000	690.00	150,420,000
トレンドマイクロ	8,000	6,750.00	54,000,000
I Dホールディングス	900	861.00	774,900
日本オラクル	3,000	10,530.00	31,590,000
アルファシステムズ	400	4,360.00	1,744,000
フューチャー	1,600	3,645.00	5,832,000
C A C H o l d i n g s	900	1,518.00	1,366,200
S Bテクノロジー	700	2,600.00	1,820,000
トーセ	400	720.00	288,000
オービックビジネスコンサルタント	1,400	4,945.00	6,923,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,800	3,855.00	26,214,000
アイティフォー	1,800	800.00	1,440,000
東計電算	200	5,070.00	1,014,000
エクスネット	200	999.00	199,800
大塚商会	8,100	5,410.00	43,821,000
サイボウズ	2,000	1,962.00	3,924,000
電通国際情報サービス	2,200	3,640.00	8,008,000
A C C E S S	1,700	729.00	1,239,300
デジタルガレージ	2,500	4,865.00	12,162,500
E Mシステムズ	2,500	778.00	1,945,000
ウェザーニューズ	400	9,700.00	3,880,000
C I J	1,000	846.00	846,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,680.00	736,000
日本エンタープライズ	1,600	180.00	288,000

WOWOW	700	1,906.00	1,334,200
スカラ	1,300	655.00	851,500
インテリジェント ウェイブ	900	538.00	484,200
I M A G I C A G R O U P	1,300	637.00	828,100
ネットワンシステムズ	5,700	3,250.00	18,525,000
システムソフト	3,300	118.00	389,400
アルゴグラフィックス	1,100	3,165.00	3,481,500
マーベラス	2,400	731.00	1,754,400
エイベックス	2,600	1,664.00	4,326,400
日本ユニシス	4,700	3,305.00	15,533,500
兼松エレクトロニクス	800	3,980.00	3,184,000
都築電気	800	1,783.00	1,426,400
T B S ホールディングス	9,100	1,715.00	15,606,500
日本テレビホールディングス	12,500	1,191.00	14,887,500
朝日放送グループホールディングス	1,500	705.00	1,057,500
テレビ朝日ホールディングス	3,600	1,454.00	5,234,400
スカパーJ S A Tホールディングス	12,700	422.00	5,359,400
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,026.00	2,228,600
日本BS放送	500	1,105.00	552,500
ビジョン	2,500	1,273.00	3,182,500
スマートバリュー	400	440.00	176,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,400	3,150.00	4,410,000
コネクシオ	1,100	1,456.00	1,601,600
日本通信	12,600	205.00	2,583,000
クロップス	300	1,071.00	321,300
日本電信電話	175,300	3,187.00	558,681,100
K D D I	109,300	3,360.00	367,248,000
ソフトバンク	227,100	1,488.00	337,924,800
光通信	1,800	17,690.00	31,842,000
エムティーアイ	1,500	614.00	921,000
G M O インターネット	5,300	2,792.00	14,797,600
アйдママーケティングコミュニケーション	400	298.00	119,200
K A D O K A W A	4,400	6,080.00	26,752,000
学研ホールディングス	2,100	1,006.00	2,112,600
ゼンリン	2,400	988.00	2,371,200
昭文社ホールディングス	600	471.00	282,600
インプレスホールディングス	1,300	220.00	286,000
アイネット	800	1,402.00	1,121,600
松竹	1,000	11,770.00	11,770,000
東宝	8,800	5,030.00	44,264,000
東映	500	18,220.00	9,110,000
エヌ・ティ・ティ・データ	39,900	2,365.00	94,363,500

ピー・シー・エー	900	1,627.00	1,464,300
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,998.00	999,000
D T S	2,900	2,580.00	7,482,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,000	5,900.00	41,300,000
シーイーシー	1,600	1,125.00	1,800,000
カプコン	14,100	2,681.00	37,802,100
アイ・エス・ビー	700	1,014.00	709,800
ジャステック	900	1,053.00	947,700
S C S K	10,400	2,315.00	24,076,000
日本システムウエア	600	2,186.00	1,311,600
アイネス	1,400	1,452.00	2,032,800
T K C	2,500	3,365.00	8,412,500
富士ソフト	1,600	5,610.00	8,976,000
N S D	4,800	2,194.00	10,531,200
コナミホールディングス	5,400	5,730.00	30,942,000
福井コンピュータホールディングス	700	3,475.00	2,432,500
J B C Cホールディングス	1,000	1,815.00	1,815,000
ミロク情報サービス	1,300	1,432.00	1,861,600
ソフトバンクグループ	89,900	5,620.00	505,238,000
ハウスイ	200	854.00	170,800
高千穂交易	600	1,492.00	895,200
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,510.00	453,000
伊藤忠食品	400	4,930.00	1,972,000
エレマテック	1,200	1,052.00	1,262,400
J A L U X	500	2,547.00	1,273,500
あらた	1,200	4,105.00	4,926,000
トーメンデバイス	200	6,510.00	1,302,000
東京エレクトロン デバイス	500	6,520.00	3,260,000
フィールズ	1,400	552.00	772,800
双日	16,600	1,680.00	27,888,000
アルフレッサ ホールディングス	16,700	1,599.00	26,703,300
横浜冷凍	4,200	837.00	3,515,400
神栄	300	792.00	237,600
ラサ商事	900	911.00	819,900
アルコニックス	1,700	1,231.00	2,092,700
神戸物産	11,700	3,850.00	45,045,000
ハイパー	500	553.00	276,500
あい ホールディングス	2,200	2,001.00	4,402,200
ディーブイエックス	600	1,114.00	668,400
ダイワボウホールディングス	7,300	1,811.00	13,220,300
マクニカ・富士エレホールディングス	3,600	2,643.00	9,514,800
ラクト・ジャパン	500	2,471.00	1,235,500

グリムス	700	2,320.00	1,624,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	804.00	2,170,800
八洲電機	1,100	954.00	1,049,400
メディアスホールディングス	900	948.00	853,200
レスターホールディングス	1,500	1,910.00	2,865,000
ジューテックホールディングス	400	1,081.00	432,400
大光	600	697.00	418,200
OCHIホールディングス	500	1,284.00	642,000
TOKAIホールディングス	7,300	857.00	6,256,100
黒谷	500	621.00	310,500
Cominix	300	725.00	217,500
三洋貿易	1,500	1,014.00	1,521,000
ビューティガレージ	300	3,095.00	928,500
ウイン・パートナーズ	1,100	971.00	1,068,100
ミタチ産業	400	921.00	368,400
シップヘルスケアホールディングス	4,800	2,628.00	12,614,400
明治電機工業	500	1,255.00	627,500
デリカフーズホールディングス	600	608.00	364,800
スターティアホールディングス	400	1,109.00	443,600
コメダホールディングス	3,300	2,035.00	6,715,500
ピーバンドットコム	300	539.00	161,700
アセンテック	600	1,009.00	605,400
富士興産	400	1,061.00	424,400
協栄産業	200	1,505.00	301,000
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,211.00	3,316,500
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,055.00	1,055,000
小野建	1,500	1,630.00	2,445,000
南陽	300	1,890.00	567,000
佐島電機	1,000	931.00	931,000
エコートレーディング	400	620.00	248,000
伯東	900	2,363.00	2,126,700
コンドーテック	1,200	994.00	1,192,800
中山福	900	362.00	325,800
ナガイレーベン	2,000	2,336.00	4,672,000
三菱食品	1,400	2,780.00	3,892,000
松田産業	1,100	2,564.00	2,820,400
第一興商	2,900	3,585.00	10,396,500
メディバルホールディングス	16,300	2,122.00	34,588,600
SPK	600	1,399.00	839,400
萩原電気ホールディングス	600	2,058.00	1,234,800
アズワン	1,100	14,810.00	16,291,000
スズデン	600	1,797.00	1,078,200

シモジマ	900	1,176.00	1,058,400
ドウシシャ	1,400	1,559.00	2,182,600
小津産業	400	1,909.00	763,600
高速	900	1,600.00	1,440,000
たけびし	600	1,463.00	877,800
リックス	400	1,499.00	599,600
丸文	1,400	797.00	1,115,800
ハピネット	1,300	1,495.00	1,943,500
橋本総業ホールディングス	300	2,071.00	621,300
日本ライフライン	4,500	1,087.00	4,891,500
タカショー	1,200	763.00	915,600
I D O M	4,600	718.00	3,302,800
進和	900	2,090.00	1,881,000
エスケイジャパン	500	437.00	218,500
ダイトロン	700	2,094.00	1,465,800
シークス	2,200	1,413.00	3,108,600
田中商事	500	629.00	314,500
オーハシテクニカ	900	1,413.00	1,271,700
白銅	500	2,861.00	1,430,500
ダイコー通産	200	1,220.00	244,000
伊藤忠商事	102,800	3,443.00	353,940,400
丸紅	148,500	1,062.00	157,707,000
高島	200	2,180.00	436,000
長瀬産業	8,300	1,860.00	15,438,000
蝶理	900	1,759.00	1,583,100
豊田通商	15,100	5,170.00	78,067,000
三共生興	2,000	562.00	1,124,000
兼松	5,600	1,261.00	7,061,600
ツカモトコーポレーション	300	1,300.00	390,000
三井物産	116,900	2,616.00	305,810,400
日本紙パルプ商事	800	3,955.00	3,164,000
カメイ	1,900	1,012.00	1,922,800
東都水産	100	4,090.00	409,000
O U G ホールディングス	200	2,634.00	526,800
スターゼン	1,100	1,951.00	2,146,100
山善	6,400	1,047.00	6,700,800
椿本興業	300	4,210.00	1,263,000
住友商事	95,000	1,650.50	156,797,500
内田洋行	700	5,240.00	3,668,000
三菱商事	112,800	3,604.00	406,531,200
第一実業	700	5,120.00	3,584,000
キャノンマーケティングジャパン	3,700	2,292.00	8,480,400

西華産業	800	1,635.00	1,308,000
佐藤商事	1,300	1,159.00	1,506,700
菱洋エレクトロ	900	2,298.00	2,068,200
東京産業	1,400	775.00	1,085,000
ユアサ商事	1,400	2,901.00	4,061,400
神鋼商事	300	3,350.00	1,005,000
トルク	1,000	211.00	211,000
阪和興業	3,000	3,190.00	9,570,000
正栄食品工業	1,000	3,905.00	3,905,000
カナデン	1,300	1,077.00	1,400,100
菱電商事	1,200	1,770.00	2,124,000
岩谷産業	3,600	5,920.00	21,312,000
ナイス	600	1,721.00	1,032,600
ニチモウ	200	2,104.00	420,800
極東貿易	400	2,429.00	971,600
アステナホールディングス	2,100	487.00	1,022,700
三愛石油	3,700	1,319.00	4,880,300
稲畑産業	3,300	1,633.00	5,388,900
G S I クレオス	800	1,099.00	879,200
明和産業	1,400	863.00	1,208,200
クワザワホールディングス	700	594.00	415,800
ワキタ	3,200	1,071.00	3,427,200
東邦ホールディングス	4,800	1,797.00	8,625,600
サンゲツ	4,000	1,603.00	6,412,000
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,247.00	2,868,100
シナネンホールディングス	600	3,635.00	2,181,000
伊藤忠エネクス	3,300	986.00	3,253,800
サンリオ	4,700	2,511.00	11,801,700
サンワテクノス	900	1,706.00	1,535,400
リョーサン	1,700	2,184.00	3,712,800
新光商事	2,300	907.00	2,086,100
トーホー	700	1,323.00	926,100
三信電気	700	1,448.00	1,013,600
東陽テクニカ	1,600	1,102.00	1,763,200
モスフードサービス	2,000	3,100.00	6,200,000
加賀電子	1,400	3,065.00	4,291,000
ソーダニッカ	1,600	783.00	1,252,800
立花エレテック	1,300	1,594.00	2,072,200
フォーバル	700	1,086.00	760,200
P A L T A C	2,100	4,580.00	9,618,000
三谷産業	2,000	317.00	634,000
太平洋興発	600	610.00	366,000

西本Wismettacホールディングス	400	3,100.00	1,240,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,010.00	402,000
コア商事ホールディングス	1,200	652.00	782,400
国際紙パルプ商事	3,300	293.00	966,900
ヤマタネ	700	1,643.00	1,150,100
丸紅建材リース	200	1,765.00	353,000
日鉄物産	1,100	4,815.00	5,296,500
泉州電業	400	5,720.00	2,288,000
トラスコ中山	3,100	2,763.00	8,565,300
オートバックスセブン	5,100	1,364.00	6,956,400
モリト	1,200	697.00	836,400
加藤産業	2,200	3,295.00	7,249,000
北恵	400	888.00	355,200
イノテック	900	1,415.00	1,273,500
イエローハット	2,600	1,610.00	4,186,000
J Kホールディングス	1,300	1,132.00	1,471,600
日伝	1,300	2,296.00	2,984,800
北沢産業	1,200	247.00	296,400
杉本商事	700	2,193.00	1,535,100
因幡電機産業	4,000	2,694.00	10,776,000
東テク	500	2,638.00	1,319,000
ミスミグループ本社	18,900	4,785.00	90,436,500
アルテック	1,200	303.00	363,600
タキヒヨー	500	1,761.00	880,500
蔵王産業	300	1,924.00	577,200
スズケン	5,900	3,355.00	19,794,500
ジェコス	1,100	798.00	877,800
グローセル	1,900	405.00	769,500
ローソン	3,300	5,710.00	18,843,000
サンエー	1,100	4,270.00	4,697,000
カワチ薬品	1,200	2,235.00	2,682,000
エービーシー・マート	2,400	5,170.00	12,408,000
ハードオフコーポレーション	800	719.00	575,200
アスクル	2,400	1,440.00	3,456,000
ゲオホールディングス	2,000	1,244.00	2,488,000
アダストリア	1,700	1,771.00	3,010,700
ジーフット	1,000	382.00	382,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	394.00	118,200
くら寿司	1,600	3,660.00	5,856,000
キャンドゥ	700	2,450.00	1,715,000
アイケイ	500	427.00	213,500
パルグループホールディングス	1,300	1,581.00	2,055,300

エディオン	6,900	1,052.00	7,258,800
サーラコーポレーション	3,200	623.00	1,993,600
ワッツ	800	756.00	604,800
ハローズ	700	2,775.00	1,942,500
フジオフードグループ本社	1,300	1,408.00	1,830,400
あみやき亭	400	2,927.00	1,170,800
大黒天物産	500	5,780.00	2,890,000
ハニーズホールディングス	1,200	1,009.00	1,210,800
ファーマライズホールディングス	400	754.00	301,600
アルペン	1,200	2,153.00	2,583,600
ハブ	600	670.00	402,000
クオールホールディングス	1,900	1,388.00	2,637,200
ジinzホールディングス	1,000	6,650.00	6,650,000
ビックカメラ	8,900	953.00	8,481,700
D C Mホールディングス	9,300	1,094.00	10,174,200
MonotaRO	19,000	2,183.00	41,477,000
東京一番フーズ	500	585.00	292,500
アークランドサービスホールディングス	1,100	2,333.00	2,566,300
J.フロント リテイリング	18,000	952.00	17,136,000
ドトール・日レスホールディングス	2,600	1,585.00	4,121,000
マツキヨココカラ&カンパニー	9,300	4,445.00	41,338,500
ブロンコビリー	900	2,428.00	2,185,200
Z O Z O	10,400	3,430.00	35,672,000
トレジャー・ファクトリー	500	920.00	460,000
物語コーポレーション	800	6,840.00	5,472,000
三越伊勢丹ホールディングス	26,300	791.00	20,803,300
Hamee	400	1,266.00	506,400
マーケットエンタープライズ	100	753.00	75,300
ウエルシアホールディングス	8,000	3,885.00	31,080,000
クリエイティブSDホールディングス	2,200	3,315.00	7,293,000
丸善CHIホールディングス	2,000	360.00	720,000
ミサワ	400	699.00	279,600
ティーライフ	200	1,342.00	268,400
シュッピン	1,300	1,056.00	1,372,800
オイシックス・ラ・大地	2,200	3,010.00	6,622,000
ネクステージ	3,100	2,441.00	7,567,100
ジョイフル本田	4,400	1,490.00	6,556,000
鳥貴族ホールディングス	600	1,706.00	1,023,600
ホットランド	1,200	1,331.00	1,597,200
すかいらーくホールディングス	19,400	1,554.00	30,147,600
SFPホールディングス	700	1,351.00	945,700
綿半ホールディングス	1,200	1,269.00	1,522,800



