

**【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9月15日提出
【計算期間】	第34特定期間(自 2021年12月16日至 2022年6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 ステファニー・ドゥルーズ
【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
	( )	アフリカ		
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)))		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。

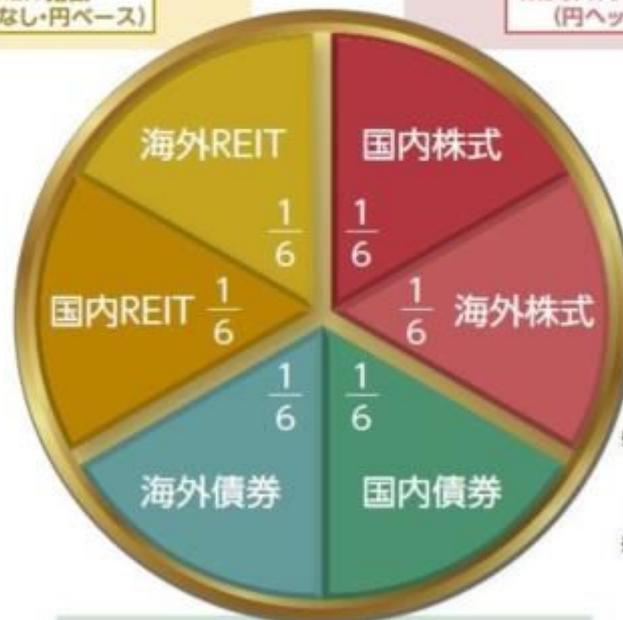
連動をめざす指数(インデックス)

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、2022年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。  
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)



## 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

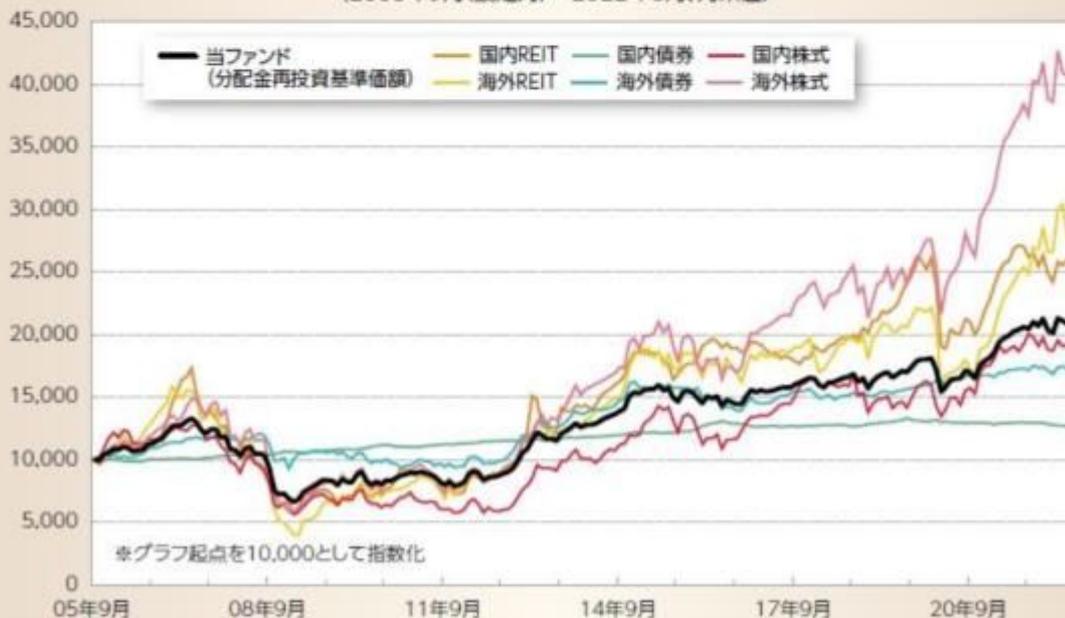
### 各資産の値動きの特徴



※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）～2022年6月、月末値）



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

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

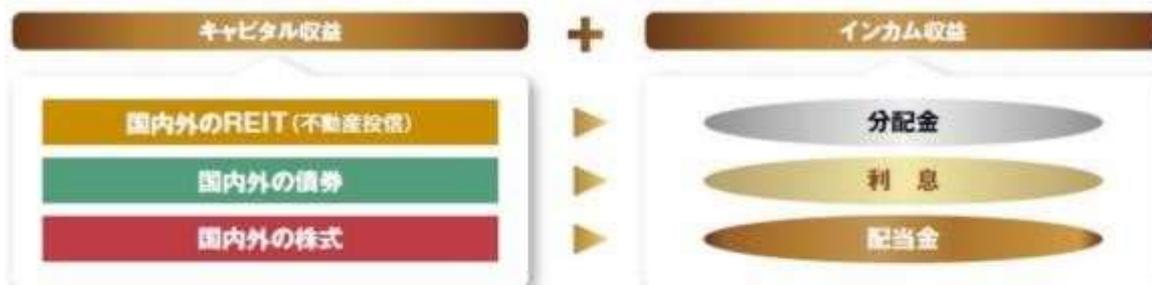
※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。

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



**3 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

(2022年6月末現在)



- ◆ REIT: 実績分配金利回り  
国内: 東証REIT指数(配当込み)  
海外: S&P先進国REIT指数(除く日本)
- ◆ 債券: 最終利回りなど  
国内: NOMURA-BPI総合  
海外: FTSE世界国債インデックス(除く日本)
- ◆ 株式: 実績配当利回りなど  
国内: TOPIX(東証株価指数)  
海外: MSCI-KOKUSAIインデックス

※利回りは切り捨てにて端数処理しています。

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

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

### 各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数(配当込み)** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPX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等の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)** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPX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。
- **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等の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。

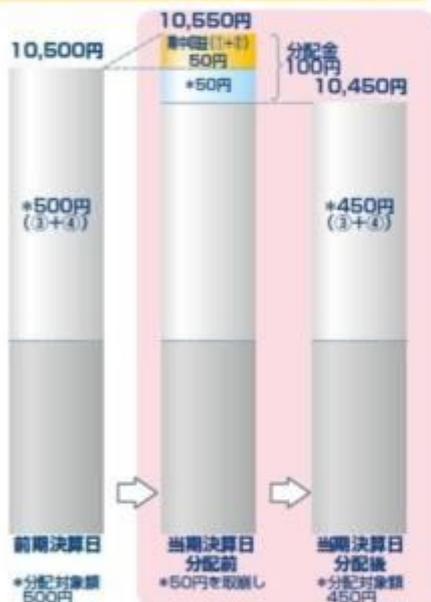
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



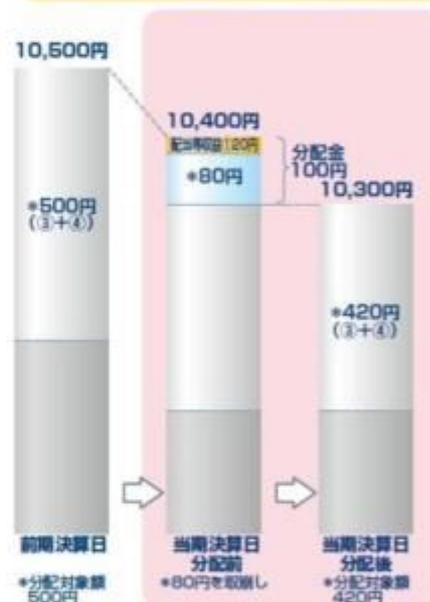
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

#### 前期決算から基準価額が上昇した場合



#### 前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

### 信託金限度額

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

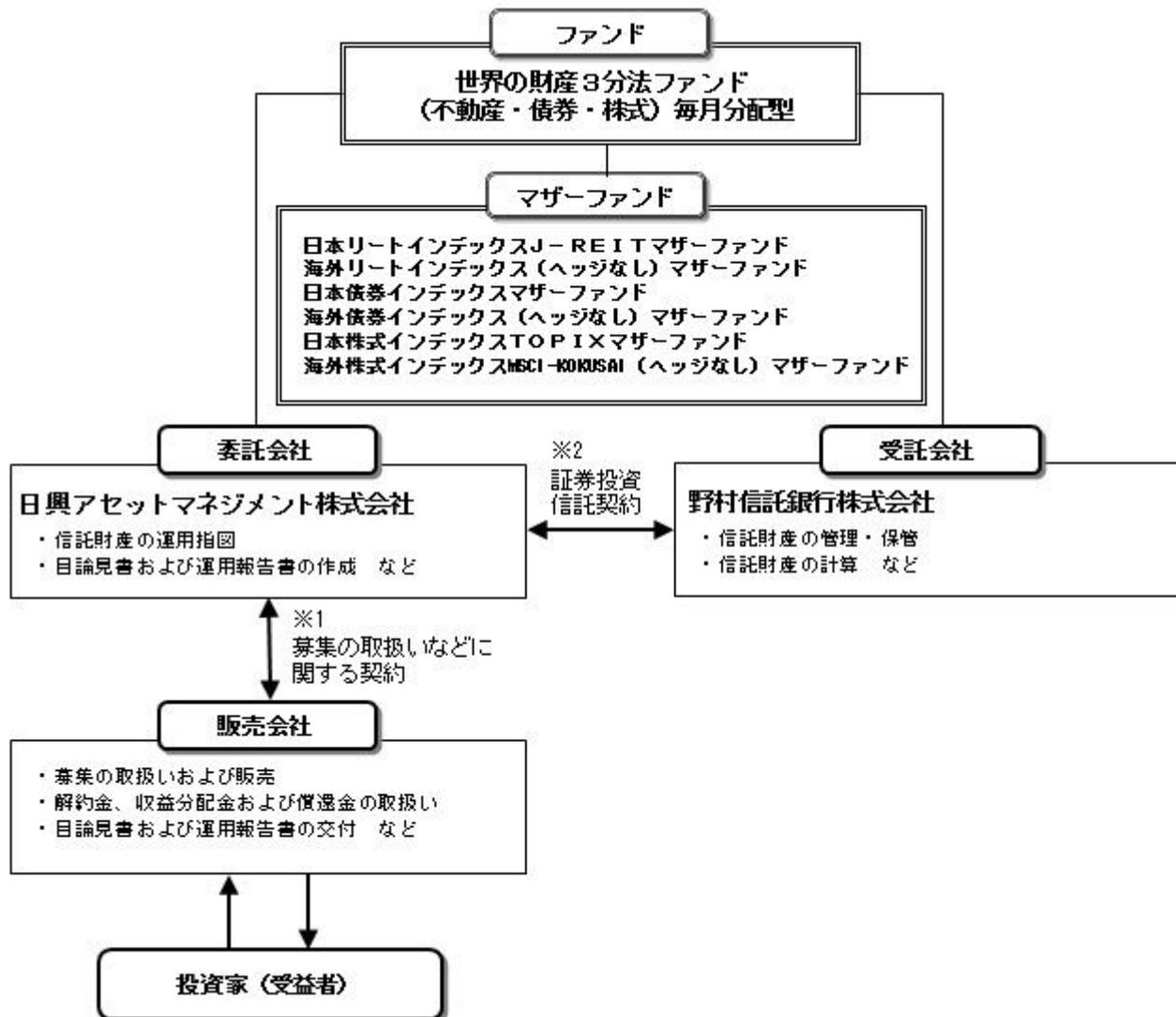
## ・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

## （3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2022年6月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

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

### （2）【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

次の取引ができます。

1) 外国為替予約取引

2) 資金の借入

#### <日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) 金銭債権

3) 約束手形

4) 為替手形

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

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

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

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

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

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

#### <海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) 金銭債権

3) 約束手形

4) 為替手形

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

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

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

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

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

以外のもの

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数に係る標章または商標は、株式会社JPM総研または株式会社JPM総研の関連会社（以下「JPM」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数に係る標章または商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPMは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPMにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPMは責任を負いません。

#### < 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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） <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	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。 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 <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られます。

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

#### < 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド >

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

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社

信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

T O P I Xの指数値およびT O P I Xに係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

#### < 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（D R（預託証券）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。</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）