ヨシックスホールディングス	300	1,980.00	594,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,400	1,072.00	4,716,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,134.00	907,200
B E E N O S	800	2,665.00	2,132,000
あさひ	1,300	1,339.00	1,740,700
日本調剤	1,000	1,322.00	1,322,000
コスモス薬品	1,500	17,600.00	26,400,000
トーエル	800	811.00	648,800
オンリー	200	759.00	151,800
セブン&アイ・ホールディングス	58,900	4,986.00	293,675,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,000	717.00	5,736,000
ツルハホールディングス	3,300	11,900.00	39,270,000
サンマルクホールディングス	1,200	1,443.00	1,731,600
フェリシモ	400	1,334.00	533,600
トリドールホールディングス	3,700	2,420.00	8,954,000
T O K Y O B A S E	1,400	619.00	866,600
ウイルプラスホールディングス	300	930.00	279,000
J Mホールディングス	1,100	1,716.00	1,887,600
サツドラホールディングス	800	642.00	513,600
アレンザホールディングス	1,200	1,042.00	1,250,400
串カツ田中ホールディングス	400	2,079.00	831,600
パロックジャパンリミテッド	1,100	851.00	936,100
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,300.00	10,950,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E	8,800	4,355.00	38,324,000
メディカルシステムネットワーク	1,600	599.00	958,400
一家ホールディングス	400	524.00	209,600
はるやまホールディングス	800	473.00	378,400
ノジマ	2,400	2,368.00	5,683,200
カップ・クリエイト	2,200	1,361.00	2,994,200
ライトオン	1,200	736.00	883,200
良品計画	17,300	1,825.00	31,572,500
三城ホールディングス	2,000	226.00	452,000
アドヴァングループ	1,600	981.00	1,569,600
アルビス	500	2,199.00	1,099,500
コナカ	2,000	323.00	646,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,663.00	332,600
G - 7ホールディングス	1,700	1,723.00	2,929,100
イオン北海道	2,700	1,364.00	3,682,800
コジマ	2,700	554.00	1,495,800
ヒマラヤ	600	964.00	578,400
コーナン商事	2,200	3,365.00	7,403,000

エコス	600	1,910.00	1,146,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	30,100	1,676.00	50,447,600
西松屋チェーン	3,300	1,445.00	4,768,500
ゼンショーホールディングス	7,300	2,684.00	19,593,200
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,450.00	1,450,000
ハークスレイ	700	479.00	335,300
サイゼリヤ	2,200	3,030.00	6,666,000
V Tホールディングス	5,800	463.00	2,685,400
魚力	400	2,015.00	806,000
フジ・コーポレーション	800	1,178.00	942,400
ユナイテッドアローズ	1,600	1,836.00	2,937,600
ハイデイ日高	2,200	1,661.00	3,654,200
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	1,100	207.00	227,700
コロワイド	6,200	1,629.00	10,099,800
ピーシーデポコーポレーション	2,000	304.00	608,000
壱番屋	1,100	4,615.00	5,076,500
P L A N T	500	703.00	351,500
スギホールディングス	3,000	6,910.00	20,730,000
薬王堂ホールディングス	800	2,282.00	1,825,600
スクロール	2,400	791.00	1,898,400
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,681.00	2,353,400
木曽路	2,000	2,174.00	4,348,000
S R S ホールディングス	2,100	769.00	1,614,900
千趣会	2,800	405.00	1,134,000
リテールパートナーズ	1,800	1,302.00	2,343,600
ケーヨー	2,800	833.00	2,332,400
上新電機	1,700	2,172.00	3,692,400
日本瓦斯	7,300	1,534.00	11,198,200
ロイヤルホールディングス	2,600	1,921.00	4,994,600
東天紅	100	980.00	98,000
いなげや	1,900	1,392.00	2,644,800
チヨダ	1,500	748.00	1,122,000
ライフコーポレーション	1,400	3,420.00	4,788,000
リンガーハット	1,900	2,208.00	4,195,200
M r M a x H D	1,900	571.00	1,084,900
A O K I ホールディングス	3,000	622.00	1,866,000
オークワ	2,400	984.00	2,361,600
コメリ	2,300	2,573.00	5,917,900
青山商事	3,100	703.00	2,179,300
しまむら	1,800	9,850.00	17,730,000
はせがわ	1,000	253.00	253,000
高島屋	11,000	1,033.00	11,363,000

松屋	3,100	847.00	2,625,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,200	798.00	5,745,600
近鉄百貨店	600	2,584.00	1,550,400
丸井グループ	12,700	2,171.00	27,571,700
アクシアル リテイリング	1,200	3,375.00	4,050,000
イオン	57,900	2,820.00	163,278,000
イズミ	2,700	3,315.00	8,950,500
平和堂	2,800	1,963.00	5,496,400
フジ	1,800	1,936.00	3,484,800
ヤオコー	1,700	6,980.00	11,866,000
ゼビオホールディングス	2,100	898.00	1,885,800
ケーズホールディングス	13,900	1,097.00	15,248,300
Olympicグループ	900	639.00	575,100
日産東京販売ホールディングス	2,500	231.00	577,500
シルバーライフ	300	1,353.00	405,900
Genky DrugStores	700	4,860.00	3,402,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,006.00	402,400
ブックオフグループホールディングス	900	990.00	891,000
ギフト	300	2,654.00	796,200
アインホールディングス	2,200	5,970.00	13,134,000
元気寿司	400	2,506.00	1,002,400
ヤマダホールディングス	55,000	381.00	20,955,000
アークランドサカモト	2,400	1,667.00	4,000,800
ニトリホールディングス	6,000	18,445.00	110,670,000
愛眼	1,400	178.00	249,200
ケーユーホールディングス	900	1,082.00	973,800
吉野家ホールディングス	5,300	2,323.00	12,311,900
松屋フーズホールディングス	700	3,560.00	2,492,000
サガミホールディングス	2,300	1,049.00	2,412,700
関西スーパーマーケット	1,100	1,104.00	1,214,400
王将フードサービス	1,000	6,140.00	6,140,000
プレナス	1,700	1,971.00	3,350,700
ミニストップ	1,100	1,403.00	1,543,300
アークス	2,900	2,179.00	6,319,100
バローホールディングス	3,300	2,178.00	7,187,400
藤久	400	790.00	316,000
ベルク	700	5,610.00	3,927,000
大庄	900	957.00	861,300
ファーストリテイリング	2,000	66,960.00	133,920,000
サンドラッグ	5,700	3,110.00	17,727,000
サックスパー ホールディングス	1,500	529.00	793,500
ヤマザワ	400	1,647.00	658,800

やまや	300	2,439.00	731,700	
ペルーナ	3,200	715.00	2,288,000	
島根銀行	500	557.00	278,500	
じもとホールディングス	1,100	622.00	684,200	
めぶきフィナンシャルグループ	78,100	235.00	18,353,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,900	1,462.00	2,777,800	
九州フィナンシャルグループ	30,700	415.00	12,740,500	
ゆうちょ銀行	35,600	985.00	35,066,000	
富山第一銀行	3,600	280.00	1,008,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	86,100	424.00	36,506,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,800	741.00	7,261,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,455.00	2,037,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,487.00	5,968,800	
ひろぎんホールディングス	22,200	668.00	14,829,600	
おきなわフィナンシャルグループ	1,400	2,245.00	3,143,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,115.00	4,230,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,400	2,344.00	3,281,600	
新生銀行	9,800	2,154.00	21,109,200	
あおぞら銀行	8,400	2,579.00	21,663,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	966,200	637.20	615,662,640	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	172,400	445.20	76,752,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,400	3,912.00	111,100,800	
三井住友フィナンシャルグループ	104,300	3,920.00	408,856,000	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	50,300	675.00	33,952,500	
群馬銀行	28,900	346.00	9,999,400	
武蔵野銀行	2,200	1,712.00	3,766,400	
千葉興業銀行	3,500	253.00	885,500	
筑波銀行	5,800	167.00	968,600	
七十七銀行	4,700	1,243.00	5,842,100	
青森銀行	1,200	1,726.00	2,071,200	
秋田銀行	1,000	1,546.00	1,546,000	
山形銀行	1,700	859.00	1,460,300	
岩手銀行	1,000	1,750.00	1,750,000	
東邦銀行	12,600	208.00	2,620,800	
東北銀行	800	989.00	791,200	
みちのく銀行	1,000	796.00	796,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,700	1,922.00	24,409,400	
静岡銀行	36,600	827.00	30,268,200	
スルガ銀行	13,200	466.00	6,151,200	
八十二銀行	33,800	377.00	12,742,600	
山梨中央銀行	1,600	839.00	1,342,400	

大垣共立銀行	3,000	1,914.00	5,742,000
福井銀行	1,300	1,410.00	1,833,000
清水銀行	600	1,579.00	947,400
富山銀行	300	1,775.00	532,500
滋賀銀行	2,800	1,948.00	5,454,400
南都銀行	2,300	1,898.00	4,365,400
百五銀行	14,400	342.00	4,924,800
京都銀行	5,400	4,990.00	26,946,000
紀陽銀行	5,300	1,431.00	7,584,300
ほくほくフィナンシャルグループ	9,400	802.00	7,538,800
山陰合同銀行	8,900	627.00	5,580,300
中国銀行	12,000	900.00	10,800,000
鳥取銀行	500	1,118.00	559,000
伊予銀行	19,900	574.00	11,422,600
百十四銀行	1,600	1,464.00	2,342,400
四国銀行	2,300	747.00	1,718,100
阿波銀行	2,300	2,191.00	5,039,300
大分銀行	900	1,769.00	1,592,100
宮崎銀行	1,000	2,024.00	2,024,000
佐賀銀行	800	1,463.00	1,170,400
琉球銀行	3,200	754.00	2,412,800
セブン銀行	44,600	235.00	10,481,000
みずほフィナンシャルグループ	192,700	1,469.00	283,076,300
高知銀行	600	709.00	425,400
山口フィナンシャルグループ	17,500	651.00	11,392,500
長野銀行	500	1,210.00	605,000
名古屋銀行	1,100	2,575.00	2,832,500
北洋銀行	22,600	250.00	5,650,000
愛知銀行	500	3,785.00	1,892,500
中京銀行	600	1,423.00	853,800
大光銀行	500	1,252.00	626,000
愛媛銀行	2,100	793.00	1,665,300
トマト銀行	500	1,070.00	535,000
京葉銀行	6,400	447.00	2,860,800
栃木銀行	7,200	188.00	1,353,600
北日本銀行	500	1,492.00	746,000
東和銀行	2,600	518.00	1,346,800
福島銀行	1,700	216.00	367,200
大東銀行	700	731.00	511,700
トモニホールディングス	11,500	301.00	3,461,500
フィデアホールディングス	1,400	1,247.00	1,745,800
池田泉州ホールディングス	17,400	161.00	2,801,400

F P G	5,100	571.00	2,912,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,200	1,250.00	1,500,000
マーキュリアホールディングス	500	602.00	301,000
S B Iホールディングス	18,600	3,130.00	58,218,000
ジャフコ グループ	1,900	7,040.00	13,376,000
大和証券グループ本社	112,900	656.20	74,084,980
野村ホールディングス	230,200	514.80	118,506,960
岡三証券グループ	11,800	385.00	4,543,000
丸三証券	4,400	511.00	2,248,400
東洋証券	5,300	150.00	795,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,300	391.00	6,764,300
光世証券	300	508.00	152,400
水戸証券	4,000	275.00	1,100,000
いちよし証券	2,900	636.00	1,844,400
松井証券	7,400	776.00	5,742,400
マネックスグループ	12,300	760.00	9,348,000
極東証券	2,000	763.00	1,526,000
岩井コスモホールディングス	1,500	1,324.00	1,986,000
アイザワ証券グループ	2,500	1,076.00	2,690,000
マネーパートナーズグループ	1,700	229.00	389,300
スパークス・グループ	7,000	315.00	2,205,000
かんぽ生命保険	15,100	1,845.00	27,859,500
S O M P Oホールディングス	26,600	5,023.00	133,611,800
アニコム ホールディングス	4,600	759.00	3,491,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	33,800	3,469.00	117,252,200
第一生命ホールディングス	74,100	2,469.00	182,952,900
東京海上ホールディングス	49,600	6,340.00	314,464,000
T & Dホールディングス	39,000	1,483.00	57,837,000
アドバンスクリエイト	700	1,070.00	749,000
全国保証	3,600	4,975.00	17,910,000
あんしん保証	500	295.00	147,500
ジェイリース	500	1,991.00	995,500
イントラスト	600	718.00	430,800
日本モーゲージサービス	800	1,097.00	877,600
C a s a	500	909.00	454,500
アルヒ	2,200	1,014.00	2,230,800
プレミアグループ	800	3,630.00	2,904,000
クレディセゾン	9,600	1,173.00	11,260,800
芙蓉総合リース	1,600	7,820.00	12,512,000
みずほリース	2,300	3,125.00	7,187,500
東京センチュリー	2,900	5,560.00	16,124,000
日本証券金融	5,900	837.00	4,938,300

アイフル	25,200	358.00	9,021,600
リコーリース	1,300	3,790.00	4,927,000
イオンフィナンシャルサービス	8,200	1,262.00	10,348,400
アコム	29,600	341.00	10,093,600
ジャックス	1,700	2,920.00	4,964,000
オリエントコーポレーション	40,500	127.00	5,143,500
オリックス	91,500	2,307.00	211,090,500
三菱HCキャピタル	55,600	564.00	31,358,400
九州リースサービス	700	584.00	408,800
日本取引所グループ	38,200	2,420.00	92,444,000
イー・ギャランティ	2,200	2,551.00	5,612,200
アサックス	800	704.00	563,200
NECキャピタルソリューション	600	1,977.00	1,186,200
いちご	17,000	290.00	4,930,000
日本駐車場開発	16,800	138.00	2,318,400
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,300.00	1,170,000
SREホールディングス	400	8,160.00	3,264,000
ADワークスグループ	3,700	156.00	577,200
ヒューリック	36,100	1,108.00	39,998,800
三栄建築設計	600	1,697.00	1,018,200
野村不動産ホールディングス	7,800	2,560.00	19,968,000
三重交通グループホールディングス	3,200	473.00	1,513,600
サムティ	2,400	2,217.00	5,320,800
ディア・ライフ	2,100	522.00	1,096,200
コーセーアールイー	600	724.00	434,400
日本商業開発	1,000	1,791.00	1,791,000
プレサンスコーポレーション	2,000	1,946.00	3,892,000
THEグローバル社	1,400	196.00	274,400
ハウスコム	300	1,299.00	389,700
日本管理センター	800	1,010.00	808,000
サンセイランディック	500	826.00	413,000
エストラスト	300	636.00	190,800
フージャースホールディングス	2,100	652.00	1,369,200
オープンハウス	4,800	6,240.00	29,952,000
東急不動産ホールディングス	44,400	622.00	27,616,800
飯田グループホールディングス	12,600	2,594.00	32,684,400
イーランド	300	1,556.00	466,800
ムゲンエステート	1,100	498.00	547,800
ビーロッド	1,200	546.00	655,200
ファーストブラザーズ	400	918.00	367,200
ハウズドゥ	900	927.00	834,300
シーアールイー	500	1,723.00	861,500

プロパティエージェント	200	1,754.00	350,800
ケイアイスター不動産	700	8,380.00	5,866,000
アグレ都市デザイン	300	1,572.00	471,600
グッドコムアセット	700	1,098.00	768,600
ジェイ・エス・ビー	300	3,135.00	940,500
テンポイノベーション	500	886.00	443,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	960.00	288,000
フェイスネットワーク	200	1,257.00	251,400
パーク24	8,100	1,657.00	13,421,700
パラカ	500	1,555.00	777,500
三井不動産	68,700	2,328.50	159,967,950
三菱地所	99,100	1,571.50	155,735,650
平和不動産	2,600	3,735.00	9,711,000
東京建物	14,900	1,678.00	25,002,200
ダイビル	3,900	2,222.00	8,665,800
京阪神ビルディング	2,400	1,542.00	3,700,800
住友不動産	31,700	3,401.00	107,811,700
テーオーシー	2,900	648.00	1,879,200
東京楽天地	300	4,030.00	1,209,000
スターツコーポレーション	2,100	2,488.00	5,224,800
フジ住宅	1,900	662.00	1,257,800
空港施設	1,700	551.00	936,700
明和地所	800	567.00	453,600
ゴールドクレスト	1,300	1,600.00	2,080,000
エスリード	600	1,654.00	992,400
日神グループホールディングス	2,600	486.00	1,263,600
日本エスコン	2,900	809.00	2,346,100
タカラレーベン	6,700	278.00	1,862,600
A V A N T I A	900	872.00	784,800
イオンモール	7,600	1,622.00	12,327,200
毎日コムネット	600	737.00	442,200
ファースト住建	600	1,215.00	729,000
カチタス	3,700	4,325.00	16,002,500
トーセイ	2,100	998.00	2,095,800
サンフロンティア不動産	2,100	982.00	2,062,200
F Jネクストホールディングス	1,500	1,007.00	1,510,500
インテリックス	500	653.00	326,500
ランドビジネス	1,000	261.00	261,000
グランディハウス	1,200	477.00	572,400
日本空港ビルデング	5,800	4,845.00	28,101,000
明豊ファシリティワークス	700	809.00	566,300
日本工営	900	3,380.00	3,042,000



L I F U L L	4,500	254.00	1,143,000
ミクシィ	3,300	2,015.00	6,649,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,200	2,209.00	2,650,800
日本M&Aセンターホールディングス	23,900	3,105.00	74,209,500
メンバーズ	400	2,337.00	934,800
中広	200	398.00	79,600
UTグループ	2,100	4,220.00	8,862,000
アイティメディア	700	1,849.00	1,294,300
E・Jホールディングス	800	1,192.00	953,600
夢真ビーネックスグループ	3,900	1,683.00	6,563,700
コシダカホールディングス	3,800	635.00	2,413,000
アルトナー	400	843.00	337,200
パソナグループ	1,600	3,550.00	5,680,000
C D S	400	1,640.00	656,000
リンクアンドモチベーション	3,200	583.00	1,865,600
エス・エム・エス	4,900	4,485.00	21,976,500
サニーサイドアップグループ	500	753.00	376,500
パーソルホールディングス	14,600	3,445.00	50,297,000
リニカル	900	790.00	711,000
クックパッド	4,600	245.00	1,127,000
エスクリ	700	435.00	304,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	700	622.00	435,400
学情	600	1,096.00	657,600
スタジオアリス	600	2,095.00	1,257,000
シミックホールディングス	800	1,528.00	1,222,400
エプロ	300	808.00	242,400
N J S	300	1,835.00	550,500
総合警備保障	5,800	4,680.00	27,144,000
カカクコム	10,700	3,190.00	34,133,000
アイロムグループ	500	1,677.00	838,500
セントケア・ホールディング	1,000	752.00	752,000
サイネックス	300	591.00	177,300
ルネサンス	1,000	1,137.00	1,137,000
ディップ	2,600	3,990.00	10,374,000
デジタルホールディングス	1,000	1,427.00	1,427,000
新日本科学	1,800	1,474.00	2,653,200
キャリアデザインセンター	400	969.00	387,600
ベネフィット・ワン	5,300	5,020.00	26,606,000
エムスリー	25,800	5,721.00	147,601,800
ツカダ・グローバルホールディング	900	297.00	267,300
プラス	200	714.00	142,800
アウトソーシング	8,300	1,657.00	13,753,100

ウェルネット	1,500	455.00	682,500
ワールドホールディングス	600	2,656.00	1,593,600
ディー・エヌ・エー	5,500	1,735.00	9,542,500
博報堂DYホールディングス	20,300	1,885.00	38,265,500
ぐるなび	2,400	448.00	1,075,200
タカミヤ	1,800	447.00	804,600
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	990.00	990,000
ファンコミュニケーションズ	3,600	420.00	1,512,000
ライク	400	1,761.00	704,400
ビジネス・ブレークスルー	500	432.00	216,000
エスプール	4,100	1,218.00	4,993,800
WDBホールディングス	700	3,200.00	2,240,000
手間いらず	200	5,230.00	1,046,000
ティア	800	447.00	357,600
CDG	200	1,376.00	275,200
アドウェイズ	2,200	866.00	1,905,200
バリューコマース	1,100	4,635.00	5,098,500
インフォマート	16,000	986.00	15,776,000
J Pホールディングス	3,700	249.00	921,300
エコナックホールディングス	2,600	93.00	241,800
レグス	300	1,408.00	422,400
プレステージ・インターナショナル	5,400	701.00	3,785,400
アミューズ	800	2,071.00	1,656,800
ドリームインキュベータ	400	1,279.00	511,600
クイック	1,000	1,498.00	1,498,000
TAC	800	228.00	182,400
電通グループ	15,000	3,995.00	59,925,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	997.00	697,900
ぴあ	500	3,500.00	1,750,000
イオンファンタジー	600	1,815.00	1,089,000
シーティーエス	1,700	805.00	1,368,500
ネクシィーズグループ	500	717.00	358,500
H.U.グループホールディングス	3,800	2,857.00	10,856,600
アルプス技研	1,300	1,960.00	2,548,000
ダイオーズ	300	1,025.00	307,500
日本空調サービス	1,500	803.00	1,204,500
オリエンタルランド	17,300	19,090.00	330,257,000
ダスキン	3,400	2,815.00	9,571,000
明光ネットワークジャパン	1,700	564.00	958,800
ファルコホールディングス	700	1,988.00	1,391,600
秀英予備校	300	411.00	123,300
ラウンドワン	4,100	1,380.00	5,658,000

リゾートトラスト	6,700	1,947.00	13,044,900
ビー・エム・エル	1,900	3,510.00	6,669,000
りらいあコミュニケーションズ	2,200	1,006.00	2,213,200
リソー教育	6,700	399.00	2,673,300
早稲田アカデミー	800	1,056.00	844,800
ユー・エス・エス	16,300	1,821.00	29,682,300
東京個別指導学院	1,300	629.00	817,700
サイバーエージェント	36,000	2,025.00	72,900,000
楽天グループ	75,000	1,126.00	84,450,000
クリーク・アンド・リバー社	800	2,059.00	1,647,200
モーニングスター	2,500	644.00	1,610,000
テー・オー・ダブリュー	2,600	317.00	824,200
山田コンサルティンググループ	800	1,134.00	907,200
セントラルスポーツ	500	2,443.00	1,221,500
フルキャストホールディングス	1,200	2,539.00	3,046,800
エン・ジャパン	2,400	3,470.00	8,328,000
リソルホールディングス	200	4,160.00	832,000
テクノプロ・ホールディングス	8,700	3,345.00	29,101,500
アトラグループ	300	281.00	84,300
インターワークス	400	440.00	176,000
アイ・アールジャパンホールディングス	700	7,050.00	4,935,000
K e e P e r 技研	900	2,360.00	2,124,000
ファーストロジック	300	824.00	247,200
三機サービス	300	985.00	295,500
G u n o s y	1,000	832.00	832,000
デザインワン・ジャパン	400	191.00	76,400
イー・ガーディアン	600	3,430.00	2,058,000
リブセンス	800	181.00	144,800
ジャパンマテリアル	4,500	1,766.00	7,947,000
ベクトル	2,100	1,186.00	2,490,600
ウチヤマホールディングス	700	305.00	213,500
チャーム・ケア・コーポレーション	1,100	1,452.00	1,597,200
キャリアリンク	600	1,302.00	781,200
I B J	1,200	949.00	1,138,800
アサンテ	600	1,721.00	1,032,600
バリューHR	600	2,800.00	1,680,000
M & A キャピタルパートナーズ	1,200	5,550.00	6,660,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,673.00	1,003,800
E R I ホールディングス	400	1,397.00	558,800
アピスト	200	2,812.00	562,400
シグマクシス・ホールディングス	900	2,674.00	2,406,600
ウィルグループ	1,100	1,311.00	1,442,100

エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	180.00	342,000	
メドピア	1,100	3,420.00	3,762,000	
レアジョブ	300	940.00	282,000	
リクルートホールディングス	112,600	6,832.00	769,283,200	
エラン	2,000	1,224.00	2,448,000	
土木管理総合試験所	700	330.00	231,000	
ネットマーケティング	700	430.00	301,000	
日本郵政	190,700	895.80	170,829,060	
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,268.00	2,662,800	
鎌倉新書	1,700	688.00	1,169,600	
S MN	300	627.00	188,100	
一蔵	200	395.00	79,000	
グローバルキッズCOMPANY	300	787.00	236,100	
エアトリ	900	3,515.00	3,163,500	
アトラエ	1,000	2,598.00	2,598,000	
ストライク	600	5,430.00	3,258,000	
ソラスト	3,600	1,218.00	4,384,800	
セラク	500	1,660.00	830,000	
インソース	1,400	2,927.00	4,097,800	
ベйкаレント・コンサルティング	1,000	46,700.00	46,700,000	
Orchestra Holdings	300	3,650.00	1,095,000	
アイモバイル	400	1,301.00	520,400	
キャリアインデックス	500	937.00	468,500	
MS - Japan	600	1,002.00	601,200	
船場	300	781.00	234,300	
グレイステクノロジー	1,900	380.00	722,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,600	2,285.00	10,511,000	
フルテック	200	1,459.00	291,800	
ツナググループ・ホールディングス	300	263.00	78,900	
GameWith	400	482.00	192,800	
ソウルドアウト	300	1,230.00	369,000	
MS&Consulting	200	739.00	147,800	
ウェルビー	900	1,319.00	1,187,100	
エル・ティー・エス	200	2,726.00	545,200	
ミダックホールディングス	600	4,120.00	2,472,000	
日総工産	1,100	865.00	951,500	
キュービーネットホールディングス	700	1,663.00	1,164,100	
RPAホールディングス	2,100	363.00	762,300	
スプリックス	400	1,770.00	708,000	
マネジメントソリューションズ	700	2,826.00	1,978,200	
プロレド・パートナーズ	300	1,202.00	360,600	
and factory	300	397.00	119,100	

テノ・ホールディングス	200	600.00	120,000
フロンティア・マネジメント	400	728.00	291,200
ピアラ	200	615.00	123,000
コプロ・ホールディングス	300	1,278.00	383,400
ギークス	300	1,900.00	570,000
カーブスホールディングス	4,000	801.00	3,204,000
フォーラムエンジニアリング	1,000	832.00	832,000
ダイレクトマーケティングミックス	800	3,885.00	3,108,000
ポピンズホールディングス	300	2,969.00	890,700
LITALICO	1,200	4,110.00	4,932,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	772.00	617,600
リログループ	8,000	2,121.00	16,968,000
東祥	1,100	1,673.00	1,840,300
TREホールディングス	2,000	1,799.00	3,598,000
人・夢・技術グループ	600	1,863.00	1,117,800
エイチ・アイ・エス	3,200	1,881.00	6,019,200
ラックランド	400	3,035.00	1,214,000
共立メンテナンス	2,600	4,000.00	10,400,000
イチネンホールディングス	1,500	1,340.00	2,010,000
建設技術研究所	900	2,402.00	2,161,800
スペース	1,000	955.00	955,000
燦ホールディングス	600	1,542.00	925,200
スバル興業	100	8,610.00	861,000
東京テアトル	600	1,219.00	731,400
タナベ経営	600	710.00	426,000
ナガワ	500	11,840.00	5,920,000
東京都競馬	1,100	4,280.00	4,708,000
常磐興産	600	1,427.00	856,200
カナモト	2,600	2,314.00	6,016,400
西尾レントオール	1,300	2,711.00	3,524,300
トランス・コスモス	1,800	3,200.00	5,760,000
乃村工藝社	6,300	1,007.00	6,344,100
藤田観光	600	2,448.00	1,468,800
KNT-CTホールディングス	900	1,443.00	1,298,700
日本管財	1,600	2,779.00	4,446,400
トーカイ	1,300	2,023.00	2,629,900
白洋舎	200	1,794.00	358,800
セコム	14,400	7,884.00	113,529,600
セントラル警備保障	700	2,404.00	1,682,800
丹青社	3,000	825.00	2,475,000
メイテック	1,800	6,790.00	12,222,000
応用地質	1,600	2,022.00	3,235,200

船井総研ホールディングス	3,000	2,585.00	7,755,000	
進学会ホールディングス	500	272.00	136,000	
オオバ	1,100	783.00	861,300	
いであ	400	1,907.00	762,800	
学究社	500	1,514.00	757,000	
ベネッセホールディングス	4,900	2,332.00	11,426,800	
イオンディライト	1,800	3,475.00	6,255,000	
ナック	700	959.00	671,300	
ダイセキ	2,700	5,100.00	13,770,000	
ステップ	500	1,891.00	945,500	
合 計	16,642,500		41,523,001,320	

## (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）

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,184,685,265	427,455,715
コール・ローン	2,001,159,580	2,621,684,108
株式	229,115,883,421	245,457,434,444
投資証券	5,490,394,239	5,880,793,918
派生商品評価勘定	66,187,717	20,785,506
未収入金	1,538,527	29,621,522
未収配当金	237,129,382	229,488,883
差入委託証拠金	557,121,294	780,462,553
流動資産合計	238,654,099,425	255,447,726,649
資産合計	238,654,099,425	255,447,726,649
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	547,285	41,633,585
未払金	52,370,892	213,450
未払解約金	9,915,078	180,294,879
未払利息	201	838
流動負債合計	62,833,456	222,142,752
負債合計	62,833,456	222,142,752

2021年 6月15日現在

2021年12月15日現在

純資産の部		
元本等		
元本	63,265,396,098	62,271,175,728
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	175,325,869,871	192,954,408,169
元本等合計	238,591,265,969	255,225,583,897
純資産合計	238,591,265,969	255,225,583,897
負債純資産合計	238,654,099,425	255,447,726,649

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

		2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
1.	期首	2020年12月16日	2021年 6月16日
	期首元本額	74,383,931,913円	63,265,396,098円
	期首からの追加設定元本額	2,601,779,262円	4,096,403,568円
	期首からの一部解約元本額	13,720,315,077円	5,090,623,938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)	23,398,484,888円	26,237,072,340円

	2021年 6月15日現在	2021年12月15日現在
DCインデックスバランス(株式20)	113,594,891円	110,060,865円
DCインデックスバランス(株式40)	297,550,908円	297,255,260円
DCインデックスバランス(株式60)	586,617,893円	592,759,003円
DCインデックスバランス(株式80)	631,463,325円	639,167,850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	1,523,655,093円	1,482,800,678円
日興五大陸株式ファンド	4,162,772,320円	3,846,262,587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)	30,655,328円	19,208,793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)	118,772,978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)	6,415,751,839円	6,104,455,535円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	18,965,376,503円	16,214,802,024円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,827,301円	3,504,286円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,197,684円	3,088,122円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	4,142,866円	3,796,020円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	3,674,744円	3,214,240円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,622,823,187円	2,272,831,900円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	21,181,591円	18,914,144円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	60,542,719円	53,955,110円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	91,524,256円	82,128,936円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	87,887,848円	79,547,174円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,121,897,936円	4,101,790,769円
計	63,265,396,098円	62,271,175,728円
2. 受益権の総数	63,265,396,098口	62,271,175,728口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年12月16日 至 2021年 6月15日	自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

(2021年 6月15日現在)

売買目的有価証券

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

(2021年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	216,138,160
投資証券	129,574,862
合計	345,713,022

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2021年 6月15日現在)

(単位:円)

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

(2021年12月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,900,254,088	-	3,881,527,771	18,726,317
合計		3,900,254,088	-	3,881,527,771	18,726,317

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2021年 6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,444,951,160	-	2,460,275,930	15,324,770
	米ドル	1,914,901,800	-	1,926,299,930	11,398,130
	ユーロ	530,049,360	-	533,976,000	3,926,640
	売建	49,124,300	-	49,327,135	202,835
	加ドル	12,635,700	-	12,695,018	59,318
	ユーロ	23,247,000	-	23,353,925	106,925
	シンガポールドル	13,241,600	-	13,278,192	36,592
合計		2,494,075,460	-	2,509,603,065	15,121,935