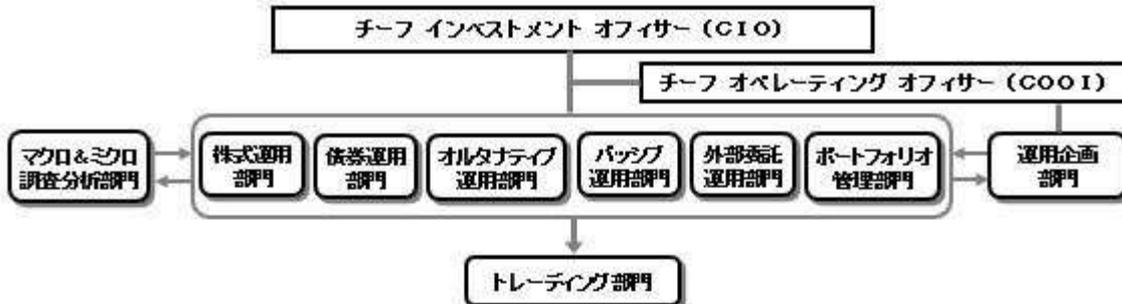
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2000年5月17日設定)
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)

\* 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。

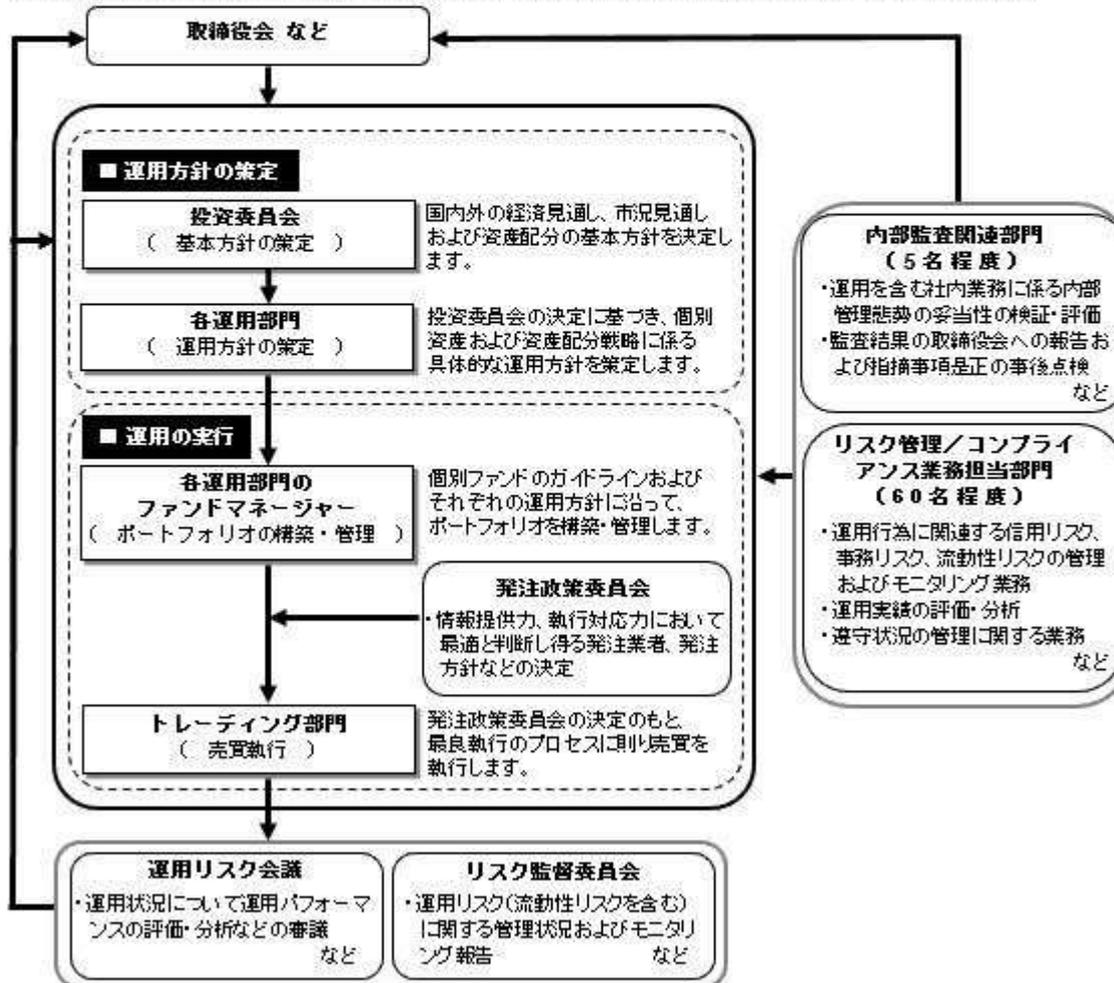
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### (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。



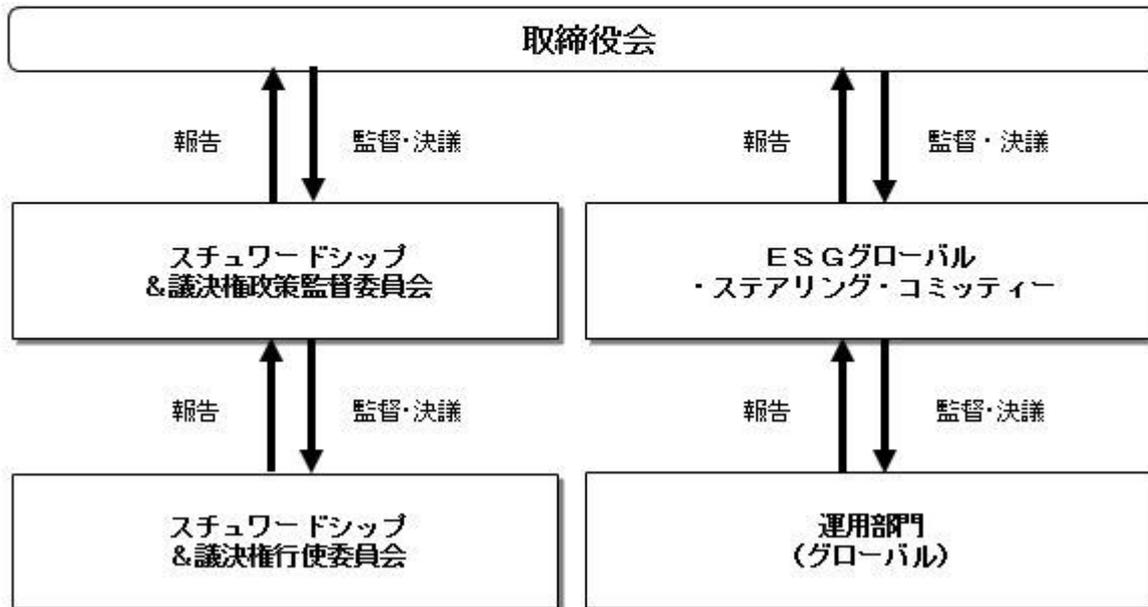
## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「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2022年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

## 1) 分配対象額の範囲

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

## 2) 分配対象額についての分配方針

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

## 3) 留保益の運用方針

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

## 収益分配金の支払い

## &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、当該取引の契約期間が、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、当該取引の契約期間が、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、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、
  - 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、
- 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、
- 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、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、
- 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、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、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、その価格が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。

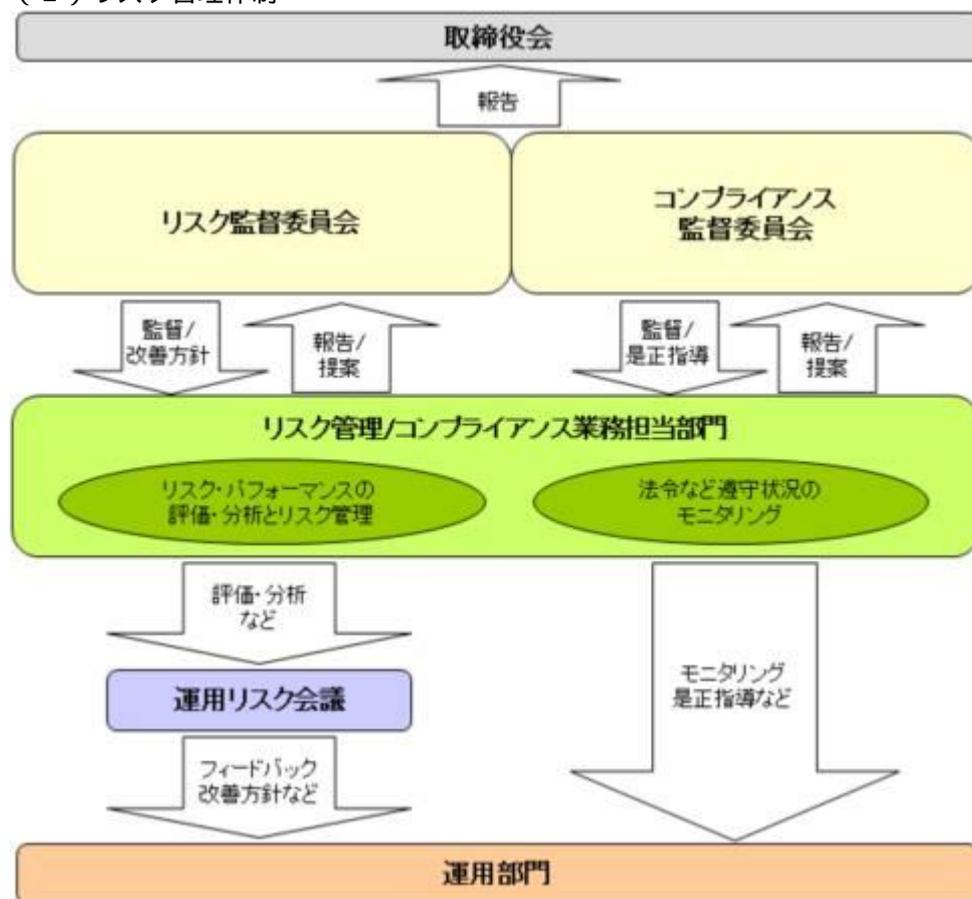
##### ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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



### 全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）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（流動性リスクを含む）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（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行な

い、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

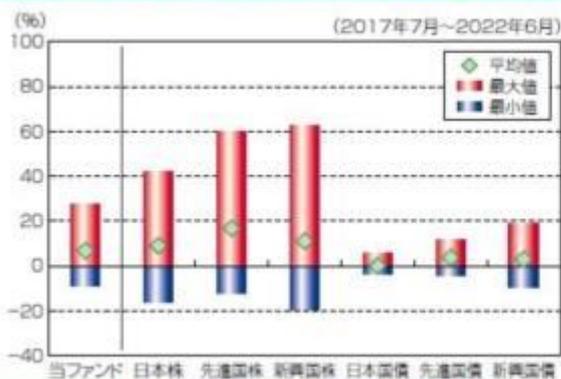
### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2022年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### (参考情報)

#### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.8%	9.0%	16.7%	11.1%	0.1%	3.7%	3.0%
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%	-3.5%	-4.5%	-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7月から2022年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

#### <各資産クラスの指数>

日本株 ----- 東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 --- MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

#### 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

### 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株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

#### 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・ディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

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

### 4【手数料等及び税金】

#### (1)【申込手数料】

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。

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ます。

#### (3)【信託報酬等】

信託報酬

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

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

#### (4)【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。(以下「実費方式」といいます。)また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかると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応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

## （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### 1) 収益分配金に対する課税

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

### 2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）<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。

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

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

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

法人受益者の場合

### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

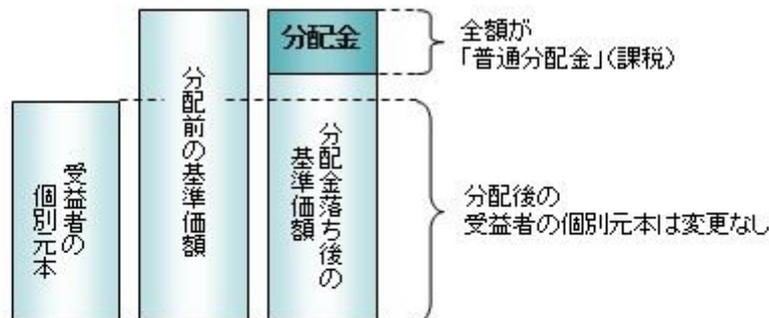
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場

合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

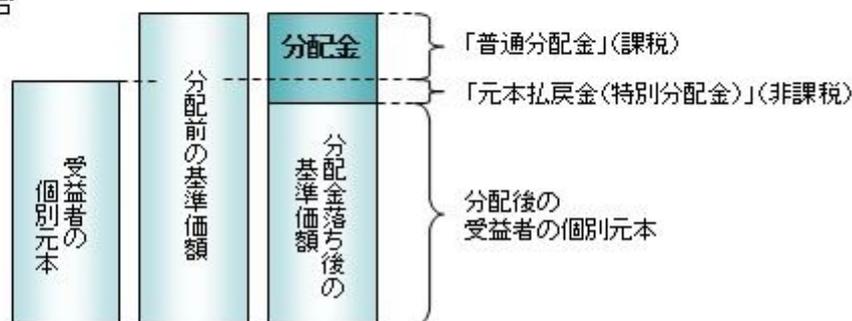
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2022年9月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2022年6月30日現在です。

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

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	36,029,177,524	98.12
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		689,833,420	1.88
合計(純資産総額)		36,719,010,944	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	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,329,691,662	2.5391	5,915,320,098	2.6298	6,126,623,132	16.69
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	2,383,124,256	2.4402	5,815,313,552	2.5583	6,096,746,784	16.60
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	4,390,458,160	1.3694	6,012,295,069	1.3742	6,033,367,603	16.43
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	3,223,974,378	1.8274	5,891,812,222	1.8448	5,947,587,932	16.20
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1,445,083,883	3.9598	5,722,298,856	4.0924	5,913,861,282	16.11
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	2,056,354,424	2.7260	5,605,737,428	2.8745	5,910,990,791	16.10

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.12
合 計	98.12

## 【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
第34特定期間末	(2022年 6月15日)	35,426	35,462	0.9906	0.9916
	2021年 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	
	2022年 1月末日	35,217		1.0102	
	2月末日	34,787		0.9978	
	3月末日	36,717		1.0566	
	4月末日	36,456		1.0451	
	5月末日	36,704		1.0333	
	6月末日	36,719		1.0198	

(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
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	0.0060

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	3.85

(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
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	2,197,942,225	1,407,308,080

（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2022年 6月30日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	60,093,426,300	98.81
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		724,732,114	1.19
合計（純資産総額）		60,818,158,414	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	6,432	673,350.74	4,330,992,000	676,000	4,348,032,000	7.15
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	5,517	603,525.28	3,329,649,000	624,000	3,442,608,000	5.66

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	17,840	159,930	2,853,151,300	169,400	3,022,096,000	4.97
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,026	318,526.47	2,875,020,000	334,000	3,014,684,000	4.96
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	17,868	154,451.72	2,759,743,400	165,700	2,960,727,600	4.87
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	27,835	101,128.51	2,814,912,200	105,700	2,942,159,500	4.84
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,284	290,381.33	2,405,519,000	307,500	2,547,330,000	4.19
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	10,992	175,380.34	1,927,780,800	184,200	2,024,726,400	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,516	335,244.28	1,849,207,500	361,000	1,991,276,000	3.27
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,419	135,245.52	1,679,614,200	142,300	1,767,223,700	2.91
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	3,770	388,368.03	1,464,147,500	398,500	1,502,345,000	2.47
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	7,832	172,260.22	1,349,142,100	179,500	1,405,844,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,746	75,625.82	1,266,430,000	80,400	1,346,378,400	2.21
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	1,905	642,028.87	1,223,065,000	682,000	1,299,210,000	2.14
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	2,904	394,301.3	1,145,051,000	404,500	1,174,668,000	1.93
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	3,720	306,719.75	1,140,997,500	313,500	1,166,220,000	1.92
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,707	628,464.55	1,072,789,000	681,000	1,162,467,000	1.91
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	16,901	61,157.83	1,033,628,600	67,800	1,145,887,800	1.88
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,754	166,200	1,122,514,800	166,500	1,124,541,000	1.85
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	2,173	505,913.02	1,099,349,000	513,000	1,114,749,000	1.83
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,934	504,618.92	975,933,000	523,000	1,011,482,000	1.66
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	6,488	146,319.63	949,321,800	153,100	993,312,800	1.63
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,487	144,427.25	936,899,600	152,300	987,970,100	1.62
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,282	38,395.32	932,315,200	39,900	968,851,800	1.59
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	7,455	111,572.52	831,773,200	119,000	887,145,000	1.46
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	2,566	320,763.05	823,078,000	335,000	859,610,000	1.41
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	3,948	202,458.45	799,306,000	217,600	859,084,800	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,147	153,984.82	792,559,900	159,800	822,490,600	1.35
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,153	648,837.81	748,110,000	696,000	802,488,000	1.32
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人 投資証券	5,288	143,231.9	757,410,300	148,000	782,624,000	1.29

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.81
合計	98.81

## 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2022年 6月30日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	42,841,350,890	76.14
	カナダ	1,028,305,314	1.83
	ドイツ	36,058,664	0.06
	イタリア	15,021,116	0.03
	フランス	876,774,450	1.56
	オランダ	103,703,900	0.18
	スペイン	222,453,958	0.40
	ベルギー	689,560,327	1.23
	アイルランド	27,806,369	0.05
	イギリス	2,824,327,774	5.02
	オーストラリア	3,544,851,788	6.30
	ニュージーランド	118,689,284	0.21
	香港	881,573,971	1.57
	シンガポール	2,085,361,986	3.71
	韓国	132,220,881	0.23
	イスラエル	63,853,875	0.11
	ガーンジー	149,842,080	0.27
	小計	55,641,756,627	98.89
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		624,665,017	1.11
合計（純資産総額）		56,266,421,644	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		40,991,580	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	222,560	15,147.05	3,371,128,890	16,170.61	3,598,931,140	6.40
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	27,372	84,692.12	2,318,192,809	88,773.66	2,429,912,622	4.32
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	45,911	40,745.40	1,870,662,273	42,515.68	1,951,937,421	3.47
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	180,830	8,602.03	1,555,505,255	9,480.12	1,714,290,968	3.05
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	136,453	10,599.23	1,446,296,957	11,375.87	1,552,272,462	2.76
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	85,636	17,055.23	1,460,542,247	17,413.03	1,491,182,408	2.65
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	98,734	13,199.26	1,303,216,540	13,293.49	1,312,520,113	2.33
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	289,010	3,858.03	1,115,009,404	4,082.63	1,179,921,359	2.10
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,058	25,343.05	1,065,878,250	26,663.53	1,121,414,930	1.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	102,919	9,411.01	968,572,151	9,895.63	1,018,448,550	1.81
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	40,362	21,726.85	876,939,506	23,365.44	943,076,131	1.68
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	183,299	4,600.79	843,321,461	4,871.27	892,899,873	1.59
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	44,676	18,525.03	827,624,470	19,755.72	882,606,868	1.57
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	511,737	1,683.25	861,382,089	1,708.97	874,548,298	1.55
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	115,597	7,009.60	810,289,237	7,565.23	874,518,817	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	120,130	6,626.63	796,057,368	7,047.22	846,582,635	1.50
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,698	21,904.06	760,027,130	23,671.60	821,357,496	1.46
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	36,558	20,670.96	755,689,178	21,853.76	798,929,948	1.42
香港	投資証券	LINK REIT	634,100	1,189.87	754,497,888	1,132.52	718,131,249	1.28
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,664	35,041.79	689,061,898	35,857.99	705,111,673	1.25
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	58,000	11,080.23	642,653,588	11,474.28	665,508,588	1.18
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	361,650	1,583.19	572,562,684	1,684.44	609,178,503	1.08
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	32,023	17,241.53	552,125,648	18,304.18	586,154,935	1.04
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	87,313	6,469.05	564,832,733	6,585.24	574,977,270	1.02
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	162,549	3,209.63	521,722,318	3,531.81	574,092,379	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	90,071	5,794.18	521,888,042	6,326.91	569,871,759	1.01
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	42,902	12,391.68	531,627,900	12,302.56	527,804,721	0.94
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	185,301	2,626.66	486,724,385	2,758.20	511,097,663	0.91
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,018	9,396.01	488,761,962	9,727.51	506,005,906	0.90
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	214,577	2,345.60	503,313,270	2,145.87	460,455,634	0.82

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.89
合計	98.89

## 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	300,000.00	40,977,000	40,991,580	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2022年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	39,283,799,980	81.32
地方債証券	日本	4,581,577,325	9.48
特殊債券	日本	3,645,444,000	7.55
社債券	日本	706,030,000	1.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		89,219,613	0.18
合計（純資産総額）		48,306,070,918	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341回利付国債（10年）	700,000,000	101.60	711,214,000	101.18	708,267,000	0.300	2025/12/20	1.47
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	690,000,000	100.89	696,161,700	100.42	692,925,600	0.100	2027/3/20	1.43
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	640,000,000	100.89	645,745,500	100.16	641,043,200	0.100	2027/12/20	1.33
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	640,000,000	100.89	645,696,000	100.05	640,358,400	0.100	2028/3/20	1.33
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	610,000,000	100.85	615,197,200	100.44	612,726,700	0.100	2026/12/20	1.27
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	600,000,000	100.62	603,720,000	99.05	594,306,000	0.100	2030/3/20	1.23
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	590,000,000	100.86	595,091,700	99.87	589,268,400	0.100	2028/9/20	1.22

日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	570,000,000	101.60	579,139,800	101.36	577,797,600	0.400	2025/6/20	1.20
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	99.44	576,801,600	98.87	573,451,800	0.100	2030/9/20	1.19
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	100.69	563,864,000	99.15	555,262,400	0.100	2029/12/20	1.15
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	545,000,000	100.52	547,876,400	100.49	547,703,200	0.100	2026/6/20	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	99.97	534,839,500	0.100	2028/6/20	1.11
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	530,000,000	100.45	532,409,300	100.48	532,559,900	0.100	2026/3/20	1.10
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	520,000,000	101.81	529,430,900	101.45	527,550,400	0.400	2025/9/20	1.09
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	101.72	498,472,100	101.26	496,213,200	0.500	2024/9/20	1.03
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	430,000,000	100.53	432,315,400	100.34	431,492,100	0.100	2027/6/20	0.89
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	100.56	422,352,000	98.94	415,560,600	0.100	2030/6/20	0.86
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	370,000,000	115.12	425,944,000	111.93	414,166,900	1.500	2033/3/20	0.86
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	358,000,000	116.87	418,398,180	113.82	407,504,240	1.700	2032/9/20	0.84
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	400,000,000	100.45	401,813,000	100.48	401,940,000	0.100	2026/9/20	0.83
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	100.77	403,119,000	99.77	399,100,000	0.100	2028/12/20	0.83
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	400,000,000	99.65	398,628,000	99.76	399,048,000	0.200	2032/3/20	0.83
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	101.65	396,438,900	101.26	394,937,400	0.400	2025/3/20	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	98.72	394,880,000	0.100	2031/3/20	0.82
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	117.38	402,620,260	114.35	392,234,220	2.100	2030/3/20	0.81
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	315,000,000	117.60	370,440,000	114.14	359,544,150	1.700	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	350,000,000	100.48	351,686,000	99.55	348,432,000	0.100	2029/6/20	0.72
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	350,000,000	100.29	351,031,500	99.39	347,879,000	0.100	2029/9/20	0.72
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	290,000,000	116.49	337,835,500	113.68	329,695,200	2.100	2029/9/20	0.68
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	111.04	333,144,000	109.23	327,717,000	2.300	2026/6/20	0.68

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	81.32
地方債証券	9.48
特殊債券	7.55
社債券	1.46
合計	99.82