(2021年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,715,641,600	-	2,713,558,910	2,082,690
	米ドル	2,247,867,920	-	2,251,685,300	3,817,380
	ユーロ	467,773,680	-	461,873,610	5,900,070
	売建	27,601,260	-	27,640,332	39,072
	スウェーデンクローナ	27,601,260	-	27,640,332	39,072
合計		2,743,242,860	-	2,741,199,242	2,121,762

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2021年 6月15日現在		2021年12月15日現在	
1口当たり純資産額	3.7713円	1口当たり純資産額	4.0986円
(1万口当たり純資産額)	(37,713円)	(1万口当たり純資産額)	(40,986円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES CO	35,215	24.08	847,977.20	
	CHENIERE ENERGY INC	9,430	102.08	962,614.40	
	CHEVRON CORP	75,041	116.22	8,721,265.02	
	CONOCOPHILLIPS	52,316	70.68	3,697,694.88	
	COTERRA ENERGY INC	26,800	20.09	538,412.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,030	40.34	1,009,710.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,730	104.07	804,461.10	
	EOG RESOURCES INC	22,662	85.30	1,933,068.60	
	EXXON MOBIL CORP	164,671	61.54	10,133,853.34	
	HALLIBURTON CO	34,687	22.48	779,763.76	
	HESS CORP	10,910	76.18	831,123.80	
	KINDER MORGAN INC	80,380	15.82	1,271,611.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	25,162	62.45	1,571,366.90	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	36,251	28.74	1,041,853.74	
	ONEOK INC	17,040	59.37	1,011,664.80	
	PHILLIPS 66	16,825	70.73	1,190,032.25	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,570	177.52	1,521,346.40		
SCHLUMBERGER LTD	54,581	29.67	1,619,418.27		

VALERO ENERGY CORP	15,632	68.19	1,065,946.08	
WILLIAMS COS INC	47,104	25.88	1,219,051.52	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,535	298.20	2,545,137.00	
ALBEMARLE CORP	4,600	243.83	1,121,618.00	
AMCOR PLC	63,210	11.67	737,660.70	
AVERY DENNISON CORP	3,200	208.32	666,624.00	
BALL CORP	12,670	92.32	1,169,694.40	
CELANESE CORP	3,930	159.59	627,188.70	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,060	62.24	501,654.40	
CORTEVA INC	29,012	46.31	1,343,545.72	
CROWN HOLDINGS INC	5,235	105.43	551,926.05	
DOW INC	28,855	53.88	1,554,707.40	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,392	77.64	1,583,234.88	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	115.87	590,357.65	
ECOLAB INC	10,060	228.88	2,302,532.80	
FMC CORP	5,140	104.61	537,695.40	
FREEPORT-MCMORAN INC	58,938	37.96	2,237,286.48	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,510	45.54	660,785.40	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	145.71	1,405,372.95	
LINDE PLC	20,240	334.50	6,770,280.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	89.16	896,058.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,425	435.84	1,056,912.00	
MOSAIC CO/THE	14,870	35.81	532,494.70	
NEWMONT CORP	31,042	56.17	1,743,629.14	
NUCOR CORP	11,709	118.42	1,386,579.78	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	130.63	467,655.40	
PPG INDUSTRIES INC	9,114	162.46	1,480,660.44	
RPM INTERNATIONAL INC	5,590	96.84	541,335.60	
SEALED AIR CORP	6,376	64.15	409,020.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,831	342.76	3,369,673.56	
STEEL DYNAMICS INC	7,510	61.38	460,963.80	
VULCAN MATERIALS CO	5,143	204.14	1,049,892.02	
WESTROCK CO	10,519	43.31	455,577.89	
3M CO	22,486	174.72	3,928,753.92	
ALLEGION PLC	3,610	129.63	467,964.30	

AMETEK INC	8,943	141.14	1,262,215.02
BOEING CO/THE	21,682	195.50	4,238,831.00
CARRIER GLOBAL CORP	31,848	53.55	1,705,460.40
CATERPILLAR INC	21,256	201.64	4,286,059.84
CUMMINS INC	5,675	216.58	1,229,091.50
DEERE & CO	11,550	348.55	4,025,752.50
DOVER CORP	5,350	168.07	899,174.50
EATON CORP PLC	15,536	164.84	2,560,954.24
EMERSON ELECTRIC CO	23,260	91.35	2,124,801.00
FASTENAL CO	21,616	63.03	1,362,456.48
FORTIVE CORP	12,674	74.01	938,002.74
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,570	103.76	577,943.20
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	341.30	832,772.00
GENERAL DYNAMICS CORP	9,452	203.47	1,923,198.44
GENERAL ELECTRIC CO	42,837	92.11	3,945,716.07
HEICO CORP	2,000	139.10	278,200.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	124.36	308,412.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,976	206.68	5,575,399.68
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	29.68	433,417.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,800	186.20	335,160.00
IDEX CORP	2,830	234.14	662,616.20
ILLINOIS TOOL WORKS	12,195	241.70	2,947,531.50
INGERSOLL-RAND INC	15,268	58.08	886,765.44
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,370	55.76	466,711.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,824	77.78	2,164,150.72
KORNIT DIGITAL LTD	1,640	137.30	225,180.20
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,050	213.00	1,714,650.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	324.10	453,740.00
LOCKHEED MARTIN CORP	9,616	345.64	3,323,674.24
MASCO CORP	8,979	68.14	611,829.06
NORDSON CORP	2,010	264.56	531,765.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,884	376.22	2,213,678.48
OTIS WORLDWIDE CORP	16,004	84.81	1,357,299.24
OWENS CORNING	4,030	88.89	358,226.70
PACCAR INC	13,654	88.17	1,203,873.18

PARKER HANNIFIN CORP	4,895	311.40	1,524,303.00
PENTAIR PLC	5,588	71.85	401,497.80
PLUG POWER INC	21,630	30.55	660,796.50
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	59,116	83.50	4,936,186.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	342.62	1,474,293.86
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,030	466.29	1,879,148.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	57.30	370,731.00
SMITH (A.O.) CORP	4,770	81.98	391,044.60
SNAP-ON INC	2,270	212.89	483,260.30
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,136	191.38	1,174,307.68
SUNRUN INC	7,160	35.50	254,180.00
TEXTRON INC	9,246	73.14	676,252.44
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,276	199.80	1,853,344.80
TRANSDIGM GROUP INC	2,040	583.74	1,190,829.60
UNITED RENTALS INC	2,820	337.58	951,975.60
WABTEC CORP	5,780	88.79	513,206.20
WW GRAINGER INC	1,752	507.76	889,595.52
XYLEM INC	7,778	118.68	923,093.04
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,570	84.13	468,604.10
CINTAS CORP	3,557	448.59	1,595,634.63
CLARIVATE PLC	17,150	24.29	416,573.50
COPART INC	8,140	147.08	1,197,231.20
COSTAR GROUP INC	14,910	77.26	1,151,946.60
EQUIFAX INC	4,654	288.22	1,341,375.88
IHS MARKIT LTD	14,653	131.76	1,930,679.28
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,090	140.25	713,872.50
LEIDOS HOLDINGS INC	4,840	88.27	427,226.80
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	135.47	1,101,371.10
ROBERT HALF INTL INC	4,405	106.49	469,088.45
ROLLINS INC	9,015	32.34	291,545.10
TRANSUNION	7,140	114.06	814,388.40
VERISK ANALYTICS INC	5,940	224.80	1,335,312.00
WASTE CONNECTIONS INC	10,626	131.13	1,393,387.38
WASTE MANAGEMENT INC	16,494	162.58	2,681,594.52
AMERCO	375	710.17	266,313.75

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,150	103.63	533,694.50
CSX CORP	88,179	35.92	3,167,389.68
DELTA AIR LINES INC	5,105	36.53	186,485.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	133.17	869,200.59
FEDEX CORP	9,683	240.04	2,324,307.32
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	196.60	644,848.00
KANSAS CITY SOUTHERN	3,525	293.59	1,034,904.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,180	60.75	375,435.00
LYFT INC-A	9,660	38.98	376,546.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,640	283.74	2,735,253.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,795	352.08	1,336,143.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	40.24	220,112.80
UBER TECHNOLOGIES INC	48,910	37.26	1,822,386.60
UNION PACIFIC CORP	25,491	244.61	6,235,353.51
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,497	203.74	5,805,978.78
APTIV PLC	10,120	160.82	1,627,498.40
BORGWARNER INC	9,890	44.60	441,094.00
FORD MOTOR COMPANY	154,065	20.05	3,089,003.25
GENERAL MOTORS CORP	51,295	58.40	2,995,628.00
LEAR CORP	2,520	182.46	459,799.20
LUCID GROUP INC	16,510	40.87	674,763.70
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	6,450	117.14	755,553.00
TESLA INC	32,815	958.51	31,453,505.65
DR HORTON INC	13,386	104.74	1,402,049.64
GARMIN LTD	5,865	134.13	786,672.45
HASBRO INC	5,298	100.40	531,919.20
LENNAR CORP-CL A	10,480	111.15	1,164,852.00
LULULEMON ATHLETICA INC	4,650	395.09	1,837,168.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,458	175.14	430,494.12
NEWELL BRANDS INC	16,126	22.40	361,222.40
NIKE INC -CL B	49,938	165.40	8,259,745.20
NVR INC	135	5,832.05	787,326.75
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,230	39.26	401,629.80
PULTE GROUP INC	10,010	53.86	539,138.60
VF CORP	13,040	73.57	959,352.80



WHIRLPOOL CORP	2,509	232.02	582,138.18
AIRBNB INC-CLASS A	9,490	167.96	1,593,940.40
ARAMARK	7,800	34.22	266,916.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,613	2,124.93	3,427,512.09
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,990	86.16	688,418.40
CARNIVAL CORP	31,027	18.15	563,140.05
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,105	1,677.20	1,853,306.00
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	149.13	752,062.59
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	523.15	800,419.50
DRAFTKINGS INC - CL A	13,490	27.81	375,156.90
EXPEDIA GROUP INC	5,422	158.26	858,085.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,920	141.98	1,550,421.60
LAS VEGAS SANDS CORP	14,900	36.37	541,913.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,603	154.01	1,632,968.03
MCDONALD'S CORP	29,191	262.52	7,663,221.32
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	8,080	9.59	77,487.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,220	41.23	668,750.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	71.60	626,356.80
STARBUCKS CORP	46,154	114.71	5,294,325.34
VAIL RESORTS INC	1,520	325.42	494,638.40
WYNN RESORTS LTD	3,510	83.32	292,453.20
YUM! BRANDS INC	11,624	131.99	1,534,251.76
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,290	59.52	1,802,860.80
ALPHABET INC-CL A	11,740	2,878.14	33,789,363.60
ALPHABET INC-CL C	11,270	2,899.41	32,676,350.70
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,530	24.50	502,985.00
CABLE ONE INC	225	1,699.89	382,475.25
CHARTER COMMUNICATION-A	5,121	621.89	3,184,698.69
COMCAST CORP-CLASS A	178,954	48.76	8,725,797.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,790	22.51	130,332.90
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,410	21.68	269,048.80
DISH NETWORK CORP-A	9,279	32.22	298,969.38
ELECTRONIC ARTS INC	11,034	126.85	1,399,662.90
FOX CORP - CLASS A	13,574	35.98	488,392.52
FOX CORP- CLASS B	5,466	33.47	182,947.02

IAC/INTERACTIVECORP	3,090	122.47	378,432.30
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,536	36.65	496,094.40
LIBERTY BROADBAND-A	740	149.00	110,260.00
LIBERTY BROADBAND-C	5,870	151.41	888,776.70
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	47.87	159,167.75
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,616	47.74	315,847.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,970	60.03	418,409.10
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,060	108.19	655,631.40
MATCH GROUP INC	9,892	122.81	1,214,836.52
META PLATFORMS INC	93,050	333.74	31,054,507.00
NETFLIX INC	17,285	597.99	10,336,257.15
NEWS CORP - CLASS A	16,580	21.01	348,345.80
OMNICOM GROUP	8,337	72.11	601,181.07
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	35.62	746,239.00
ROKU INC	4,350	221.55	963,742.50
SEA LTD-ADR	5,170	224.72	1,161,802.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,240	6.30	297,612.00
SNAP INC - A	40,000	46.85	1,874,000.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	4,450	167.63	745,953.50
THE WALT DISNEY CO.	70,972	149.10	10,581,925.20
TWITTER INC	30,850	44.35	1,368,197.50
VIACOMCBS INC - CLASS B	22,823	29.60	675,560.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	8,320	60.46	503,027.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,488	235.39	585,650.32
AMAZON.COM INC	17,775	3,381.83	60,112,028.25
AUTOZONE INC	847	1,999.54	1,693,610.38
BATH & BODY WORKS INC	10,670	73.45	783,711.50
BEST BUY CO INC	8,724	101.37	884,351.88
BURLINGTON STORES INC	2,730	280.08	764,618.40
CARMAX INC	6,249	141.31	883,046.19
CARVANA CO	3,200	241.00	771,200.00
CHEWY INC - CLASS A	3,410	54.87	187,106.70
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,120	225.45	2,056,104.00
DOLLAR TREE INC	9,006	139.24	1,253,995.44
DOORDASH INC - A	4,370	156.43	683,599.10

EBAY INC	26,367	65.85	1,736,266.95
ETSY INC	4,980	217.66	1,083,946.80
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,010	121.12	122,331.20
GENUINE PARTS CO	5,611	131.90	740,090.90
HOME DEPOT INC	41,220	402.20	16,578,684.00
LKQ CORP	10,810	56.35	609,143.50
LOWE'S COS INC	27,152	252.46	6,854,793.92
MERCADOLIBRE INC	1,740	1,190.40	2,071,296.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,695	667.36	1,798,535.20
POOL CORP	1,740	558.70	972,138.00
ROSS STORES INC	13,722	109.60	1,503,931.20
TARGET CORP	19,020	235.28	4,475,025.60
TJX COMPANIES INC	46,716	72.94	3,407,465.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,490	234.19	1,051,513.10
ULTA BEAUTY INC	2,010	389.65	783,196.50
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	206.11	585,352.40
COSTCO WHOLESALE CORP	17,274	545.34	9,420,203.16
KROGER CO	28,230	45.58	1,286,723.40
SYSCO CORP	19,886	73.52	1,462,018.72
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28,602	49.32	1,410,650.64
WALMART INC	59,912	144.94	8,683,645.28
ALTRIA GROUP INC	71,708	45.40	3,255,543.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,383	64.85	1,386,687.55
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	71.86	839,324.80
BUNGE LTD	5,457	87.08	475,195.56
CAMPBELL SOUP CO	6,835	43.07	294,383.45
COCA-COLA CO/THE	159,372	57.80	9,211,701.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	53.44	441,414.40
CONAGRA BRANDS INC	19,470	32.50	632,775.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,545	236.81	1,549,921.45
GENERAL MILLS INC	23,449	65.91	1,545,523.59
HERSHEY CO/THE	5,715	187.69	1,072,648.35
HORMEL FOODS CORP	11,500	47.90	550,850.00
JM SMUCKER CO/THE	4,370	135.18	590,736.60
KELLOGG CO	10,528	63.37	667,159.36

KEURIG DR PEPPER INC	27,050	35.06	948,373.00
KRAFT HEINZ CO/THE	26,891	34.78	935,268.98
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,770	91.58	894,736.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,640	45.87	350,446.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,985	63.39	3,422,109.15
MONSTER BEVERAGE CORP	15,220	90.37	1,375,431.40
PEPSICO INC	53,811	169.39	9,115,045.29
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	60,488	91.92	5,560,056.96
TYSON FOODS INC-CL A	11,216	85.75	961,772.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,680	97.91	947,768.80
CLOROX COMPANY	4,916	172.67	848,845.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,950	82.13	2,459,793.50
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,150	356.76	3,264,354.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,023	138.09	1,798,346.07
PROCTER & GAMBLE CO	94,519	158.25	14,957,631.75
ABBOTT LABORATORIES	69,266	132.94	9,208,222.04
ABIOMED INC	1,770	311.27	550,947.90
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	605.73	1,720,273.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	123.30	711,934.20
ANTHEM INC	9,521	433.94	4,131,542.74
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,619	82.51	1,618,763.69
BECTON DICKINSON AND CO	11,247	247.94	2,788,581.18
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,988	40.85	2,164,559.80
CARDINAL HEALTH INC	11,355	48.93	555,600.15
CENTENE CORP	22,507	81.85	1,842,197.95
CERNER CORP	11,120	77.26	859,131.20
CIGNA CORP	13,150	216.62	2,848,553.00
COOPER COS INC/THE	1,840	392.33	721,887.20
CVS HEALTH CORP	51,678	98.78	5,104,752.84
DAVITA INC	2,648	105.07	278,225.36
DENTSPLY SIRONA INC	8,702	53.14	462,424.28
DEXCOM INC	3,710	535.34	1,986,111.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,040	116.90	2,810,276.00
HCA HEALTHCARE INC	10,405	245.11	2,550,369.55
HENRY SCHEIN INC	5,040	74.55	375,732.00