## 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2022年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	79,049,256,164	50.61
	カナダ	3,180,433,545	2.04
	メキシコ	1,205,343,618	0.77
	ドイツ	10,170,249,716	6.51
	イタリア	12,717,535,694	8.14
	フランス	13,562,922,862	8.68
	オランダ	2,666,378,040	1.71
	スペイン	8,136,426,095	5.21
	ベルギー	3,137,260,940	2.01
	オーストリア	1,999,009,632	1.28
	フィンランド	814,380,327	0.52
	アイルランド	1,047,153,740	0.67
	イギリス	7,757,551,575	4.97
	スウェーデン	414,153,265	0.27
	ノルウェー	317,838,997	0.20
	デンマーク	589,587,603	0.38
	ポーランド	642,208,710	0.41
	オーストラリア	2,344,312,779	1.50
	シンガポール	682,916,088	0.44
	マレーシア	789,764,084	0.51
中国	3,171,485,560	2.03	
イスラエル	624,964,122	0.40	
	小計	155,021,133,156	99.24
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,184,814,824	0.76
合計（純資産総額）		156,205,947,980	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		133,581,840	0.09

売建	13,663,860	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	13,110.60	1,101,290,557	11,658.91	979,348,502	1.125	2031/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	13,602.39	952,167,552	13,166.12	921,628,969	0.250	2023/11/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,480,000	13,687.21	1,023,804,051	12,126.07	907,030,691	1.625	2031/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	12,979.27	986,425,137	11,680.26	887,700,291	1.250	2031/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	13,601.02	843,263,661	13,254.22	821,761,802	0.125	2023/7/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	13,283.48	907,262,159	11,768.36	803,779,089	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	12,529.39	814,410,355	12,288.38	798,745,105	1.875	2032/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	13,342.29	800,537,493	12,875.14	772,508,955	0.375	2024/9/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,720,000	14,432.04	825,512,757	13,285.72	759,943,363	2.375	2026/4/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	13,388.74	803,324,741	12,329.49	739,769,820	1.500	2028/11/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,183.21	751,710,626	13,596.72	720,626,348	2.500	2023/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	12,852.19	785,268,884	11,456.02	699,963,210	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	14,928.81	737,483,625	13,432.54	663,567,840	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,661.25	683,062,776	13,193.35	659,667,869	0.500	2023/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,526.67	676,333,644	13,042.26	652,113,094	0.125	2024/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,556.94	677,847,375	13,035.32	651,766,056	0.250	2024/3/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,545.20	677,260,075	12,908.25	645,412,569	0.375	2024/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	14,205.15	671,903,708	13,201.36	624,424,611	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	13,973.92	676,338,120	12,901.31	624,423,434	1.625	2026/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	13,799.66	641,684,194	13,406.11	623,384,530	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	14,307.08	660,987,354	13,466.71	622,162,342	2.375	2024/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,950,000	12,868.20	636,976,330	12,538.25	620,643,591	1.125	2026/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,271.30	663,565,381	12,380.48	619,024,253	0.375	2026/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,510,000	15,197.90	685,425,608	13,612.47	613,922,565	3.125	2028/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,550,000	13,905.32	632,692,069	13,417.33	610,488,562	1.375	2023/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	13,517.97	635,344,701	12,940.28	608,193,429	0.250	2024/6/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	14,191.48	642,874,243	13,284.12	601,770,698	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,370,000	13,984.38	611,117,690	13,221.65	577,786,294	2.625	2029/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	12,601.25	641,403,892	11,251.00	572,676,224	0.625	2030/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	14,735.47	618,889,774	13,606.06	571,454,809	3.000	2025/9/30	0.37

#### 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	600,000.00	81,672,000	82,003,020	0.05
	ユーロ	買建	293,000.00	41,954,670	41,802,397	0.03
	英ポンド	買建	59,000.00	9,784,005	9,776,423	0.01
	米ドル	売建	100,000.00	13,659,000	13,663,860	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2022年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	41,368,290,810	99.20
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		331,744,170	0.80
合計（純資産総額）		41,700,034,980	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	317,985,000	0.76

(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	784,000	1,990.09	1,560,230,560	2,100.00	1,646,400,000	3.95
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	107,700	13,185.70	1,420,100,879	11,095.00	1,194,931,500	2.87
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	189,200	3,359.62	635,641,810	3,896.00	737,123,200	1.77

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	992,800	645.25	640,609,480	729.40	724,148,320	1.74
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,600	65,136.52	1,016,129,712	46,380.00	723,528,000	1.74
日本	株式	任天堂	その他製品	9,700	50,304.51	487,953,756	58,680.00	569,196,000	1.36
日本	株式	日立製作所	電気機器	82,700	6,694.47	553,632,999	6,438.00	532,422,600	1.28
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	101,200	6,316.12	639,192,100	5,235.00	529,782,000	1.27
日本	株式	KDDI	情報・通信業	123,000	3,734.47	459,340,493	4,289.00	527,547,000	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	135,200	3,238.61	437,860,650	3,818.00	516,193,600	1.24
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	10,900	51,913.22	565,854,200	44,300.00	482,870,000	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	117,700	7,226.34	850,540,545	3,995.00	470,211,500	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	111,100	3,645.62	405,028,382	4,037.00	448,510,700	1.08
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	110,100	3,822.17	420,821,036	4,032.00	443,923,200	1.06
日本	株式	第一三共	医薬品	124,800	2,850.81	355,781,088	3,437.00	428,937,600	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	125,700	3,398.59	427,203,969	3,293.00	413,930,100	0.99
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,800	25,319.31	476,003,028	21,750.00	408,900,000	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	26,700	19,370.43	517,190,495	15,300.00	408,510,000	0.98
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	255,600	1,532.91	391,813,640	1,506.50	385,061,400	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	33,200	16,804.90	557,922,735	11,585.00	384,622,000	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	47,200	6,073.88	286,687,136	7,903.00	373,021,600	0.89
日本	株式	三井物産	卸売業	122,800	2,645.77	324,900,707	2,994.50	367,724,600	0.88
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	99,100	3,270.59	324,115,469	3,667.00	363,399,700	0.87
日本	株式	村田製作所	電気機器	46,900	8,494.56	398,395,096	7,396.00	346,872,400	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	17,500	18,173.43	318,035,025	18,920.00	331,100,000	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	15,100	24,075.19	363,535,374	21,240.00	320,724,000	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	38,200	12,356.76	472,028,232	8,380.00	320,116,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	203,400	1,520.72	309,315,250	1,543.00	313,846,200	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	147,100	1,969.29	289,683,200	2,115.00	311,116,500	0.75
日本	株式	S M C	機械	5,000	68,203.86	341,019,324	60,470.00	302,350,000	0.73

## 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	0.10
		鉱業	0.33
		建設業	2.23
		食料品	3.42
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.19
		化学	6.23
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.71

鉄鋼	0.77
非鉄金属	0.72
金属製品	0.60
機械	5.26
電気機器	17.21
輸送用機器	8.01
精密機器	2.60
その他製品	2.51
電気・ガス業	1.36
陸運業	3.05
海運業	0.61
空運業	0.43
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	9.05
卸売業	5.47
小売業	4.29
銀行業	5.35
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.33
その他金融業	1.14
不動産業	2.04
サービス業	5.16
合 計	99.20

### 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09月	買建	17	日本円	324,585,350	317,985,000	0.76

(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2022年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

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

株式	アメリカ	165,958,407,148	67.52
	カナダ	9,371,890,120	3.81
	ドイツ	5,571,550,711	2.27
	イタリア	1,229,953,842	0.50
	フランス	7,364,086,140	3.00
	オランダ	4,011,010,527	1.63
	スペイン	1,796,866,083	0.73
	ベルギー	601,300,228	0.24
	オーストリア	127,203,294	0.05
	ルクセンブルク	171,145,800	0.07
	フィンランド	865,457,716	0.35
	アイルランド	4,368,826,309	1.78
	ポルトガル	126,279,651	0.05
	イギリス	10,754,581,613	4.38
	スイス	8,228,475,579	3.35
	スウェーデン	2,241,989,284	0.91
	ノルウェー	582,952,037	0.24
	デンマーク	1,967,364,819	0.80
	ケイマン	496,839,874	0.20
	オーストラリア	5,170,656,767	2.10
	バミューダ	116,168,305	0.05
	ニュージーランド	174,703,871	0.07
	香港	1,878,889,140	0.76
	シンガポール	781,311,730	0.32
	イスラエル	616,658,489	0.25
	ジャージー	764,135,237	0.31
	アラブ首長国連邦	0	0.00
マン島	44,859,354	0.02	
小計	235,383,563,668	95.77	
投資証券	アメリカ	5,174,688,099	2.11
	カナダ	12,990,936	0.01
	フランス	99,605,989	0.04
	ベルギー	22,261,998	0.01
	イギリス	134,618,333	0.05
	オーストラリア	330,615,861	0.13
	香港	92,526,924	0.04
	シンガポール	115,647,042	0.05
	小計	5,982,955,182	2.43
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,414,036,653	1.80
合計（純資産総額）		245,780,555,503	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,656,019,150	1.49
	買建	ドイツ	694,688,764	0.28

(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		3,378,498,770	1.37

(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	618,794	20,344.79	12,589,236,934	19,029.95	11,775,622,841	4.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	270,044	41,988.51	11,338,745,959	35,572.33	9,606,096,119	3.91
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	347,290	22,490.53	7,810,739,591	14,887.18	5,170,170,687	2.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,405	374,170.83	4,267,418,405	305,347.22	3,482,485,049	1.42
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	10,770	377,573.22	4,066,463,673	306,864.36	3,304,929,248	1.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	33,305	137,742.25	4,587,505,908	93,690.03	3,120,346,769	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	35,730	61,761.51	2,206,738,778	70,487.24	2,518,509,185	1.02
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	99,841	22,504.13	2,246,835,656	24,190.99	2,415,252,952	0.98
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	94,950	31,677.96	3,007,822,705	21,242.80	2,017,004,392	0.82
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	87,700	44,225.64	3,878,589,429	22,407.31	1,965,121,894	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	160,791	8,936.71	1,436,943,833	12,044.24	1,936,605,651	0.79
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	49,045	39,695.80	1,946,880,835	37,380.61	1,833,332,174	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	91,059	19,302.58	1,757,674,215	19,435.89	1,769,813,254	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	112,160	23,152.53	2,596,788,626	15,759.20	1,767,552,321	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	63,002	31,776.78	2,002,001,323	27,267.65	1,717,917,115	0.70
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	106,470	16,726.51	1,780,871,782	16,095.68	1,713,707,050	0.70

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	213,680	5,964.38	1,274,470,784	6,962.47	1,487,742,555	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	73,991	15,855.66	1,173,176,502	20,089.22	1,486,421,951	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	39,675	50,421.41	2,000,469,618	37,432.55	1,485,136,485	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	33,160	49,165.47	1,630,327,070	44,091.60	1,462,077,496	0.59
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,216	15,123.42	1,016,536,295	21,067.85	1,416,096,955	0.58
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	30,764	33,828.48	1,040,699,452	44,147.64	1,358,157,997	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	156,532	7,472.94	1,169,754,990	8,573.93	1,342,095,413	0.55
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	26,593	51,050.37	1,357,582,527	45,773.88	1,217,264,791	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	96,093	11,187.47	1,075,037,901	12,644.26	1,215,025,530	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	276,049	6,434.62	1,776,270,956	4,354.62	1,202,089,821	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	52,591	21,825.25	1,147,812,064	22,788.65	1,198,478,229	0.49
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	159,587	7,180.29	1,145,882,083	6,962.47	1,111,121,168	0.45
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,869	82,746.21	1,230,353,536	73,249.54	1,089,147,494	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	16,864	67,077.25	1,131,190,899	64,217.73	1,082,967,819	0.44

#### 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	5.20
		素材	4.22
		資本財	5.76
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	2.04
		耐久消費財・アパレル	1.57
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	5.71
		小売	4.56
		食品・生活必需品小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	4.40

	家庭用品・パーソナル用品	1.79
	ヘルスケア機器・サービス	4.86
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.24
	銀行	5.78
	各種金融	4.53
	保険	3.17
	不動産	0.36
	ソフトウェア・サービス	10.92
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.20
	電気通信サービス	1.69
	公益事業	3.25
	半導体・半導体製造装置	4.21
投資証券		2.43
合計		98.20

### 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 EMINI2209	買建	140	米ドル	27,111,200	3,705,558,816	26,748,750	3,656,019,150	1.49
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2209	買建	140	ユーロ	4,831,550	689,317,238	4,869,200	694,688,764	0.28

(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	20,600,000.00	2,717,864,920	2,807,775,820	1.14
	ユーロ	買建	4,000,000.00	558,086,590	570,722,950	0.23

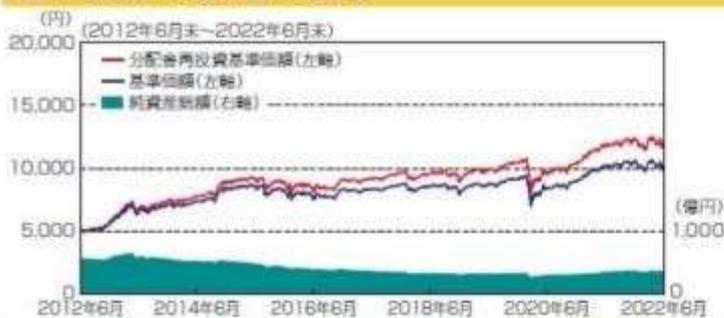
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

### 参考情報

## 運用実績

2022年6月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,198円

純資産総額…………… 367.19億円

※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、2012年6月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したも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)

2022年2月	2022年3月	2022年4月	2022年5月	2022年6月	直近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,240円

## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*	組入上位の銘柄名	国名	比率**
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.6%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	7.1%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.7%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	5.0%
			日本プロロシスリート投資法人 投資証券	日本	5.0%
			GLP投資法人 投資証券	日本	4.9%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	6.4%
			EQUINIX INC	アメリカ	4.3%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.5%
			REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.0%
			WELL TOWER INC	アメリカ	2.8%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.4%	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349回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第350回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.3%
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	16.7%	US TREASURY N/B(1.125%)	アメリカ	0.6%
			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(1.25%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(0.125%)	アメリカ	0.5%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.2%	トヨタ自動車	日本	3.9%
			ソニーグループ	日本	2.9%
			日本電信電話	日本	1.8%
			三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.7%
			キーエンス	日本	1.7%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.1%	APPLE INC	アメリカ	4.8%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	3.9%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.1%
			ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
			ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
現金その他		1.9%			

\*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。

※2022年は、2022年6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

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

## 2【換金（解約）手続等】

### <解約請求による換金>

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(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。

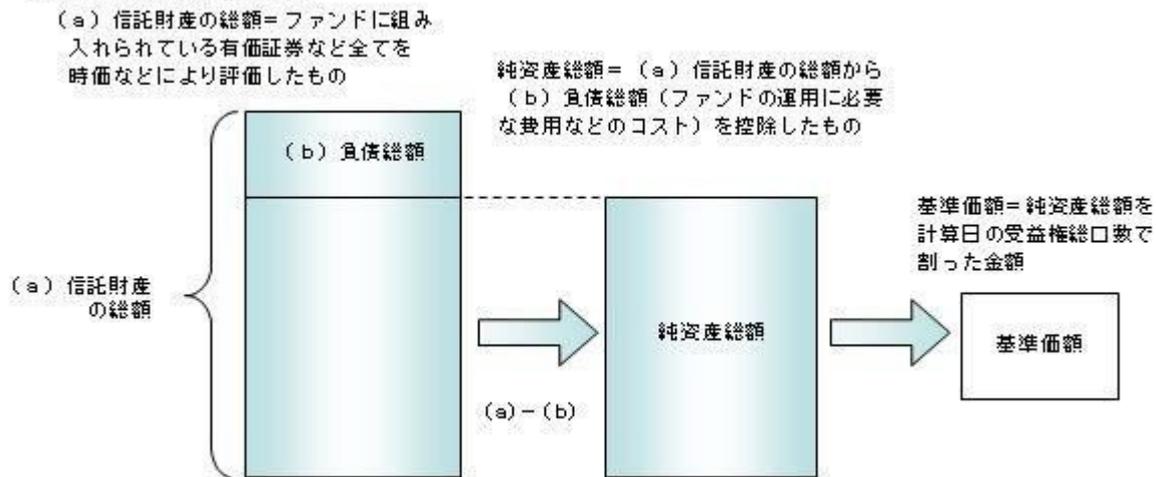
### 3【資産管理等の概要】

#### (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。)
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更

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

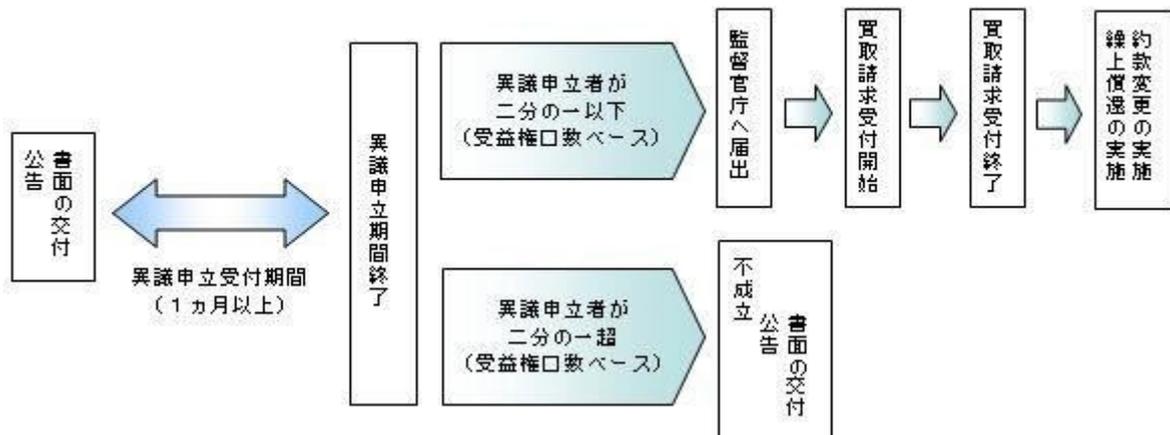
異議の申立て

- 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12月16日から2022年6月15日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年12月15日現在	当期 2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	723,847,304	765,689,623
親投資信託受益証券	35,608,937,332	34,761,176,247
未収入金	16,912,335	-
流動資産合計	36,349,696,971	35,526,865,870
資産合計	36,349,696,971	35,526,865,870
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	34,973,123	35,763,757
未払解約金	31,092,389	27,598,322
未払受託者報酬	1,647,140	1,645,245
未払委託者報酬	29,648,718	29,614,595
未払利息	231	333
その他未払費用	3,575,884	5,822,834
流動負債合計	100,937,485	100,445,086
負債合計	100,937,485	100,445,086
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	34,973,123,043	35,763,757,188
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,275,636,443	337,336,404
(分配準備積立金)	6,514,081,633	6,306,389,406
元本等合計	36,248,759,486	35,426,420,784
純資産合計	36,248,759,486	35,426,420,784
負債純資産合計	36,349,696,971	35,526,865,870

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自	2021年12月16日 至 2022年 6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		921,017,583		1,235,069,362
営業収益合計		921,017,583		1,235,069,362
営業費用				
支払利息		64,571		32,368
受託者報酬		9,902,171		9,852,407
委託者報酬		178,240,229		177,344,373
その他費用		4,236,242		3,035,239
営業費用合計		192,443,213		190,264,387
営業利益又は営業損失（ ）		728,574,370		1,425,333,749
経常利益又は経常損失（ ）		728,574,370		1,425,333,749
当期純利益又は当期純損失（ ）		728,574,370		1,425,333,749
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（ ）		2,153,436		13,619,075
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		743,476,854		1,275,636,443
剰余金増加額又は欠損金減少額		62,928,883		69,294,698
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,684,819
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		64,609,879
剰余金減少額又は欠損金増加額		51,805,839		33,048,401
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		32,102,802
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		945,599
分配金		209,691,261		210,266,320
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,275,636,443		337,336,404

## (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12月15日現在	当期 2022年 6月15日現在
1.	期首元本額	34,197,976,910円	34,973,123,043円
	期中追加設定元本額	2,642,144,579円	2,197,942,225円
	期中一部解約元本額	1,866,998,446円	1,407,308,080円
2.	受益権の総数	34,973,123,043口	35,763,757,188口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	- 円	337,336,404円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日		当期 自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日	
分配金の計算過程 自 2021年 6月16日 至 2021年 7月15日		分配金の計算過程 自 2021年12月16日 至 2022年 1月17日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	31,874,418円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 24,906,055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	1,151,756,073円	C 信託約款に定める収益調整金 1,527,789,851円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	5,764,463,078円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,455,583,978円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	6,948,093,569円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 8,008,279,884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) 2,296円
G	分配金額	34,579,222円	G 分配金額 34,869,284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 7月16日 至 2021年 8月16日		自 2022年 1月18日 至 2022年 2月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	32,306,974円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 14,811,134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	1,274,895,151円	C 信託約款に定める収益調整金 1,562,540,605円

D	信託約款に定める分配準備積立金	5,712,655,559円	D	信託約款に定める分配準備積立金	6,405,335,103円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,019,857,684円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,982,686,842円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,008円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,291円
G	分配金額	34,945,295円	G	分配金額	34,842,827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 8月17日			自 2022年 2月16日	
	至 2021年 9月15日			至 2022年 3月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	64,343,628円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	49,231,838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	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	1,365,577,902円	C	信託約款に定める収益調整金	1,583,983,784円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	5,655,309,118円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,352,986,317円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,377,666,036円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,986,201,939円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,100円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,295円
G	分配金額	35,120,308円	G	分配金額	34,793,292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 9月16日			自 2022年 3月16日	
	至 2021年10月15日			至 2022年 4月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	86,000,304円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	124,090,927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	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	1,411,696,065円	C	信託約款に定める収益調整金	1,636,119,127円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	5,928,192,106円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,322,498,029円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	7,658,451,618円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,082,708,083円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,181円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,321円
G	分配金額	35,103,161円	G	分配金額	34,821,928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10月16日			自 2022年 4月16日	
	至 2021年11月15日			至 2022年 5月16日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	37,635,922円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	19,528,155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	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	1,442,503,664円	C	信託約款に定める収益調整金	1,757,617,610円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,152,673,001円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,372,702,822円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,053,552,395円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,149,848,587円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,302円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,316円
G	分配金額	34,970,152円	G	分配金額	35,175,232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11月16日			自 2022年 5月17日	
	至 2021年12月15日			至 2022年 6月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	21,433,080円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	24,957,184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	1,492,311,351円	C	信託約款に定める収益調整金	1,934,143,166円
D	信託約款に定める分配準備積立金	6,527,621,676円	D	信託約款に定める分配準備積立金	6,317,195,979円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,041,366,107円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,276,296,329円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,299円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,314円
G	分配金額	34,973,123円	G	分配金額	35,763,757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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	当期 自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	前期 2021年12月15日現在	当期 2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

前期(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

当期(2022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	884,814,910
合計	884,814,910

## (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12月15日現在	当期 2022年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0365円 (10,365円)
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
	0.9906円 (9,906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	1,425,455,379	5,643,377,845	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,389,817,324	6,011,415,843	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,329,691,662	5,915,320,098	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,223,742,152	5,891,388,782	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,382,747,719	5,814,380,983	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,013,320,865	5,485,292,696	
	合計	15,764,775,101	34,761,176,247	

(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 - REITマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）		
	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	477,024,660	359,639,108
投資証券	74,779,470,600	56,994,452,900
未収入金	-	1,276,789,350
未収配当金	346,545,983	318,296,387
流動資産合計	75,603,041,243	58,949,177,745
資産合計	75,603,041,243	58,949,177,745
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,774,247	4,039,590
未払利息	152	156
流動負債合計	1,774,399	4,039,746
負債合計	1,774,399	4,039,746
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	29,200,487,757	24,155,988,864
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	46,400,779,087	34,789,149,135
元本等合計	75,601,266,844	58,945,137,999
純資産合計	75,601,266,844	58,945,137,999
負債純資産合計	75,603,041,243	58,949,177,745