HOLOGIC INC	10,298	74.83	770,599.34
HUMANA INC	4,975	461.86	2,297,753.50
IDEXX LABORATORIES INC	3,270	596.35	1,950,064.50
INMODE LTD	1,670	65.30	109,051.00
INSULET CORP	2,585	255.32	660,002.20
INTUITIVE SURGICAL INC	13,980	328.24	4,588,795.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,875	294.66	1,141,807.50
MASIMO CORP	2,020	278.50	562,570.00
MCKESSON CORP	6,134	229.63	1,408,550.42
MEDTRONIC PLC	52,648	111.69	5,880,255.12
MOLINA HEALTHCARE INC	2,360	306.18	722,584.80
NOVOCURE LTD	3,430	83.20	285,376.00
OAK STREET HEALTH INC	3,420	32.59	111,457.80
QUEST DIAGNOSTICS	5,246	164.43	862,599.78
RESMED INC	5,630	256.46	1,443,869.80
STERIS PLC	4,390	226.83	995,783.70
STRYKER CORP	13,323	254.75	3,394,034.25
TELADOC HEALTH INC	5,180	92.17	477,440.60
TELEFLEX INC	1,760	317.78	559,292.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,795	479.46	17,641,730.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,020	127.89	386,227.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,350	262.00	1,401,700.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,952	123.28	980,322.56
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,770	136.32	377,606.40
ABBVIE INC	69,066	127.29	8,791,411.14
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,700	151.88	1,776,996.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,740	185.73	880,360.20
AMGEN INC	22,141	213.74	4,732,417.34
AVANTOR INC	21,080	38.33	807,996.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	723.93	622,579.80
BIO-TECHNE CORP	1,480	462.88	685,062.40
BIOGEN INC	5,823	230.76	1,343,715.48
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	82.92	592,048.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,055	59.51	5,180,643.05
CATALENT INC	6,520	122.38	797,917.60

CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	353.56	675,299.60
DANAHER CORP	25,109	307.70	7,726,039.30
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	28.11	464,545.86
ELI LILLY & CO	31,754	249.38	7,918,812.52
EXACT SCIENCES CORP	6,990	76.59	535,364.10
GILEAD SCIENCES INC	48,454	70.52	3,416,976.08
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,280	102.54	849,031.20
ILLUMINA INC	5,665	386.38	2,188,842.70
INCYTE CORP	7,110	68.59	487,674.90
IQVIA HOLDINGS INC	7,453	262.65	1,957,530.45
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	120.78	269,339.40
JOHNSON & JOHNSON	102,531	170.29	17,460,003.99
MERCK & CO. INC.	98,693	73.72	7,275,647.96
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	895	1,542.92	1,380,913.40
MODERNA INC	13,435	277.16	3,723,644.60
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	82.71	300,237.30
NOVAVAX INC	2,600	168.43	437,918.00
PERKINELMER INC	4,360	182.19	794,348.40
PFIZER INC	218,670	55.54	12,144,931.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,060	670.97	2,724,138.20
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,990	37.55	525,324.50
SEAGEN INC	5,940	144.46	858,092.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.20	357,438.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,369	632.11	9,714,898.59
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,980	209.24	2,088,215.20
VIATRIS INC	48,469	12.81	620,887.89
WATERS CORP	2,336	342.04	799,005.44
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,920	428.69	1,251,774.80
ZOETIS INC	18,570	228.07	4,235,259.90
BANK OF AMERICA CORP	296,419	44.13	13,080,970.47
CITIGROUP INC	79,667	60.64	4,831,006.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,580	47.08	733,506.40
FIFTH THIRD BANCORP	27,119	43.12	1,169,371.28
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	203.61	1,374,367.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	56,330	15.21	856,779.30

JPMORGAN CHASE & CO	116,550	159.13	18,546,601.50
KEYCORP	38,038	22.76	865,744.88
M & T BANK CORP	5,223	149.42	780,420.66
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,460	198.81	3,272,412.60
REGIONS FINANCIAL CORP	37,044	21.83	808,670.52
SIGNATURE BANK	2,550	299.82	764,541.00
SVB FINANCIAL GROUP	2,155	676.68	1,458,245.40
TRUIST FINANCIAL CORP	51,850	58.66	3,041,521.00
US BANCORP	54,831	57.31	3,142,364.61
WELLS FARGO & CO	160,080	48.89	7,826,311.20
ALLY FINANCIAL INC	14,000	48.08	673,120.00
AMERICAN EXPRESS CO	26,304	162.85	4,283,606.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,670	292.24	1,364,760.80
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,220	68.53	494,786.60
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,292	56.78	1,833,539.76
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,735	295.03	15,263,377.05
BLACKROCK INC	5,955	902.38	5,373,672.90
BLACKSTONE INC	26,890	126.71	3,407,231.90
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,475	147.92	2,584,902.00
CARLYLE GROUP INC/THE	6,890	52.51	361,793.90
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	128.43	506,014.20
CME GROUP INC	14,100	227.55	3,208,455.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,620	255.86	414,493.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,120	115.53	1,400,223.60
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,610	32.13	501,549.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,460	461.89	674,359.40
FRANKLIN RESOURCES INC	12,475	33.73	420,781.75
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	41.55	74,790.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,193	388.82	5,129,702.26
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,120	133.81	2,959,877.20
INVESCO LTD	13,527	22.71	307,198.17
KKR & CO INC -A	20,050	73.04	1,464,452.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	395.42	561,496.40
MOODY'S CORP	6,482	391.94	2,540,555.08
MORGAN STANLEY	53,573	98.82	5,294,083.86

MSCI INC	3,175	591.07	1,876,647.25
NASDAQ INC	4,485	199.73	895,789.05
NORTHERN TRUST CORP	7,980	117.49	937,570.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,320	96.40	705,648.00
ROBINHOOD MARKETS INC - A	6,320	19.13	120,901.60
S&P GLOBAL INC	9,442	470.34	4,440,950.28
SCHWAB (CHARLES) CORP	56,673	80.79	4,578,611.67
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	61.82	284,681.10
SOFI TECHNOLOGIES INC	18,800	14.48	272,224.00
STATE STREET CORP	13,667	92.10	1,258,730.70
SYNCHRONY FINANCIAL	22,800	46.83	1,067,724.00
T ROWE PRICE GROUP INC	8,735	190.02	1,659,824.70
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,360	94.49	411,976.40
UPSTART HOLDINGS INC	660	144.95	95,667.00
AFLAC INC	25,144	57.16	1,437,231.04
ALLEGHANY CORP	500	675.92	337,960.00
ALLSTATE CORP	11,633	110.71	1,287,889.43
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	138.28	401,012.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,935	54.66	1,800,227.10
AON PLC	8,722	294.15	2,565,576.30
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,245	43.75	666,968.75
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,150	166.62	1,357,953.00
ASSURANT INC	2,300	153.51	353,073.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	5,510	78.56	432,865.60
BROWN & BROWN INC	9,690	66.96	648,842.40
CHUBB LTD	17,315	192.54	3,333,830.10
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,230	115.89	721,994.70
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,055	193.30	203,931.50
EVEREST RE GROUP LTD	1,384	269.71	373,278.64
FNF GROUP	10,841	50.50	547,470.50
GLOBE LIFE INC	3,246	91.80	297,982.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,892	68.05	945,350.60
LINCOLN NATIONAL CORP	7,533	66.41	500,266.53
LOEWS CORP	7,995	56.71	453,396.45
MARKEL CORP	525	1,236.34	649,078.50



MARSH & MCLENNAN COS	19,693	168.98	3,327,723.14
METLIFE INC	29,225	60.80	1,776,880.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,890	72.00	784,080.00
PROGRESSIVE CORP	22,550	97.14	2,190,507.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,222	107.06	1,629,667.32
TRAVELERS COS INC/THE	9,844	156.73	1,542,850.12
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,968	232.17	1,153,420.56
WR BERKLEY CORP	5,394	81.48	439,503.12
CBRE GROUP INC - A	13,200	102.85	1,357,620.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	5.44	267,648.00
ZILLOW GROUP INC - A	2,710	57.57	156,014.70
ZILLOW GROUP INC - C	5,760	58.73	338,284.80
ACCENTURE PLC-CL A	24,778	369.73	9,161,169.94
ADOBE INC	18,604	614.86	11,438,855.44
AFFIRM HOLDINGS INC	3,200	105.77	338,464.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,350	114.24	725,424.00
ANSYS INC	3,395	394.15	1,338,139.25
ASANA INC - CL A	2,400	64.92	155,808.00
AUTODESK INC	8,465	263.22	2,228,157.30
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,491	229.72	3,788,312.52
AVALARA INC	3,310	141.48	468,298.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,340	46.98	297,853.20
BILL.COM HOLDINGS INC	3,300	241.13	795,729.00
BLACK KNIGHT INC	6,530	76.50	499,545.00
BLOCK INC	15,590	170.72	2,661,524.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,630	177.48	821,732.40
CADENCE DESIGN SYS INC	10,730	176.06	1,889,123.80
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	102.56	541,516.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,320	111.75	482,760.00
CITRIX SYSTEMS INC	5,028	83.14	418,027.92
CLOUDFLARE INC-CLASS A	8,850	132.00	1,168,200.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,348	81.88	1,666,094.24
COUPA SOFTWARE INC	2,800	152.82	427,896.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,170	198.71	1,424,750.70
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,400	154.44	216,216.00

DATADOG INC-CLASS A	7,240	160.78	1,164,047.20
DOCUSIGN INC	7,340	144.46	1,060,336.40
DROPBOX INC-CLASS A	10,710	23.94	256,397.40
DYNATRACE INC	6,630	58.35	386,860.50
EPAM SYSTEMS INC	2,205	663.13	1,462,201.65
FAIR ISAAC CORP	1,055	407.77	430,197.35
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,008	106.83	2,564,774.64
FISERV INC	23,204	104.23	2,418,552.92
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,040	216.17	657,156.80
FORTINET INC	5,360	315.80	1,692,688.00
GARTNER INC	3,240	313.99	1,017,327.60
GLOBAL PAYMENTS INC	11,719	128.23	1,502,727.37
GODADDY INC-CLASS A	7,040	71.11	500,614.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	111.87	321,066.90
HUBSPOT INC	1,725	687.71	1,186,299.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	35,122	123.76	4,346,698.72
INTUIT INC	10,686	639.48	6,833,483.28
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	162.35	461,074.00
MASTERCARD INC	34,405	340.55	11,716,622.75
MICROSOFT CORP	278,304	328.34	91,378,335.36
MONGODB INC	2,200	478.55	1,052,810.00
NORTONLIFELOCK INC	22,205	24.27	538,915.35
NUANCE COMMUNICATIONS INC	11,050	55.06	608,413.00
OKTA INC	4,820	217.36	1,047,675.20
ORACLE CORP	65,583	99.89	6,551,085.87
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	64,520	18.64	1,202,652.80
PALO ALTO NETWORKS INC	3,770	512.50	1,932,125.00
PAYCHEX INC	12,572	122.43	1,539,189.96
PAYCOM SOFTWARE INC	1,995	405.12	808,214.40
PAYPAL HOLDINGS INC	43,627	186.80	8,149,523.60
PTC INC	4,410	117.31	517,337.10
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,990	185.58	554,884.20
SALESFORCE.COM INC	38,236	255.59	9,772,739.24
SERVICENOW INC	7,755	624.69	4,844,470.95
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,990	350.60	2,801,294.00

SPLUNK INC	6,310	109.35	689,998.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	78.44	664,386.80
SYNOPSYS INC	5,817	345.93	2,012,274.81
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,980	88.33	1,588,173.40
TWILIO INC - A	6,275	255.83	1,605,333.25
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,540	505.82	778,962.80
UNITY SOFTWARE INC	2,750	140.00	385,000.00
VERISIGN INC	3,900	238.07	928,473.00
VISA INC-CLASS A SHARES	65,892	209.98	13,836,002.16
VMWARE INC-CLASS A	7,697	110.44	850,056.68
WESTERN UNION CO	14,561	18.20	265,010.20
WIX.COM LTD	2,280	139.16	317,284.80
WORKDAY INC-CLASS A	7,280	273.35	1,989,988.00
ZENDESK INC	4,550	100.25	456,137.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,180	181.94	1,488,269.20
ZSCALER INC	3,120	284.34	887,140.80
AMPHENOL CORP-CL A	23,110	82.47	1,905,881.70
APPLE INC	644,534	174.33	112,361,612.22
ARISTA NETWORKS INC	8,720	131.12	1,143,366.40
ARROW ELECTRONICS INC	2,750	124.28	341,770.00
CDW CORP/DE	5,590	189.69	1,060,367.10
CISCO SYSTEMS INC	164,220	57.77	9,486,989.40
COGNEX CORP	7,020	75.39	529,237.80
CORNING INC	31,668	36.78	1,164,749.04
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	54.63	555,696.36
F5 INC	2,385	229.32	546,928.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,655	14.57	738,043.35
HP INC	47,315	35.60	1,684,414.00
IPG PHOTONICS CORP	1,310	168.52	220,761.20
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	33.52	424,463.76
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,230	197.99	1,431,467.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,675	259.53	1,732,362.75
NETAPP INC	9,126	86.84	792,501.84
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,924	102.44	811,734.56
TE CONNECTIVITY LTD	12,555	157.10	1,972,390.50

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	432.06	756,105.00
TRIMBLE INC	11,080	83.87	929,279.60
WESTERN DIGITAL CORP	12,428	55.63	691,369.64
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,085	585.86	1,221,518.10
AT&T INC	277,317	22.29	6,181,395.93
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,285	28.14	148,719.90
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,241	28.25	430,558.25
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	11.81	406,098.66
T-MOBILE US INC	24,149	117.31	2,832,919.19
VERIZON COMMUNICATIONS INC	160,457	50.65	8,127,147.05
AES CORP	26,088	23.61	615,937.68
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	59.54	491,800.40
AMEREN CORPORATION	10,412	87.19	907,822.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,868	85.13	1,691,362.84
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	179.30	1,202,206.50
ATMOS ENERGY CORP	4,880	97.14	474,043.20
CENTERPOINT ENERGY INC	22,262	27.82	619,328.84
CMS ENERGY CORP	12,240	63.47	776,872.80
CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	83.17	1,072,560.32
DOMINION ENERGY INC	31,511	76.60	2,413,742.60
DTE ENERGY COMPANY	8,018	117.46	941,794.28
DUKE ENERGY CORP	29,786	102.77	3,061,107.22
EDISON INTERNATIONAL	14,869	66.35	986,558.15
ENERGY CORP	8,517	107.29	913,788.93
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	50.76	466,484.40
EVERGY INC	8,720	67.18	585,809.60
EVERSOURCE ENERGY	13,430	89.26	1,198,761.80
EXELON CORP	37,706	53.85	2,030,468.10
FIRSTENERGY CORP	21,465	39.98	858,170.70
NEXTERA ENERGY INC	76,710	90.03	6,906,201.30
NISOURCE INC	15,050	26.21	394,460.50
NRG ENERGY INC	10,000	39.93	399,300.00
P G & E CORP	57,890	12.16	703,942.40
PPL CORP	29,828	28.83	859,941.24
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,888	64.53	1,218,842.64

	SEMPRA ENERGY	12,237	126.15	1,543,697.55	
	SOUTHERN CO	40,925	65.97	2,699,822.25	
	UGI CORP	7,720	44.77	345,624.40	
	VISTRA CORP	18,240	20.77	378,844.80	
	WEC ENERGY GROUP INC	12,040	94.76	1,140,910.40	
	XCEL ENERGY INC	20,004	67.39	1,348,069.56	
	ADVANCED MICRO DEVICES	47,410	135.60	6,428,796.00	
	ANALOG DEVICES INC	20,847	176.28	3,674,909.16	
	APPLIED MATERIALS INC	35,293	147.73	5,213,834.89	
	BROADCOM INC	16,030	614.91	9,857,007.30	
	ENPHASE ENERGY INC	4,930	202.32	997,437.60	
	ENTEGRIS INC	5,050	143.22	723,261.00	
	INTEL CORP	158,562	49.70	7,880,531.40	
	KLA CORP	5,899	399.46	2,356,414.54	
	LAM RESEARCH CORP	5,567	679.21	3,781,162.07	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	30,984	85.29	2,642,625.36	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,668	84.89	1,754,506.52	
	MICRON TECHNOLOGY INC	44,137	83.29	3,676,170.73	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	477.92	814,853.60	
	NVIDIA CORP	97,500	283.37	27,628,575.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,667	219.99	2,346,633.33	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,640	62.98	1,047,987.20	
	QORVO INC	4,600	152.47	701,362.00	
	QUALCOMM INC	44,082	181.98	8,022,042.36	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,210	159.38	989,749.80	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,005	298.30	598,091.50	
	TERADYNE INC	6,540	155.94	1,019,847.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	36,092	190.27	6,867,224.84	
	XILINX INC	9,455	209.81	1,983,753.55	
	米ドル小計	12,335,308		1,593,271,078.65	(181,314,248,750)
加ドル	CAMECO CORP	14,272	27.25	388,912.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	45,954	50.75	2,332,165.50	
	CENOVUS ENERGY INC	51,763	15.14	783,691.82	
	ENBRIDGE INC	78,467	48.04	3,769,554.68	

IMPERIAL OIL LTD	9,622	42.50	408,935.00
KEYERA CORP	8,460	27.66	234,003.60
PARKLAND CORP	6,170	33.85	208,854.50
PEMBINA PIPELINE CORP	22,402	37.55	841,195.10
SUNCOR ENERGY INC	58,609	30.17	1,768,233.53
TC ENERGY CORP	38,733	58.65	2,271,690.45
TOURMALINE OIL CORP	11,250	39.74	447,075.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	9,775	63.37	619,441.75
BARRICK GOLD CORP	66,724	22.96	1,531,983.04
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	63.31	364,032.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	28.10	636,465.00
FRANCO-NEVADA CORP	7,635	168.30	1,284,970.50
IVANHOE MINES LTD-CL A	21,000	10.27	215,670.00
KINROSS GOLD CORP	46,025	6.53	300,543.25
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	10,600	50.12	531,272.00
LUNDIN MINING CORP	29,840	10.90	325,256.00
NUTRIEN LTD	21,648	89.13	1,929,486.24
PAN AMERICAN SILVER CORP	8,780	28.69	251,898.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	34.58	621,575.50
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,700	111.08	410,996.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,665	51.53	910,277.45
BALLARD POWER SYSTEMS INC	8,330	15.89	132,363.70
CAE INC	13,775	29.99	413,112.25
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,710	109.64	406,764.40
WSP GLOBAL INC	4,030	178.63	719,878.90
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	5,730	46.39	265,814.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	81.92	330,956.80
THOMSON REUTERS CORP	6,546	151.45	991,391.70
AIR CANADA	7,190	20.94	150,558.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,538	161.63	4,450,966.94
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,835	93.54	2,416,605.90
TFI INTERNATIONAL INC	3,010	130.96	394,189.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,858	99.07	1,174,772.06
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,800	51.71	455,048.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,318	74.18	913,749.24

QUEBECOR INC -CL B	6,110	27.77	169,674.70
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	37.29	651,269.85
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	177.95	350,561.50
DOLLARAMA INC	11,780	59.22	697,611.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-A	32,680	48.30	1,578,444.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	37.90	263,405.00
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	100.86	555,637.74
METRO INC	10,970	65.27	716,011.90
WESTON (GEORGE) LTD	3,358	144.41	484,928.78
SAPUTO INC	9,620	28.54	274,554.80
BAUSCH HEALTH COS INC	12,684	31.47	399,165.48
CANOPY GROWTH CORP	9,140	11.75	107,395.00
BANK OF MONTREAL	24,181	138.62	3,351,970.22
BANK OF NOVA SCOTIA	47,709	86.15	4,110,130.35
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	17,915	142.36	2,550,379.40
NATIONAL BANK OF CANADA	12,680	96.36	1,221,844.80
ROYAL BANK OF CANADA	55,759	128.62	7,171,722.58
TORONTO-DOMINION BANK	71,340	94.75	6,759,465.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	55,399	74.08	4,103,957.92
IGM FINANCIAL INC	3,335	46.44	154,877.40
ONEX CORPORATION	2,765	94.91	262,426.15
TMX GROUP LTD	1,810	125.00	226,250.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,110	574.05	637,195.50
GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	37.88	337,283.52
IA FINANCIAL CORP INC	3,895	70.21	273,467.95
INTACT FINANCIAL CORP	6,995	158.90	1,111,505.50
MANULIFE FINANCIAL CORP	77,041	23.88	1,839,739.08
POWER CORP OF CANADA	23,289	42.23	983,494.47
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,214	69.26	1,607,801.64
FIRSTSERVICE CORP	1,770	243.51	431,012.70
BLACKBERRY LTD	22,208	11.06	245,620.48
CGI INC	8,930	107.74	962,118.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	780	2,200.00	1,716,000.00
LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	53.42	234,513.80
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	67.92	152,820.00

	OPEN TEXT CORP	10,940	59.64	652,461.60
	SHOPIFY INC - CLASS-A	4,425	1,740.47	7,701,579.75
	BCE INC	3,000	64.53	193,590.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,575	58.01	671,465.75
	TELUS CORP	12,662	29.23	370,110.26
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	17.56	475,524.80
	ALTAGAS LTD	9,000	25.50	229,500.00
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	43.45	236,585.25
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.50	161,880.00
	EMERA INC	12,380	61.10	756,418.00
	FORTIS INC	19,615	59.75	1,171,996.25
	HYDRO ONE LTD	11,790	31.50	371,385.00
	NORTHLAND POWER INC	8,600	36.62	314,932.00
加ドル小計		1,525,156		96,606,037.07 (8,553,498,522)
ユーロ	DAIMLER TRUCK HOLDING AG(N)	16,606	32.90	546,337.40
	ENI SPA	96,856	12.14	1,176,606.68
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,295	8.35	177,855.84
	NESTE OYJ	16,390	42.48	696,247.20
	OMV AG	5,480	49.12	269,177.60
	REPSOL SA	57,649	9.99	576,144.10
	TENARIS SA	19,915	9.13	181,903.61
	TOTALENERGIES SE	98,237	43.73	4,295,904.01
	AIR LIQUIDE SA	18,340	152.92	2,804,552.80
	AKZO NOBEL	7,367	93.60	689,551.20
	ARCELORMITTAL	27,632	27.72	765,959.04
	ARKEMA	2,205	118.10	260,410.50
	BASF SE	35,355	59.57	2,106,097.35
	COVESTRO AG	7,410	51.46	381,318.60
	CRH PLC	29,850	44.71	1,334,593.50
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,540	27.64	236,045.60
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	2,900	38.76	112,404.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	59.02	337,299.30
	KONINKLIJKE DSM NV	7,322	194.90	1,427,057.80
	LANXESS AG	3,115	51.74	161,170.10



SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,460	45.85	387,891.00
SOLVAY SA	3,231	99.08	320,127.48
STORA ENSO OYJ-R SHS	26,075	15.21	396,731.12
SYMRISE AG	5,370	129.05	692,998.50
UMICORE	7,960	35.60	283,376.00
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	32.13	628,719.84
VOESTALPINE AG	4,249	31.16	132,398.84
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,486	21.30	223,351.80
AIRBUS GROUP SE	23,698	102.50	2,429,045.00
ALSTOM	11,635	30.17	351,027.95
BOUYGUES SA	9,460	29.87	282,570.20
BRENTAG SE	6,075	75.98	461,578.50
CNH INDUSTRIAL NV	40,060	15.41	617,324.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,596	58.03	1,137,155.88
DASSAULT AVIATION SA	900	88.85	79,965.00
EIFFAGE	3,250	83.88	272,610.00
FERROVIAL SA	18,485	25.71	475,249.35
GEA GROUP AG	6,680	46.37	309,751.60
IMCD NV	2,090	192.25	401,802.50
KINGSPAN GROUP PLC	6,260	99.04	619,990.40
KION GROUP AG	3,514	95.78	336,570.92
KNORR-BREMSE AG	2,970	85.98	255,360.60
KONE OYJ-B	13,654	60.86	830,982.44
LEGRAND SA	10,528	99.66	1,049,220.48
MTU AERO ENGINES AG	2,020	168.00	339,360.00
PRYSMIAN SPA	9,565	31.95	305,601.75
RATIONAL AG	230	812.60	186,898.00
SAFRAN SA	13,280	100.56	1,335,436.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,198	162.76	3,450,186.48
SIEMENS AG-REG	29,956	147.32	4,413,117.92
SIEMENS ENERGY AG	15,843	21.94	347,595.42
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	10,210	20.72	211,551.20
THALES SA	3,745	71.78	268,816.10
VINCI SA	20,460	84.76	1,734,189.60
WARTSILA OYJ ABP	21,180	11.67	247,170.60

BUREAU VERITAS SA	10,920	28.19	307,834.80
RANDSTAD NV	4,965	56.38	279,926.70
TELEPERFORMANCE	2,330	369.00	859,770.00
WOLTERS KLUWER	10,377	101.60	1,054,303.20
ADP	1,090	105.05	114,504.50
AENA SA	2,870	129.40	371,378.00
ATLANTIA SPA	18,740	16.96	317,924.10
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	5.86	140,008.44
DEUTSCHE POST AG-REG	38,353	53.14	2,038,078.42
GETLINK	14,730	13.77	202,905.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,235	88.40	1,169,974.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,720	72.50	124,700.00
CONTINENTAL AG	4,385	93.80	411,313.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	33,212	71.47	2,373,661.64
FAURECIA	4,256	39.15	166,622.40
FERRARI NV	4,944	225.00	1,112,400.00
MICHELIN (CGDE)-B	6,669	139.20	928,324.80
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	86.98	493,176.60
RENAULT SA	6,837	29.02	198,409.74
STELLANTIS NV	75,346	16.27	1,225,879.42
VALEO SA	8,060	26.79	215,927.40
VOLKSWAGEN AG	1,261	272.00	342,992.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,183	181.62	1,304,576.46
ADIDAS AG	7,331	248.65	1,822,853.15
ESSILORLUXOTTICA	11,115	180.12	2,002,033.80
HERMES INTERNATIONAL	1,232	1,560.00	1,921,920.00
KERING	2,892	690.00	1,995,480.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,849	701.60	7,611,658.40
MONCLER SPA	8,080	63.08	509,686.40
PUMA SE	4,200	103.10	433,020.00
SEB SA	847	136.20	115,361.40
ACCOR SA	7,646	26.12	199,713.52
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,706	125.35	840,597.10
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	37.30	145,470.00
SODEXO	4,090	75.70	309,613.00

BOLLORE	33,530	4.45	149,208.50
PUBLICIS GROUPE	8,645	56.98	492,592.10
SCOUT24 SE	3,880	60.00	232,800.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	41.11	144,296.10
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	24.37	675,780.10
VIVENDI SE	27,730	11.21	310,853.30
DELIVERY HERO SE	7,050	96.96	683,568.00
INDITEX	42,185	28.94	1,220,833.90
JUST EAT TAKEAWAY	8,620	46.88	404,105.60
PROSUS	36,130	69.54	2,512,480.20
ZALANDO SE	8,260	71.10	587,286.00
CARREFOUR SA	24,723	16.06	397,174.99
COLRUYT SA	2,305	39.99	92,176.95
HELLOFRESH SE	6,070	70.42	427,449.40
JERONIMO MARTINS	9,035	20.23	182,778.05
KESKO OYJ-B SHS	10,930	28.93	316,204.90
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,038	30.24	1,240,989.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	29,501	51.55	1,520,776.55
DANONE	25,254	53.16	1,342,502.64
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,980	12.74	292,880.10
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	77.00	309,925.00
HEINEKEN NV	10,113	92.60	936,463.80
JDE PEET'S NV	4,010	25.90	103,859.00
KERRY GROUP PLC-A	5,880	113.30	666,204.00
PERNOD-RICARD SA	8,076	208.20	1,681,423.20
REMY COINTREAU	810	204.00	165,240.00
BEIERSDORF AG	3,805	91.80	349,299.00
HENKEL AG & CO KGAA	4,490	68.10	305,769.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	70.90	454,681.70
L'OREAL	9,831	415.20	4,081,831.20
AMPLIFON SPA	5,620	42.77	240,367.40
BIOMERIEUX	2,020	124.45	251,389.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	177.30	285,453.00
DIASORIN SPA	930	176.30	163,959.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,273	54.46	450,547.58

FRESENIUS SE & CO KGAA	16,655	33.98	565,936.90
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,020	30.72	1,106,714.50
ORPEA	1,790	85.00	152,150.00
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,020	556.40	567,528.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,230	65.56	736,238.80
ARGENX SE	1,840	264.20	486,128.00
BAYER AG-REG	36,384	46.40	1,688,399.52
EUROFINS SCIENTIFIC	5,460	101.98	556,810.80
GRIFOLS SA	9,910	16.03	158,857.30
IPSEN	1,350	90.30	121,905.00
MERCK KGAA	4,950	221.90	1,098,405.00
ORION OYJ-CLASS B	4,010	34.45	138,144.50
QIAGEN N.V.	9,614	48.02	461,664.28
RECORDATI SPA	3,920	53.46	209,563.20
SANOFI	44,546	85.48	3,807,792.08
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	447.70	483,516.00
UCB SA	4,928	97.06	478,311.68
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,930	12.86	243,591.24
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,873	5.12	1,335,669.76
BANCO SANTANDER SA	666,649	2.68	1,790,952.53
BNP PARIBAS	43,402	56.09	2,434,418.18
CAIXABANK S.A	163,050	2.33	380,395.65
COMMERZBANK AG	38,844	6.57	255,282.76
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	12.22	498,111.69
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	39.50	452,591.00
FINECOBANK SPA	26,120	15.69	409,953.40
ING GROEP NV-CVA	151,675	12.12	1,839,211.05
INTESA SANPAOLO	643,893	2.22	1,432,339.97
KBC GROEP NV	9,719	74.74	726,398.06
MEDIOBANCA SPA	29,630	9.98	295,707.40
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,370	25.04	134,464.80
SOCIETE GENERALE	31,389	28.93	908,083.77
UNICREDIT SPA	83,846	13.37	1,121,691.78
AMUNDI SA	2,140	69.50	148,730.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,855	10.93	894,675.15

DEUTSCHE BOERSE AG	7,250	137.50	996,875.00
EURAZEO SE	1,877	73.50	137,959.50
EURONEXT NV	3,080	85.30	262,724.00
EXOR NV	4,504	76.78	345,817.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	94.90	385,483.80
SOFINA	750	420.60	315,450.00
WENDEL	1,000	98.30	98,300.00
AEGON NV	77,949	4.04	315,459.60
AGEAS	6,794	44.33	301,178.02
ALLIANZ SE-REG	16,168	201.20	3,253,001.60
ASSICURAZIONI GENERALI	44,788	18.45	826,338.60
AXA SA	74,212	25.43	1,887,582.22
CNP ASSURANCES	6,040	21.63	130,645.20
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	161.75	367,981.25
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,376	247.75	1,331,904.00
NN GROUP NV	9,940	45.56	452,866.40
POSTE ITALIANE SPA	19,560	11.08	216,724.80
SAMPO OYJ-A SHS	19,559	43.15	843,970.85
AROUNDTOWN SA	33,520	5.31	178,259.36
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	121.80	300,846.00
VONOVIA SE	28,579	49.30	1,408,944.70
VONOVIA SE-RTS	2	3.20	6.40
ADYEN NV	765	2,305.00	1,763,325.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	55.42	947,127.80
BECHTLE AG	3,690	61.02	225,163.80
CAP GEMINI SA	6,109	201.20	1,229,130.80
DASSAULT SYSTEMES SE	25,890	51.55	1,334,629.50
EDENRED	9,626	38.61	371,659.86
NEMETSCHEK SE	2,810	105.45	296,314.50
NEXI SPA	17,180	13.87	238,286.60
SAP SE	40,872	119.96	4,903,005.12
WORLDLINE SA	8,950	47.08	421,410.75
NOKIA OYJ	208,086	5.27	1,098,485.99
CELLNEX TELECOM SA	19,640	52.94	1,039,741.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	129,336	16.15	2,089,293.74