### 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12月15日現在	2022年 6月15日現在
1.	期首	2021年 6月16日	2021年12月16日
	期首元本額	30,411,438,906円	29,200,487,757円
	期首からの追加設定元本額	721,992,920円	449,236,375円
	期首からの一部解約元本額	1,932,944,069円	5,493,735,268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	2,188,544,809円	2,382,747,719円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,439,666,461円	1,379,342,070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）	148,748,786円	147,619,721円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	25,337,188,237円	19,994,005,194円	
財産3分法（適格機関投資家専用）	86,339,464円	252,274,160円	
計	29,200,487,757円	24,155,988,864円	
2.	受益権の総数	29,200,487,757口	24,155,988,864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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

（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

（2022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	7,924,209,227
合計	7,924,209,227

(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12月15日現在	2022年 6月15日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額	2,5890円	1口当たり純資産額	2,4402円
(1万口当たり純資産額)	(25,890円)	(1万口当たり純資産額)	(24,402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	1,102	141,166,200	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,733	166,194,700	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,545	360,881,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	419	48,436,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,889	1,210,849,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,434	927,782,800	
	産業ファンド投資法人 投資証券	7,768	1,336,096,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,471	1,830,049,500	
	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	3,915	791,221,500	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,916	1,148,904,000	
	G L P 投資法人 投資証券	17,722	2,732,732,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,545	815,672,500	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	8,952	2,846,736,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	917	605,220,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	950	247,760,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	6,435	940,153,500	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,105	785,149,000	
	日本リート投資法人 投資証券	1,688	605,148,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,609	1,253,979,500	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,143	145,503,900	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,185	574,218,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,340	201,134,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,239	161,937,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	17,695	2,824,122,000	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	906	80,905,800	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,699	1,113,373,800	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	5,655	333,645,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	641	85,637,600		

三井不動産ロジстикスパーク投資法人 投資証券	2,155	1,090,430,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	883	58,807,800	
投資法人みらい 投資証券	6,628	319,469,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	1,284	156,519,600	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,590	686,880,000	
C R E ロジстикスファンド投資法人 投資証券	2,119	401,550,500	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	883	108,079,200	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,158	242,775,000	
アドバンス・ロジстикス投資法人 投資証券	2,134	315,832,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,379	4,293,067,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,472	3,299,616,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	27,608	2,788,408,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	10,902	1,908,940,200	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,739	1,450,732,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	5,245	750,559,500	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,669	674,362,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3,749	386,896,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,318	1,662,930,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	3,911	529,549,400	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,084	923,621,400	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,918	966,672,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,730	517,351,000	
日本ロジстикスファンド投資法人 投資証券	3,689	1,130,678,500	
福岡リート投資法人 投資証券	2,830	454,215,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,693	1,061,511,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,484	363,204,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,157	749,736,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,472	352,012,800	
スターツプロシード投資法人 投資証券	852	196,130,400	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,216	2,382,640,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	16,763	1,022,543,000	
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,394	823,691,600	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,020	610,432,000	
合計	319,746	56,994,452,900	

(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12月15日現在	2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	298,267,351	444,676,322
コール・ローン	27,270,047	38,856,343
投資証券	73,285,759,983	53,475,567,885
派生商品評価勘定	-	49,833
未収入金	39,962,733	381,269,245
未収配当金	196,898,157	122,957,091
流動資産合計	73,848,158,271	54,463,376,719
資産合計	73,848,158,271	54,463,376,719
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	50,310
未払解約金	8,994,986	453,923
未払利息	8	16
流動負債合計	8,994,994	504,249
負債合計	8,994,994	504,249
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,079,655,919	19,989,699,038
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	47,759,507,358	34,473,173,432
元本等合計	73,839,163,277	54,462,872,470
純資産合計	73,839,163,277	54,462,872,470
負債純資産合計	73,848,158,271	54,463,376,719

## 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12月15日現在	2022年 6月15日現在
1.	期首	2021年 6月16日	2021年12月16日
	期首元本額	31,154,221,388円	26,079,655,919円
	期首からの追加設定元本額	702,352,287円	1,611,278,058円
	期首からの一部解約元本額	5,776,917,756円	7,701,234,939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	2,184,147,786円	2,013,320,865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)	12,659,497円	10,492,459円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	23,569,301,752円	17,686,876,446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)	313,546,884円	279,009,268円	
計	26,079,655,919円	19,989,699,038円	
2.	受益権の総数	26,079,655,919口	19,989,699,038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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6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、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12月15日現在	2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「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 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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(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

(2022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	9,519,365,764
合計	9,519,365,764

(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12月15日現在)

該当事項はありません。

(2022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				
	売建	602,170,680	-	602,171,157	477
	米ドル	405,030,000	-	404,985,900	44,100
	加ドル	11,460,504	-	11,460,823	319
	ユーロ	29,574,300	-	29,568,567	5,733
	英ポンド	27,564,276	-	27,573,439	9,163
	豪ドル	28,845,500	-	28,858,520	13,020
	香港ドル	8,596,000	-	8,599,650	3,650
	シンガポールドル	91,100,100	-	91,124,258	24,158
合計	602,170,680	-	602,171,157	477	

(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られ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12月15日現在		2022年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.8313円	1口当たり純資産額	2.7245円
(1万口当たり純資産額)	(28,313円)	(1万口当たり純資産額)	(27,245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	27,062	435,427.58	
		AGREE REALTY CORPORATION	21,854	1,464,218.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,028	401,129.88	
		ALEXANDER'S INC	655	142,135.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	44,779	6,061,733.23	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,963	51,733.98	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,111	463,996.80	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	42,691	2,750,154.22	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	90,627	2,985,253.38	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	82,172	2,378,057.68	
		APARTMENT INCOME REIT CO	48,369	1,907,673.36	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	46,127	270,304.22	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	65,347	968,442.54	

ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	20,024	255,706.48	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,202	53,095.54	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,975	7,958,540.25	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	8,820	230,378.40	
BOSTON PROPERTIES INC	43,737	3,964,321.68	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,955	86,809.60	
BRANDYWINE REALTY TRUST	52,850	502,603.50	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	91,258	1,820,597.10	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	49,769	961,039.39	
BRT APARTMENTS CORP	3,122	64,656.62	
CAMDEN PROPERTY TRUST	31,409	3,957,534.00	
CARETRUST REIT INC	29,943	499,748.67	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,667	184,391.35	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,783	94,537.17	
CENTERSPACE	4,743	365,875.02	
CHATHAM LODGING TRUST	14,649	160,699.53	
CITY OFFICE REIT INC	12,836	147,100.56	
CLIPPER REALTY INC	3,403	25,726.68	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,412	243,706.56	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	34,653	889,889.04	
COUSINS PROPERTIES INC	45,588	1,346,669.52	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,241	36,424.95	
CTO REALTY GROWTH INC	1,685	96,921.20	
CUBESMART	67,331	2,617,155.97	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	63,962	567,982.56	
DIGITAL REALTY TRUST INC	87,285	10,873,092.45	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	78,919	145,210.96	
DOUGLAS EMMETT INC	54,054	1,225,404.18	
DUKE REALTY CORPORATION	117,024	5,991,628.80	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	26,758	503,853.14	
EASTGROUP PROPERTIES INC	12,509	1,903,619.62	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	44,630	298,574.70	
EPR PROPERTIES	23,143	1,008,109.08	
EQUINIX INC	27,681	17,120,975.31	

EQUITY COMMONWEALTH	34,809	950,285.70	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53,083	3,645,209.61	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	105,078	7,227,264.84	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	37,103	745,028.24	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,075	5,143,415.75	
EXTRA SPACE STORAGE INC	41,147	6,531,674.78	
FARMLAND PARTNERS INC	7,648	106,001.28	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,738	2,068,588.08	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	40,022	1,877,031.80	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	23,602	581,789.30	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	28,941	115,764.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	72,071	3,118,512.17	
GETTY REALTY CORPORATION	12,422	312,413.30	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	10,617	193,017.06	
GLADSTONE LAND CORP	9,764	215,296.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,148	196,361.36	
GLOBAL NET LEASE INC	32,073	421,118.49	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	45,810	1,140,669.00	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	68,126	1,843,489.56	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	166,155	3,894,673.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,016	100,360.32	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	32,471	1,092,324.44	
HOST HOTELS & RESORTS INC	219,255	3,766,800.90	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	46,970	763,732.20	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,500	1,418,175.00	
INDUS REALTY TRUST INC	2,000	115,460.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	20,854	289,662.06	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,365	955,952.20	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,348	529,048.00	
INVITATION HOMES INC	183,337	6,165,623.31	
IRON MOUNTAIN INC	88,982	4,207,068.96	
JBG SMITH PROPERTIES	35,265	816,384.75	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	258,400	177,004.00	
KILROY REALTY CORPORATION	32,306	1,601,731.48	
KIMCO REALTY CORP	189,196	3,632,563.20	

KITE REALTY GROUP TRUST	66,924	1,164,477.60	
LIFE STORAGE INC	25,178	2,578,730.76	
LTC PROPERTIES INC	12,150	433,755.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	87,019	891,074.56	
MACERICH CO/THE	65,245	604,168.70	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	545,747	319,261.99	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	183,924	2,747,824.56	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,446	5,672,423.38	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	53,954	2,138,197.02	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,027	1,141,231.20	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,153	799,361.44	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	37,153	251,525.81	
NETSTREIT CORP	11,500	216,200.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,935	422,965.65	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,407	298,895.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	73,658	2,037,380.28	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,324	110,305.24	
ORION OFFICE REIT INC	17,913	207,611.67	
PARAMOUNT GROUP INC	50,203	365,477.84	
PARK HOTELS & RESORTS INC	72,352	1,109,879.68	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,272	775,236.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	25,416	7,370.64	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	35,024	1,121,118.24	
PHYSICIANS REALTY TRUST	67,514	1,117,356.70	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	38,325	497,075.25	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,741	191,726.85	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,657	81,008.24	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	16,624	413,771.36	
PRIME US REIT	195,200	135,664.00	
PROLOGIS INC	227,419	25,166,186.54	
PS BUSINESS PARKS INC	6,190	1,150,968.60	
PUBLIC STORAGE	46,887	13,964,824.08	
REALTY INCOME CORP	173,794	10,912,525.26	
REGENCY CENTERS CORP	47,350	2,680,010.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	36,566	564,579.04	

REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	49,122	2,845,637.46	
RLJ LODGING TRUST	50,781	594,645.51	
RPT REALTY	26,147	252,057.08	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,827	1,341,448.44	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70,747	929,615.58	
SAFEHOLD INC	4,389	151,683.84	
SAUL CENTERS INC	4,075	173,432.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	52,050	289,918.50	
SIMON PROPERTY GROUP INC	101,024	9,749,826.24	
SITE CENTERS CORP	54,796	687,141.84	
SL GREEN REALTY CORP	19,825	974,200.50	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	39,164	1,418,911.72	
STAG INDUSTRIAL INC	54,220	1,648,830.20	
STORE CAPITAL CORP	75,586	1,873,776.94	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,165	249,069.15	
SUN COMMUNITIES INC	35,647	5,384,122.88	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,028	693,069.52	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	31,991	465,469.05	
TERRENO REALTY CORP	23,077	1,266,465.76	
UDR INC	92,013	3,893,990.16	
UMH PROPERTIES INC	14,190	241,088.10	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,004	199,279.08	
URBAN EDGE PROPERTIES	33,294	496,413.54	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	9,386	149,518.98	
VENTAS INC	122,670	5,940,908.10	
VERIS RESIDENTIAL INC	24,488	344,301.28	
VICI PROPERTIES INC	258,715	7,277,652.95	
VORNADO REALTY TRUST	49,139	1,423,065.44	
WASHINGTON REIT	26,049	575,422.41	
WELLTOWER INC	133,746	10,358,627.70	
WHITESTONE REIT	14,650	156,022.50	
WP CAREY INC	58,591	4,744,113.27	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,678	537,509.00	
米ドル小計	8,282,667	302,128,333.59	(40,790,346,317)