ELISA OYJ	5,465	53.78	293,907.70	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.26	155,720.05	
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	2.62	345,728.96	
ORANGE S.A.	76,994	9.19	707,574.86	
PROXIMUS	5,600	16.76	93,884.00	
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.44	177,106.84	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.37	77,246.13	
TELEFONICA SA	202,139	3.85	779,245.84	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	34.01	136,040.00	
E.ON SE	86,389	11.41	986,044.04	
EDF	16,905	11.90	201,169.50	
EDP RENOVAVEIS SA	10,400	20.90	217,360.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	113,771	4.72	537,454.20	
ELIA GROUP SA/NV	960	112.40	107,904.00	
ENAGAS SA	8,240	20.61	169,826.40	
ENDESA SA	14,590	19.51	284,650.90	
ENEL SPA	315,597	6.62	2,091,145.72	
ENGIE	70,164	12.87	903,571.99	
FORTUM OYJ	16,415	26.46	434,340.90	
IBERDROLA SA	228,062	9.75	2,223,604.50	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,072	25.49	231,245.28	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,220	18.59	357,395.90	
RWE AG	24,615	34.31	844,540.65	
SNAM SPA	79,380	5.12	406,425.60	
SUEZ	13,289	19.79	262,989.31	
TERNA SPA	67,757	6.81	461,560.68	
UNIPER SE	3,530	40.14	141,694.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,600	30.76	756,696.00	
VERBUND AG	2,780	95.30	264,934.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,840	356.70	656,328.00	
ASML HOLDING NV	16,132	661.00	10,663,252.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	50,535	38.70	1,955,704.50	
STMICROELECTRONICS NV	26,093	41.71	1,088,339.03	
ユーロ小計	7,183,437		189,138,365.53 (24,253,212,611)	

英bond	BP PLC	788,618	3.37	2,662,768.67
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	160,848	16.19	2,604,772.51
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	144,549	16.19	2,340,826.50
	ANGLO AMERICAN PLC	49,514	28.98	1,434,915.72
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	13.82	198,112.25
	BHP GROUP PLC	81,061	21.68	1,757,402.48
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,521	101.15	558,449.15
	EVRAZ PLC	21,700	6.06	131,632.20
	GLENCORE PLC	385,213	3.67	1,413,731.71
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,589	19.81	130,528.09
	MONDI PLC	18,370	17.73	325,700.10
	RIO TINTO PLC	43,185	48.54	2,096,199.90
	ASHTED GROUP PLC	17,360	60.04	1,042,294.40
	BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	5.39	652,512.88
	BUNZL PLC	13,836	28.89	399,722.04
	DCC PLC	3,820	55.06	210,329.20
	FERGUSON PLC	8,572	124.15	1,064,213.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.44	235,901.97
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	1.17	376,055.71
	SMITHS GROUP PLC	15,443	14.80	228,556.40
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	154.45	401,570.00
	EXPERIAN PLC	35,428	35.07	1,242,459.96
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	55.84	336,436.00
	RELX PLC	74,005	23.57	1,744,297.85
	RENTOKIL INITIAL PLC	73,630	5.47	403,197.88
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	7.29	296,848.80
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	46.75	211,076.25
	BURBERRY GROUP PLC	14,144	17.49	247,449.28
	PERSIMMON PLC	13,570	27.93	379,010.10
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.66	206,858.03
	COMPASS GROUP PLC	69,398	15.29	1,061,095.42
	ENTAIN PLC	21,400	15.88	339,939.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,893	44.79	353,527.47	
WHITBREAD PLC	8,260	28.14	232,436.40	
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	7.12	260,029.44	

INFORMA PLC	56,580	4.92	278,656.50
PEARSON PLC	26,259	5.83	153,142.48
WPP PLC	50,104	10.92	547,135.68
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	2.11	205,408.50
KINGFISHER PLC	88,337	3.38	299,374.09
NEXT PLC	5,467	80.54	440,312.18
OCADO GROUP PLC	20,060	16.78	336,606.80
SAINSBURY (J) PLC	59,501	2.75	163,806.25
TESCO PLC	304,518	2.84	867,115.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	14,945	19.51	291,576.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,407	27.02	2,281,099.17
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	24.59	189,097.10
DIAGEO PLC	91,402	39.27	3,589,813.55
IMPERIAL BRANDS PLC	37,492	15.77	591,436.30
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	27,545	61.95	1,706,412.75
UNILEVER PLC	100,962	40.21	4,060,186.83
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	35,006	12.10	423,747.63
ASTRAZENECA PLC	60,572	82.28	4,983,864.16
GLAXOSMITHKLINE PLC	197,191	15.98	3,151,112.18
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	22.04	169,487.60
BARCLAYS PLC	654,151	1.80	1,177,995.12
HSBC HOLDINGS PLC	800,061	4.34	3,477,865.16
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,737,436	0.45	1,237,047.32
NATWEST GROUP PLC	207,830	2.18	453,485.06
STANDARD CHARTERED PLC	104,230	4.20	437,974.46
3I GROUP PLC	36,819	13.89	511,600.00
ABRDN PLC	88,515	2.35	208,718.37
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	13.17	171,538.50
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,727	67.70	861,617.90
M&G PLC	99,522	1.93	192,127.22
SCHRODERS PLC	4,131	34.16	141,114.96
ST JAMES'S PLACE PLC	19,260	15.79	304,211.70
ADMIRAL GROUP PLC	9,405	30.74	289,109.70
AVIVA PLC	158,565	3.95	626,648.88



	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	237,501	2.88	685,902.88	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	6.40	158,784.00	
	PRUDENTIAL PLC	100,122	12.77	1,279,058.55	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	32.32	145,924.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	42,810	8.04	344,363.64	
	HALMA PLC	14,690	30.81	452,598.90	
	BT GROUP PLC	355,852	1.67	595,518.32	
	VODAFONE GROUP PLC	1,097,428	1.14	1,253,482.26	
	NATIONAL GRID PLC	137,318	10.55	1,449,254.17	
	SEVERN TRENT PLC	10,343	29.09	300,877.87	
	SSE PLC	39,837	15.88	632,611.56	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	11.13	290,548.65	
英債券小計		11,333,876		69,990,229.21	(10,539,828,616)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	18.37	139,098.75	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	977.50	263,925.00	
	GIVAUDAN-REG	363	4,718.00	1,712,634.00	
	HOLCIM LTD	20,559	44.89	922,893.51	
	SIKA AG-REG	5,550	369.60	2,051,280.00	
	ABB LTD-REG	67,405	33.39	2,250,652.95	
	GEBERIT AG-REG	1,455	718.60	1,045,563.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	980	237.00	232,260.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	240.40	355,792.00	
	VAT GROUP AG	990	430.60	426,294.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,477	44.10	241,535.70	
	SGS SA-REG	248	2,959.00	733,832.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	276.50	550,235.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,209	136.30	2,754,486.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,000	271.30	271,300.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	51.85	95,922.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	125	2,172.00	271,500.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	11,570.00	509,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	114,200.00	456,800.00	
	NESTLE SA-REG	110,460	124.02	13,699,249.20	
	ALCON INC	18,824	76.24	1,435,141.76	

	SONOVA HOLDING AG-REG	2,141	333.50	714,023.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	405	1,941.00	786,105.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	210	615.00	129,150.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,898	725.20	2,101,629.60	
	NOVARTIS AG-REG	85,203	74.71	6,365,516.13	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,230	395.40	486,342.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,443	365.45	10,029,044.35	
	VIFOR PHARMA AG	1,940	158.00	306,520.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	99,708	8.73	870,650.25	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,170	58.62	478,925.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	1,446.50	1,272,920.00	
	UBS GROUP AG-REG	142,382	16.38	2,332,217.16	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,630	141.70	230,971.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,180	544.20	642,156.00	
	SWISS RE AG	11,829	87.64	1,036,693.56	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,611	384.00	2,154,624.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	87.35	222,829.85	
	TEMENOS AG	2,640	123.35	325,644.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	75.08	500,032.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,094	512.80	561,003.20	
	スイスフラン小計	672,658		61,966,473.87 (7,634,889,245)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,540	364.80	3,115,392.00	
	BOLIDEN AB	10,890	337.10	3,671,019.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,310	153.10	3,415,661.00	
	ALFA LAVAL AB	10,550	345.80	3,648,190.00	
	ASSA ABLOY AB-B	38,560	262.20	10,110,432.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,725	578.20	14,874,195.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,390	490.70	7,551,873.00	
	EPIROC AB-A	26,075	220.90	5,759,967.50	
	EPIROC AB-B	15,450	184.25	2,846,662.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	138.05	2,070,750.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	329.10	2,237,880.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,210	251.20	2,062,352.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,100	124.60	6,990,060.00	

	SANDVIK AB	45,770	232.80	10,655,256.00	
	SKANSKA AB-B SHS	11,410	220.20	2,512,482.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	201.70	2,839,734.30	
	VOLVO AB-A SHS	7,120	197.30	1,404,776.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	57,670	196.92	11,356,376.40	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	123.50	1,806,681.50	
	ELECTROLUX AB-B	8,095	207.40	1,678,903.00	
	EVOLUTION AB	6,580	1,110.00	7,303,800.00	
	EMBRACER GROUP AB	18,620	90.40	1,683,248.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	30,138	168.00	5,063,184.00	
	SWEDISH MATCH AB	63,200	70.36	4,446,752.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,875	291.00	7,820,625.00	
	GETINGE AB-B SHS	8,310	380.30	3,160,293.00	
	NORDEA BANK ABP	128,442	107.08	13,753,569.36	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	127.10	7,937,395.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	47,710	93.12	4,442,755.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	36,220	179.08	6,486,277.60	
	EQT AB	10,680	486.70	5,197,956.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	280.80	1,399,507.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	277.40	1,658,852.00	
	INVESTOR AB-A SHS	18,250	225.50	4,115,375.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	215.20	14,924,120.00	
	KINNEVIK AB - B	10,215	301.60	3,080,844.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,370	481.90	1,142,103.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,570	624.00	2,851,680.00	
	SAGAX AB-B	5,630	294.20	1,656,346.00	
	SINCH AB	18,850	101.90	1,920,815.00	
	ERICSSON LM-B SHS	115,425	95.04	10,969,992.00	
	HEXAGON AB-B SHS	78,890	131.65	10,385,868.50	
	TELE2 AB-B SHS	18,705	127.35	2,382,081.75	
	TELIA CO AB	94,230	35.11	3,308,886.45	
	スウェーデンクローナ小計	1,305,047		227,700,969.26	(2,834,877,067)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	4,180	301.00	1,258,180.00	
	EQUINOR ASA	37,444	233.35	8,737,557.40	

	NORSK HYDRO A S	53,840	64.30	3,461,912.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,660	443.00	3,393,380.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	116.45	1,327,530.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,830	290.40	1,112,232.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,420	336.30	813,846.00	
	MOWI ASA	19,850	205.20	4,073,220.00	
	ORKLA ASA	32,010	86.36	2,764,383.60	
	DNB BANK ASA	37,545	195.35	7,334,415.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,810	209.80	1,428,738.00	
	TELENOR ASA	23,915	134.70	3,221,350.50	
ノルウェークローネ小計		240,904		38,926,745.25	(486,584,315)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	505.00	1,939,200.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	521.20	4,125,298.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	385	2,768.00	1,065,680.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	39,180	193.55	7,583,289.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	140	19,510.00	2,731,400.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	208	21,010.00	4,370,080.00	
	DSV A/S	7,650	1,404.00	10,740,600.00	
	PANDORA A/S	4,080	808.80	3,299,904.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	1,080.00	4,266,000.00	
	AMBU A/S-B	6,780	170.45	1,155,651.00	
	COLOPLAST-B	5,305	1,056.00	5,602,080.00	
	DEMANT A/S	4,410	308.10	1,358,721.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	374.70	1,862,259.00	
	GENMAB A/S	2,560	2,390.00	6,118,400.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	65,835	743.00	48,915,405.00	
	DANSKE BANK A/S	29,935	110.40	3,304,824.00	
	TRYG A/S	15,435	161.35	2,490,437.25	
ORSTED A/S	7,340	808.20	5,932,188.00		
デンマーククローネ小計		209,918		116,861,416.25	(2,014,690,816)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	28.31	248,420.25	
	SANTOS LTD	65,495	6.53	427,682.35	
	SANTOS LTD(N)	48,695	6.53	317,978.35	

WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,550	31.72	334,646.00
WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,333	22.23	852,142.59
BHP GROUP LTD	114,106	41.28	4,710,295.68
BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	21.94	401,721.40
EVOLUTION MINING LTD	69,000	4.01	276,690.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,085	18.70	1,235,789.50
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	17,805	56.43	1,004,736.15
NEWCREST MINING LTD	30,209	23.25	702,359.25
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	9.18	387,304.20
ORICA LIMITED	12,135	13.75	166,856.25
RIO TINTO LTD	14,138	98.10	1,386,937.80
SOUTH32 LTD	205,747	3.81	783,896.07
REECE LTD	10,200	25.23	257,346.00
BRAMBLES LTD	62,498	10.64	664,978.72
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.35	246,459.50
QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.90	215,600.00
SYDNEY AIRPORT	47,076	8.55	402,499.80
TRANSURBAN GROUP	118,936	13.75	1,635,370.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,290	44.24	1,118,829.60
CROWN RESORTS LTD	11,395	11.33	129,105.35
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	120.40	256,452.00
IDP EDUCATION LTD	7,220	35.78	258,331.60
TABCORP HOLDINGS LTD	70,974	5.02	356,289.48
REA GROUP LTD	1,820	169.26	308,053.20
SEEK LTD	10,700	35.20	376,640.00
WESFARMERS LTD	45,475	58.41	2,656,194.75
COLES GROUP LTD	52,085	17.38	905,237.30
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	6.63	334,563.06
WOOLWORTHS GROUP LTD	50,462	37.45	1,889,801.90
TREASURY WINE ESTATES LTD	25,746	12.21	314,358.66
COCHLEAR LTD	2,917	215.35	628,175.95
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,305	69.57	438,638.85
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	44.25	781,455.00
CSL LTD	17,842	297.27	5,303,891.34
AUST AND NZ BANKING GROUP	105,769	27.48	2,906,532.12

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	69,477	97.54	6,776,786.58	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	129,523	28.46	3,686,224.58	
	WESTPAC BANKING CORP	144,571	20.93	3,025,871.03	
	ASX LTD	7,925	91.40	724,345.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	13,374	204.14	2,730,168.36	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,820	29.89	144,069.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.34	412,842.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	92,560	3.45	319,332.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	59,550	11.67	694,948.50	
	SUNCORP GROUP LTD	57,276	10.80	618,580.80	
	AFTERPAY LTD	8,240	90.83	748,439.20	
	COMPUTERSHARE LTD	26,480	19.74	522,715.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,130	55.95	287,023.50	
	XERO LTD	5,480	142.52	781,009.60	
	TELSTRA CORPORATION LTD	182,084	4.11	748,365.24	
	APA GROUP	45,818	9.82	449,932.76	
	AUSNET SERVICES	72,810	2.52	183,481.20	
	ORIGIN ENERGY LTD	79,020	5.03	397,470.60	
豪ドル小計		2,721,368		58,873,866.47	(4,764,073,274)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,515	7.71	435,730.65	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,200	32.80	695,360.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,800	12.45	234,060.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.45	340,767.65	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.18	126,072.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	4.60	211,508.00	
ニュージーランドドル小計		239,472		2,043,498.30	(156,695,449)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,208	49.80	5,538,158.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	163.50	8,583,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	82,000	19.22	1,576,040.00	
	MTR CORP	57,500	40.90	2,351,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	30.55	1,588,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	92,000	39.60	3,643,200.00	
	SANDS CHINA LTD	111,400	17.18	1,913,852.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	20.30	1,378,370.00	
	WH GROUP LTD	339,394	4.88	1,656,242.72	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	150,000	24.50	3,675,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	142.60	4,149,660.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,300	462.80	21,427,640.00	
	AIA GROUP LTD	473,590	79.95	37,863,520.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	45.90	3,536,044.20	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	26.40	2,001,120.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	15.62	1,218,360.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	32.95	1,907,837.95	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,666	30.55	2,219,946.30	
	SINO LAND CO	143,050	9.55	1,366,127.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,980	94.60	5,011,908.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	42.85	750,603.45	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	18.82	782,912.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	40.15	2,561,570.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.54	1,581,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	46.80	1,170,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	75.85	4,513,075.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.62	723,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	384,237	11.72	4,503,257.64	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	47.75	2,626,250.00	
香港ドル小計		3,113,981		131,819,695.66	(1,923,249,359)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	5.18	276,404.80	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,900	3.75	194,625.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	4.93	265,727.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.78	164,658.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.17	308,413.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,715	31.84	2,283,405.60	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	137,740	11.32	1,559,216.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	26.64	1,113,552.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,700	9.39	278,883.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,500	3.45	408,825.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.10	122,830.00	

	UOL GROUP LTD	15,550	7.15	111,182.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.57	183,843.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	339,180	2.42	820,815.60	
シンガポールドル小計		1,225,605		8,092,381.50 (672,395,978)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	29.53	770,437.70	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,200	538.90	646,680.00	
	BANK HAPOALIM BM	45,535	30.20	1,375,157.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	30.65	1,747,203.25	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	40,300	19.67	792,701.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	113.90	558,110.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,340	287.00	384,580.00	
	NICE LTD	2,440	921.20	2,247,728.00	
イスラエルシュケル小計		178,810		8,522,596.95 (309,190,442)	
合 計		42,285,540		245,457,434,444 (245,457,434,444)	

(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	290,584.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	1,110,827.60	
		AMERICAN TOWER CORP	17,824	4,873,259.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,650	457,732.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	1,312,790.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,977	683,051.56	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	700,818.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	16,970	3,307,453.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,095	1,855,527.80	
		DUKE REALTY CORPORATION	14,585	906,311.90	
		EQUINIX INC	3,463	2,790,589.29	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	523,782.00	



		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	14,290	1,244,087.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	857,385.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	1,071,873.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	692,953.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	436,766.53	
		INVITATION HOMES INC	22,810	961,213.40	
		IRON MOUNTAIN INC	11,725	566,317.50	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	436,170.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	923,525.00	
		PROLOGIS INC	28,678	4,552,058.94	
		PUBLIC STORAGE	6,119	2,155,662.51	
		REALTY INCOME CORP	20,861	1,403,736.69	
		REGENCY CENTERS CORP	6,695	481,102.70	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,250	1,544,875.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,704	1,917,414.72	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	856,990.80	
		UDR INC	13,500	790,965.00	
		VENTAS INC	14,825	707,449.00	
		VICI PROPERTIES INC	21,340	590,051.00	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	279,794.84	
		WELLTOWER INC	16,230	1,333,943.70	
		WEYERHAEUSER CO	28,918	1,124,621.02	
		WP CAREY INC	8,640	682,300.80	
米ドル小計			488,959	44,423,987.99	(5,055,449,833)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	159,516.00	
加ドル小計			2,800	159,516.00	(14,123,546)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	133,017.50	
		GECINA SA	1,950	229,905.00	
		KLEPIERRE	9,902	192,049.29	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,940	290,817.80	
ユーロ小計			18,717	845,789.59	(108,455,599)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	190,304.22	

		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	199,041.02	
		SEGRO PLC	45,033	624,157.38	
英ポンド小計			108,638	1,013,502.62	(152,623,359)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	35,587	406,047.67	
		GOODMAN GROUP	63,582	1,661,397.66	
		GPT GROUP	71,335	384,495.65	
		LENDLEASE GROUP	28,927	310,965.25	
		MIRVAC GROUP	135,075	398,471.25	
		SCENTRE GROUP	198,271	618,605.52	
		STOCKLAND	96,900	430,236.00	
		VICINITY CENTRES	178,802	312,903.50	
豪ドル小計			808,479	4,523,122.50	(366,011,072)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	87,500	5,888,750.00	
香港ドル小計			87,500	5,888,750.00	(85,916,862)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	341,754.42	
		CAPITALLAND INTEGRATED COMMER	209,556	421,207.56	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	147,288.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	262,070.12	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST(N)	5,157	9,695.16	
シンガポールドル小計			542,555	1,182,015.26	(98,213,647)
合計				5,880,793,918	(5,880,793,918)

(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 607銘柄	97.3%		72.3%
	投資証券 35銘柄		2.7%	2.0%

加ドル	株式	87銘柄	99.8%		3.4%
	投資証券	1銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式	228銘柄	99.6%		9.6%
	投資証券	4銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式	82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	41銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式	44銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式	56銘柄	92.9%		1.9%
	投資証券	8銘柄		7.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	29銘柄	95.7%		0.8%
	投資証券	1銘柄		4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.3%		0.3%
	投資証券	5銘柄		12.7%	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。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年12月30日現在です。

### 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	37,025,215,533円
負債総額	98,351,568円
純資産総額( - )	36,926,863,965円
発行済口数	34,893,847,009口
1口当たり純資産額( / )	1.0583円

(参考)

### 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	77,179,677,828円
負債総額	180,379,853円
純資産総額( - )	76,999,297,975円
発行済口数	29,229,952,525口
1口当たり純資産額( / )	2.6343円

### 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	78,111,003,101円
負債総額	30,602,841円
純資産総額( - )	78,080,400,260円
発行済口数	26,056,438,922口
1口当たり純資産額( / )	2.9966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	49,044,240,442円
負債総額	105,793,126円
純資産総額（ - ）	48,938,447,316円
発行済口数	34,650,912,587口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4123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	158,357,618,007円
負債総額	195,889,990円
純資産総額（ - ）	158,161,728,017円
発行済口数	61,167,780,109口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5857円

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	42,451,320,966円
負債総額	201,202,687円
純資産総額（ - ）	42,250,118,279円
発行済口数	21,806,524,554口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9375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	268,737,519,685円
負債総額	146,307,331円
純資産総額（ - ）	268,591,212,354円
発行済口数	62,567,193,478口
1口当たり純資産額（ / ）	4.2928円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【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12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12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12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12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	876	261,453
株式投資信託	807	225,128
単位型	303	11,307
追加型	504	213,820
公社債投資信託	69	36,325
単位型	56	2,102
追加型	13	34,223

### 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)
<b>負債の部</b>			
<b>流動負債</b>			
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
未払法人税等		1,439	
未払消費税等	4	746	4
賞与引当金		2,718	
役員賞与引当金		55	
その他		42	
流動負債合計	15,726		20,938
<b>固定負債</b>			
退職給付引当金		1,395	
賞与引当金		-	
その他		695	
固定負債合計		2,091	
負債合計	17,818		23,095
<b>純資産の部</b>			
<b>株主資本</b>			
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		55,395	
利益剰余金合計		55,395	
自己株式		905	
株主資本合計		77,073	
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 其他有価証券」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、一部が為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

に含まれております。

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

(単位:百万円)

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

(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 米ドル	投資有価証券	4,620	-	273
	香港ドル		862	-	57
	人民元		1,684	-	117
	ユーロ		180	-	5
	合計		7,347	-	453

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

## (退職給付関係)

## 第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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



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

退職給付引当金	1,395
---------	-------

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
------	-----

利息費用	1
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	6
----------------	---

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	6
--------------	---

退職給付の支払額	86
----------	----

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

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

退職給付債務	1,429
--------	-------

未積立退職給付債務	1,429
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	27
-------------	----

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

退職給付引当金	1,456
---------	-------

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	2
----------------	---

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

## (ストックオプション等関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第61期 (2020年3月31日)		第62期 (2021年3月31日)	
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		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せん。

(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せん。

(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の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
エース証券株式会社	8,831百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村証券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社 1	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	10,857百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	

オーストラリア・アンド・ニュージ ーランド・バンキング・グループ・リミ テッド(銀行) 1	26,531百万豪ドル (2020年9月末現在)	銀行法に基づき銀行業を営 んでいます。
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社三十三銀行 1	37,461百万円 (2021年5月1日現在)	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行 1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社南日本銀行	16,601百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営 むとともに、金融機関の信 託業務の兼営等に関する法 律に基づき信託業務を営ん でいます。
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業 協同組合、森林組合などの 協同組織の全国金融機関と して、余剰資金の効率運用 と資金の需給調整、当該協 同組織の信用力の維持向上 および業務機能の補完を 図っています。
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立さ れた労働金庫の系統中央金 融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	165,600百万円	農業協同組合法に基づき 信用事業等を営んでおり ます。
東京都信用農業協同組合連合会	131,300百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	203,600百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	102,528百万円	
新潟県信用農業協同組合連合会	74,400百万円	
石川県信用農業協同組合連合会	33,047百万円	
岐阜県信用農業協同組合連合会	96,618百万円	
静岡県信用農業協同組合連合会	161,300百万円	

愛知県信用農業協同組合連合会	231,402百万円
三重県信用農業協同組合連合会	68,752百万円
滋賀県信用農業協同組合連合会	40,700百万円
大阪府信用農業協同組合連合会	140,600百万円
兵庫県信用農業協同組合連合会	253,300百万円
和歌山県信用農業協同組合連合会	57,883百万円
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円
徳島県信用農業協同組合連合会	32,500百万円
高知県信用農業協同組合連合会	24,879百万円
仙台農業協同組合	3,360百万円
みやぎ亘理農業協同組合	1,520百万円
みやぎ登米農業協同組合	6,317百万円
新みやぎ農業協同組合	10,408百万円
いしのまき農業協同組合	4,560百万円
みやぎ仙南農業協同組合	3,818百万円
秋田しんせい農業協同組合	5,322百万円
山形農業協同組合	3,960百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,667百万円
山形おきたま農業協同組合	4,661百万円
鶴岡市農業協同組合	1,464百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,221百万円
ふくしま未来農業協同組合	16,022百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,256百万円
北つくば農業協同組合	3,392百万円
はが野農業協同組合	3,959百万円
那須南農業協同組合	1,168百万円
高崎市農業協同組合	2,177百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,542百万円
さいたま農業協同組合	8,265百万円
あさか野農業協同組合	864百万円
いるま野農業協同組合	5,718百万円
埼玉中央農業協同組合	2,336百万円
くまがや農業協同組合	2,702百万円
ほくさい農業協同組合	3,137百万円
越谷市農業協同組合	2,052百万円
南彩農業協同組合	2,845百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,486百万円
さいかつ農業協同組合	1,833百万円
ふかや農業協同組合	1,712百万円
横浜農業協同組合	11,872百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,495百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,378百万円
さがみ農業協同組合	5,090百万円



湘南農業協同組合	3,239百万円
秦野市農業協同組合	1,669百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,411百万円
厚木市農業協同組合	2,457百万円
相模原市農業協同組合	849百万円
神奈川つくい農業協同組合	778百万円
佐久浅間農業協同組合	6,907百万円
信州うえだ農業協同組合	4,103百万円
信州諏訪農業協同組合	6,290百万円
上伊那農業協同組合	8,074百万円
みなみ信州農業協同組合	4,407百万円
松本ハイランド農業協同組合	8,782百万円
大北農業協同組合	3,100百万円
グリーン長野農業協同組合	3,840百万円
中野市農業協同組合	2,554百万円
ながの農業協同組合	12,962百万円
北越後農業協同組合	2,951百万円
新潟みらい農業協同組合	4,731百万円
越後中央農業協同組合	5,133百万円
にいがた南蒲農業協同組合	4,892百万円
越後ながおか農業協同組合	5,325百万円
十日町農業協同組合	2,682百万円
ひすい農業協同組合	1,206百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,372百万円
佐渡農業協同組合	2,374百万円
加賀農業協同組合	1,975百万円
小松市農業協同組合	1,958百万円
能美農業協同組合	1,259百万円
金沢中央農業協同組合	1,062百万円
金沢市農業協同組合	3,125百万円
はくい農業協同組合	1,373百万円
能登わかば農業協同組合	2,602百万円
おおぞら農業協同組合	1,392百万円
ぎふ農業協同組合	7,168百万円
西美濃農業協同組合	4,530百万円
いび川農業協同組合	1,997百万円
めぐみの農業協同組合	5,022百万円
陶都信用農業協同組合	1,598百万円
東美濃農業協同組合	2,607百万円
飛騨農業協同組合	6,436百万円
伊豆太陽農業協同組合	1,721百万円
三島函南農業協同組合	995百万円
伊豆の国農業協同組合	886百万円

あいら伊豆農業協同組合	892百万円
南駿農業協同組合	3,088百万円
御殿場農業協同組合	1,204百万円
富士市農業協同組合	1,458百万円
富士宮農業協同組合	922百万円
清水農業協同組合	2,914百万円
静岡市農業協同組合	1,847百万円
大井川農業協同組合	3,317百万円
ハイナン農業協同組合	831百万円
掛川市農業協同組合	766百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,452百万円
遠州中央農業協同組合	3,243百万円
とびあ浜松農業協同組合	3,653百万円
三ヶ日町農業協同組合	293百万円
尾張中央農業協同組合	2,065百万円
西春日井農業協同組合	155百万円
あいち尾東農業協同組合	1,193百万円
愛知北農業協同組合	748百万円
愛知西農業協同組合	1,595百万円
あいち知多農業協同組合	6,886百万円
あいち中央農業協同組合	3,579百万円
西三河農業協同組合	1,316百万円
あいち三河農業協同組合	1,118百万円
あいち豊田農業協同組合	1,803百万円
愛知東農業協同組合	934百万円
豊橋農業協同組合	2,476百万円
鈴鹿農業協同組合	1,555百万円
津安芸農業協同組合	2,462百万円
伊勢農業協同組合	6,242百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	3,779百万円
甲賀農業協同組合	2,532百万円
北大阪農業協同組合	1,822百万円
茨木市農業協同組合	1,203百万円
大阪泉州農業協同組合	1,944百万円
いずみの農業協同組合	2,811百万円
堺市農業協同組合	1,194百万円
大阪南農業協同組合	3,664百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,441百万円
大阪中河内農業協同組合	4,187百万円
北河内農業協同組合	2,684百万円
大阪市農業協同組合	2,393百万円
兵庫南農業協同組合	3,741百万円
みのり農業協同組合	4,304百万円

兵庫西農業協同組合	12,594百万円
たじま農業協同組合	4,288百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,184百万円
淡路日の出農業協同組合	1,852百万円
奈良県農業協同組合	9,349百万円
わかやま農業協同組合	4,778百万円
ながみね農業協同組合	1,993百万円
紀の里農業協同組合	3,837百万円
紀北川上農業協同組合	4,842百万円
ありだ農業協同組合	2,092百万円
紀州農業協同組合	3,815百万円
紀南農業協同組合	4,826百万円
みくまの農業協同組合	1,111百万円
鳥取いなば農業協同組合	5,794百万円
鳥取中央農業協同組合	3,656百万円
鳥取西部農業協同組合	5,020百万円
島根県農業協同組合	22,047百万円
広島市農業協同組合	10,040百万円
広島中央農業協同組合	3,074百万円
山口県農業協同組合	16,471百万円
徳島市農業協同組合	3,604百万円
香川県農業協同組合	24,984百万円
越智今治農業協同組合	6,373百万円
高知市農業協同組合	5,053百万円
高知県農業協同組合	10,763百万円
福岡八女農業協同組合	3,330百万円
宮崎中央農業協同組合	5,628百万円
延岡農業協同組合	1,395百万円
沖縄県農業協同組合	23,918百万円

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 6月30日	臨時報告書
2021年 9月15日	有価証券届出書
2021年 9月15日	有価証券報告書
2021年 9月30日	臨時報告書

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. 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

2022年1月26日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

### 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、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。