加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,428	671,043.12	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,931	228,307.86	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,633	73,454.32	
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,814	301,860.20	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	8,798	32,200.68	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	26,332	1,163,347.76	
		CHOICE PROPERTIES REIT	49,128	672,562.32	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,376	257,922.00	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,271	259,034.32	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	38,115	466,908.75	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,681	150,547.60	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	14,405	57,187.85	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,251	488,076.75	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,790	775,465.90	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,477	538,183.59	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	6,035	42,727.80	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,457	264,779.38	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,216	309,125.52	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	6,740	103,796.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	6,174	104,958.00	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,165	93,666.30	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	33,599	409,235.82	
		PLAZA RETAIL REIT	16,858	72,489.40	
		PRIMARIS REIT	14,543	186,004.97	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,331	931,716.41	
		SLATE GROCERY REIT	8,330	118,286.00	
SLATE OFFICE REIT	10,768	50,286.56			
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,885	594,615.45			
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	27,603	466,490.70			
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,341	68,839.87			
加ドル小計			573,475	9,953,121.20	(1,037,115,229)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	11,194	1,062,310.60	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,601	58,616.74	
		ALTAREA	1,241	157,110.60	

		BEFIMMO S.C.A.	7,836	368,292.00	
		CARE PROPERTY INVEST	8,630	199,784.50	
		CARMILA	13,401	179,305.38	
		COFINIMMO	9,132	1,028,263.20	
		COIMA RES SPA	5,887	58,045.82	
		COVIVIO	14,509	822,660.30	
		CROMWELL REIT EUR	96,360	195,610.80	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,230	272,484.40	
		GECINA SA	16,755	1,603,453.50	
		HAMBORNER REIT AG	23,113	191,606.77	
		HIBERNIA REIT PLC	205,453	328,313.89	
		ICADE	10,106	476,598.96	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,183	46,338.24	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	84,235	546,685.15	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,178	178,014.40	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	148,551	192,224.99	
		KLEPIERRE	59,627	1,122,180.14	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	20,809	101,131.74	
		MERCIALYS	15,186	123,538.11	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	103,192	995,802.80	
		MONTEA	3,114	264,378.60	
		NSI NV	5,190	179,314.50	
		RETAIL ESTATES	3,406	208,787.80	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,781	1,914,283.50	
		VASTNED RETAIL	5,393	120,533.55	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	42,976	1,321,941.76	
		WERELDHAVE NV	12,186	171,335.16	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	6,582	271,836.60	
		ユーロ小計	1,007,037	14,760,784.50 (2,078,318,457)	
英債券	投資証券	AEW UK REIT PLC	45,281	54,790.01	
		ASSURA PLC	915,575	607,941.80	
		BIG YELLOW GROUP PLC	52,973	662,162.50	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	243,750	280,312.50	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	287,748	1,457,731.36	

		CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	261,269	387,723.19	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	191,789	153,622.98	
		CUSTODIAN REIT PLC	136,467	141,106.87	
		DERWENT LONDON PLC	34,787	960,816.94	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	183,125	160,600.62	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	78,708	487,989.60	
		HAMMERSON PLC	1,102,741	252,086.59	
		HOME REIT PLC	173,650	197,613.70	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	124,452	151,831.44	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	230,971	1,689,783.83	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	300,725	692,870.40	
		LXI REIT PLC	279,315	398,303.19	
		NEWRIVER REIT PLC	92,155	81,188.55	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	172,503	163,360.34	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	412,004	561,973.45	
		PRS REIT PLC/THE	171,020	182,649.36	
		REGIONAL REIT LTD	134,627	107,297.71	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	64,388	653,538.20	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	189,603	106,367.28	
		SEGRO PLC	370,209	3,534,755.53	
		SHAFTESBURY PLC	88,007	505,160.18	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	114,313	90,993.14	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	306,595	387,842.67	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	116,006	101,273.23	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	572,503	1,036,802.93	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	256,093	207,179.23	
		UNITE GROUP PLC	122,333	1,295,506.47	
		WORKSPACE GROUP PLC	42,629	280,072.53	
			8,627,060	18,033,248.32	
		英債券小計		(2,925,173,209)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	125,543	338,966.10	
		ARENA REIT	108,807	422,171.16	
		BWP TRUST	157,486	579,548.48	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	201,674	390,239.19	

		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	172,965	506,787.45	
		CENTURIA OFFICE REIT	140,685	246,198.75	
		CHARTER HALL GROUP	145,135	1,657,441.70	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	190,151	825,255.34	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	163,244	620,327.20	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	105,456	330,077.28	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	459,623	321,736.10	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	74,408	197,925.28	
		DEXUS/AU	333,022	3,020,509.54	
		GDI PROPERTY GROUP	177,407	170,310.72	
		GOODMAN GROUP	523,297	9,372,249.27	
		GPT GROUP	591,734	2,461,613.44	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	89,476	311,376.48	
		HEALTHCO REIT	87,968	137,230.08	
		HOME CONSORTIUM LTD	57,590	262,034.50	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	448,637	558,553.06	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	58,540	187,328.00	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	117,583	419,771.31	
		IRONGATE GROUP	176,442	333,475.38	
		MIRVAC GROUP	1,220,812	2,502,664.60	
		NATIONAL STORAGE REIT	335,840	722,056.00	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	123,766	102,106.95	
		RURAL FUNDS GROUP	116,819	314,243.11	
		SCENTRE GROUP	1,601,114	4,082,840.70	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	346,561	918,386.65	
		STOCKLAND	736,255	2,650,518.00	
		VICINITY CENTRES	1,199,217	2,092,633.66	
		WAYPOINT REIT	236,646	532,453.50	
豪ドル小計			10,623,903	37,589,028.98	(3,499,538,598)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	415,171	832,417.85	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209,606	562,792.11	
ニュージーランドドル小計			624,777	1,395,209.96	(117,127,876)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	599,000	2,102,490.00	

		FORTUNE REIT	444,000	3,001,440.00	
		LINK REIT	648,900	44,384,760.00	
		PROSPERITY REIT	396,000	1,049,400.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	325,000	1,228,500.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	751,110	2,298,396.60	
香港ドル小計			3,164,010	54,064,986.60	(929,917,769)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	148,025	199,833.75	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,036,032	2,849,088.00	
		ASCOTT TRUST	596,692	674,261.96	
		CAPITALAND CHINA TRUST	352,185	397,969.05	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,565,592	3,319,055.04	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	243,800	304,750.00	
		EC WORLD REIT	113,900	67,201.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,593,718	637,487.20	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	318,000	203,520.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	415,740	118,485.90	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	331,105	738,364.15	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	899,960	1,151,948.80	
		IREIT GLOBAL	169,833	103,598.13	
		KEPPEL DC REIT	413,477	798,010.61	
		KEPPEL REIT	611,600	691,108.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	525,552	412,558.32	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	677,831	1,192,982.56	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	602,508	1,458,069.36	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	995,387	1,612,526.94	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	744,035	286,453.47	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	119,300	572,640.00			
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	167,000	131,930.00			
SPH REIT	296,100	278,334.00			
STARHILL GLOBAL REIT	451,500	257,355.00			
SUNTEC REIT	670,100	1,105,665.00			
シンガポールドル小計			14,058,972	19,563,196.24	(1,896,651,875)
韓国ウォ	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	20,244	105,268,800.00	

ン		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,652	286,238,040.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,383	66,021,400.00	
		JR GLOBAL REIT-RTS(N)	7,170	717,000.00	
		JR REIT XXVII	37,368	205,524,000.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	16,937	106,364,360.00	
		LOTTE REIT CO LTD	40,192	240,750,080.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	39,238,020.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,263	104,777,700.00	
		SK REITS CO LTD	20,771	139,581,120.00	
韓国ウォン小計			221,206	1,294,480,520.00	(135,402,662)
イスラエルシュケル	投資証券	REIT 1 LTD	60,581	1,072,283.70	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	68,110	621,912.41	
イスラエルシュケル小計			128,691	1,694,196.11	(65,975,893)
合計				53,475,567,885	(53,475,567,885)

(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 151銘柄	100.0%	76.4%
加ドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 31銘柄	100.0%	3.9%
英ポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.5%
豪ドル	投資証券 32銘柄	100.0%	6.5%
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 6銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	投資証券 25銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 10銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシュケル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

	（単位：円）	
	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	106,635,154	130,304,779
国債証券	37,524,136,555	38,633,394,520
地方債証券	4,605,713,063	4,580,457,895
特殊債券	5,196,563,125	3,641,133,000
社債券	1,214,065,000	705,950,000
未収入金	100,680,000	-
未収利息	135,774,239	127,491,713
前払費用	2,400,248	2,872,254
流動資産合計	48,885,967,384	47,821,604,161
資産合計	48,885,967,384	47,821,604,161
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,546,966	12,796,357
未払利息	34	56
流動負債合計	10,547,000	12,796,413
負債合計	10,547,000	12,796,413
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	34,511,107,270	34,912,052,752
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	14,364,313,114	12,896,754,996
元本等合計	48,875,420,384	47,808,807,748
純資産合計	48,875,420,384	47,808,807,748
負債純資産合計	48,885,967,384	47,821,604,161

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
1.	期首	2021年 6月16日	2021年12月16日
	期首元本額	33,583,669,363円	34,511,107,270円
	期首からの追加設定元本額	1,926,329,524円	2,397,099,489円
	期首からの一部解約元本額	998,891,617円	1,996,154,007円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	4,215,072,621円	4,574,153,668円
	DCインデックスバランス(株式40)	3,876,100,217円	4,092,233,547円
	DCインデックスバランス(株式60)	2,828,692,190円	3,029,017,619円
	DCインデックスバランス(株式80)	468,466,795円	491,586,018円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,255,495,297円	2,196,744,337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	4,128,095,902円	4,389,817,324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)	1,703,336,062円	1,670,587,208円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,064,550円	5,227,949円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	30,168,828円	29,858,408円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	99,222,763円	99,177,989円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	244,684,329円	247,230,346円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,006,663,218円	3,596,938,679円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,450,041,417円	1,479,202,447円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,435,883,956円	1,429,643,138円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	807,572,901円	804,871,283円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	116,348,085円	118,811,725円
	インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,499,708,722円	6,304,150,448円
	日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	340,489,417円	352,800,619円
	計	34,511,107,270円	34,912,052,752円
2.	受益権の総数	34,511,107,270口	34,912,052,752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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
-------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

(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

(2022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	1,600,794,050
地方債証券	19,328,105
特殊債券	19,888,000
社債券	2,819,000
合計	1,642,829,155

(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12月15日現在	2022年 6月15日現在
1口当たり純資産額	1.4162円
	1口当たり純資産額
	1.3694円

(1万口当たり純資産額)

(14,162円)

(1万口当たり純資産額)

(13,694円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	70,000,000	89,980,800	
	第2回利付国債(40年)	140,000,000	173,812,800	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	106,238,100	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	118,607,500	
	第5回利付国債(40年)	75,000,000	89,831,250	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	129,332,500	
	第7回利付国債(40年)	80,000,000	90,130,400	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	99,584,700	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	100,543,300	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	113,436,250	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	122,761,800	
	第12回利付国債(40年)	175,000,000	137,441,500	
	第13回利付国債(40年)	180,000,000	140,679,000	
	第14回利付国債(40年)	150,000,000	125,190,000	
	第330回利付国債(10年)	210,000,000	212,347,800	
	第331回利付国債(10年)	80,000,000	80,692,800	
	第333回利付国債(10年)	210,000,000	212,475,900	
	第334回利付国債(10年)	120,000,000	121,593,600	
	第335回利付国債(10年)	490,000,000	496,105,400	
	第336回利付国債(10年)	180,000,000	182,466,000	
	第337回利付国債(10年)	230,000,000	231,994,100	
	第338回利付国債(10年)	390,000,000	394,683,900	
第339回利付国債(10年)	570,000,000	577,296,000		

第340回利付国債(10年)	520,000,000	527,040,800	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	707,497,000	
第342回利付国債(10年)	530,000,000	531,791,400	
第343回利付国債(10年)	545,000,000	546,635,000	
第344回利付国債(10年)	400,000,000	401,020,000	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	611,232,200	
第346回利付国債(10年)	690,000,000	690,979,800	
第347回利付国債(10年)	430,000,000	430,210,700	
第348回利付国債(10年)	290,000,000	289,846,300	
第349回利付国債(10年)	640,000,000	638,944,000	
第350回利付国債(10年)	640,000,000	638,169,600	
第351回利付国債(10年)	535,000,000	532,608,550	
第352回利付国債(10年)	590,000,000	586,530,800	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	397,044,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	321,971,000	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	346,024,000	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	346,129,000	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	551,163,200	
第358回利付国債(10年)	600,000,000	590,004,000	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	412,944,000	
第360回利付国債(10年)	200,000,000	196,378,000	
第361回利付国債(10年)	270,000,000	264,856,500	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	392,332,000	
第363回利付国債(10年)	300,000,000	294,348,000	
第364回利付国債(10年)	300,000,000	296,058,000	
第365回利付国債(10年)	300,000,000	295,956,000	
第366回利付国債(10年)	400,000,000	398,092,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	59,158,000	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	80,901,100	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	93,213,600	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	59,848,500	
第8回利付国債(30年)	80,000,000	91,632,000	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	131,519,160	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	181,131,930	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	43,212,750	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	61,258,500	

第18回利付国債(30年)	110,000,000	133,587,300	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	48,646,800	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	49,764,800	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	85,407,000	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	87,347,400	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	68,772,550	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	85,142,800	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	73,518,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	210,915,600	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	112,017,180	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	181,560,960	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	219,684,960	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	181,596,450	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	146,593,200	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	198,398,400	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	160,686,450	
第34回利付国債(30年)	180,000,000	220,384,800	
第35回利付国債(30年)	128,000,000	152,491,520	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	161,264,250	
第37回利付国債(30年)	161,000,000	189,239,400	
第38回利付国債(30年)	135,000,000	156,250,350	
第39回利付国債(30年)	115,000,000	135,199,750	
第40回利付国債(30年)	130,000,000	150,345,000	
第41回利付国債(30年)	90,000,000	102,330,900	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	153,532,800	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	176,162,150	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	170,515,500	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	131,629,200	
第46回利付国債(30年)	120,000,000	131,611,200	
第47回利付国債(30年)	125,000,000	139,551,250	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	91,329,950	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	150,374,000	
第50回利付国債(30年)	95,000,000	90,055,250	
第51回利付国債(30年)	90,000,000	75,605,400	
第52回利付国債(30年)	130,000,000	114,294,700	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	94,227,000	

第54回利付国債(30年)	110,000,000	103,176,700	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	102,921,500	
第56回利付国債(30年)	90,000,000	83,997,900	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	93,096,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	92,860,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	153,758,200	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	113,490,000	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	89,852,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	102,157,200	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	74,326,500	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	82,381,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	90,579,500	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	148,163,400	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	95,066,400	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	120,741,600	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	97,384,100	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	97,201,500	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	105,835,200	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	140,993,600	
第73回利付国債(30年)	120,000,000	105,656,400	
第74回利付国債(30年)	80,000,000	75,908,800	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	31,595,820	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	55,354,860	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	102,990,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	34,964,920	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	35,179,460	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	81,117,660	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	109,150,080	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	117,454,400	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	118,811,590	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	124,366,100	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,589,500	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	22,122,030	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	42,247,600	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	169,761,600	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	64,142,400	

第87回利付国債(20年)	130,000,000	140,696,400	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	327,345,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,470,720	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	274,045,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	65,522,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	65,492,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	54,814,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	91,062,640	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	272,933,920	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	49,934,250	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	103,815,480	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	129,650,040	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	33,530,400	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	74,521,260	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	91,774,620	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,397,770	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	36,800,280	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	86,129,120	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,249,500	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	145,831,400	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	148,595,280	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	30,010,770	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	110,233,340	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	28,358,750	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	90,196,800	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	328,503,300	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	58,897,800	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	142,500,000	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	154,448,100	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	389,812,640	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,338,700	
第119回利付国債(20年)	30,000,000	33,546,300	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	187,435,200	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	24,828,100	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	19,048,330	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	223,947,750	

第124回利付国債(20年)	90,000,000	102,613,500	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	58,083,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	120,183,000	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	56,803,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	74,092,200	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	96,144,350	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	170,893,500	
第131回利付国債(20年)	92,000,000	103,983,000	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	152,903,700	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	34,256,700	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	137,196,000	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	34,014,300	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	247,350,400	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	226,882,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	133,800,000	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	258,681,000	
第140回利付国債(20年)	358,000,000	406,283,460	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	221,465,400	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	143,231,250	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	105,798,880	
第144回利付国債(20年)	370,000,000	412,620,300	
第145回利付国債(20年)	315,000,000	357,997,500	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	153,500,400	
第147回利付国債(20年)	98,000,000	110,395,040	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	100,385,100	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	128,320,450	
第150回利付国債(20年)	140,000,000	154,558,600	
第151回利付国債(20年)	140,000,000	151,183,200	
第152回利付国債(20年)	300,000,000	323,826,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	294,586,200	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	172,534,400	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	284,029,200	
第156回利付国債(20年)	160,000,000	155,438,400	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	141,331,500	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	166,562,600	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	148,611,000	

	第160回利付国債(20年)	140,000,000	140,375,200	
	第161回利付国債(20年)	120,000,000	118,369,200	
	第162回利付国債(20年)	150,000,000	147,625,500	
	第163回利付国債(20年)	165,000,000	161,898,000	
	第164回利付国債(20年)	255,000,000	245,840,400	
	第165回利付国債(20年)	170,000,000	163,456,700	
	第166回利付国債(20年)	100,000,000	98,916,000	
	第167回利付国債(20年)	160,000,000	152,998,400	
	第168回利付国債(20年)	100,000,000	93,811,000	
	第169回利付国債(20年)	160,000,000	147,139,200	
	第170回利付国債(20年)	140,000,000	128,311,400	
	第171回利付国債(20年)	170,000,000	155,272,900	
	第172回利付国債(20年)	230,000,000	213,207,700	
	第173回利付国債(20年)	150,000,000	138,589,500	
	第174回利付国債(20年)	200,000,000	184,170,000	
	第175回利付国債(20年)	140,000,000	130,802,000	
	第176回利付国債(20年)	160,000,000	149,009,600	
	第177回利付国債(20年)	150,000,000	136,824,000	
	第178回利付国債(20年)	120,000,000	111,297,600	
	第179回利付国債(20年)	190,000,000	175,924,800	
	第180回利付国債(20年)	140,000,000	136,962,000	
国債証券 合計		37,314,000,000	38,633,394,520	
地方債証券	第4回東京都公募公債(東京グリーンbond(5年))	100,000,000	99,853,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,389,000	
	第32回東京都公募公債(5年)	300,000,000	299,637,000	
	第726回東京都公募公債	200,000,000	202,196,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	101,141,000	
	第731回東京都公募公債	100,000,000	101,090,000	
	第736回東京都公募公債	100,000,000	101,075,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,626,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	101,570,000	
	令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,882,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,589,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	101,528,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,153,000	

	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	202,578,000	
	平成26年度第12回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,264,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	200,000,000	202,504,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,481,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,038,000	
	第10回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,967,000	
	平成25年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,045,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,188,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,243,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,147,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,590,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,166,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,489,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,134,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,978,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,396,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,915,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,382,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債（10年）	35,000,000	35,097,895	
	第486回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,194,000	
	平成27年度第5回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,318,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,918,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,846,000	
	平成25年度第2回福井県公募公債	200,000,000	201,850,000	
	<b>地方債証券 合計</b>	<b>4,535,000,000</b>	<b>4,580,457,895</b>	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,121,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,134,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,061,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,406,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,498,000	
	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	110,242,000	
	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	111,305,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,151,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,214,000	

	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,971,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,006,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,030,000	
	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	101,287,000	
	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,165,000	
	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	99,826,000	
	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	199,160,000	
	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	99,434,000	
	第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,676,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,110,000	
	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,151,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,738,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,948,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,884,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,310,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	101,263,000	
	第357回信金中金債（5年）	100,000,000	99,870,000	
	第363回信金中金債（5年）	100,000,000	99,758,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	101,542,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,872,000	
特殊債券 合計		3,600,000,000	3,641,133,000	
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	101,193,000	
	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・債務返済機構重畳の債務引受条項付）	100,000,000	101,113,000	
	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	100,828,000	
	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	101,100,000	
	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	101,000,000	
	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	99,922,000	
	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	100,794,000	

社債券 合計	700,000,000	705,950,000	
合計	46,149,000,000	47,560,935,415	

## 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12月15日現在	2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	61,986,827	119,020,128
コール・ローン	48,048,218	116,550,628
国債証券	156,876,621,690	149,301,537,049
派生商品評価勘定	258,144	-
未収入金	81,893,903	-
未収利息	818,045,134	871,478,328
前払費用	18,989,205	30,671,789
流動資産合計	157,905,843,121	150,439,257,922
<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	93,646,319	90,395,334
未払利息	15	50
流動負債合計	93,735,984	90,395,384
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	61,191,933,864	59,214,530,778
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	96,620,173,273	91,134,331,760
元本等合計	157,812,107,137	150,348,862,538
純資産合計	157,812,107,137	150,348,862,538
負債純資産合計	157,905,843,121	150,439,257,922

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
1.	期首	2021年 6月16日	2021年12月16日
	期首元本額	61,765,152,571円	61,191,933,864円
	期首からの追加設定元本額	3,395,651,409円	1,469,666,301円
	期首からの一部解約元本額	3,968,870,116円	3,447,069,387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)	15,021,626,084円	15,750,883,415円
	DCインデックスバランス(株式20)	356,781,056円	375,522,121円
	DCインデックスバランス(株式40)	473,360,426円	490,755,336円
	DCインデックスバランス(株式60)	621,705,070円	655,897,983円
	DCインデックスバランス(株式80)	514,101,494円	530,976,469円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	19,742,737,608円	17,835,725,517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	2,291,024,266円	2,329,691,662円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	14,330,021,810円	13,511,673,535円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	884,686,139円	824,400,230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)	157,019,480円	148,762,525円
	財産3分法(適格機関投資家専用)	52,645,473円	152,358,277円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,776,752円	2,813,548円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,297,985円	3,191,447円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,061,878円	5,832,584円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	10,315,096円	10,157,016円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	1,734,024,463円	1,714,862,926円

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	734,471,822円	645,345,736円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	61,320,675円	61,395,257円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	87,538,839円	85,866,838円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	88,677,118円	86,968,061円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	63,909,573円	64,029,067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	3,671,000,312円	3,638,679,580円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	282,830,445円	288,741,648円
計	61,191,933,864円	59,214,530,778円
2. 受益権の総数	61,191,933,864口	59,214,530,778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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(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

(2022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	23,227,502,456
合計	23,227,502,456

(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られ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。

(2022年 6月15日現在)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2021年12月15日現在		2022年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.5790円	1口当たり純資産額	2.5391円
(1万口当たり純資産額)	(25,790円)	(1万口当たり純資産額)	(25,391円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.625%-23/05/31	1,500,000.00	1,478,730.46	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	1,300,000.00	1,295,541.27	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/06/15	2,500,000.00	2,429,318.72	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/06/30	1,500,000.00	1,472,519.53	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/06/30	2,350,000.00	2,336,533.01	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/15	2,680,000.00	2,593,632.81	
		US TREASURY N/B-1.25%-23/07/31	3,000,000.00	2,935,429.68	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	3,000,000.00	2,985,878.91	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/07/31	6,200,000.00	5,989,902.33	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,300,000.00	5,260,871.10	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/08/15	3,860,000.00	3,727,312.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/08/31	4,550,000.00	4,453,401.36	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/09/15	3,000,000.00	2,887,382.82	
		US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,441,699.22	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	657,138.27	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/09/30	3,500,000.00	3,367,656.25	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,343,234.36	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,662,281.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	895,218.75	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,971,406.24	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	7,000,000.00	6,707,421.84	
		US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,635,978.90	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,799,712.70	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/11/30	5,000,000.00	4,801,562.50	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,860,195.32	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	1,967,578.12	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,443,370.31	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,965,390.62	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,485,940.63	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,267,128.89	
		US TREASURY N/B-0.125%-24/02/15	5,000,000.00	4,739,941.40	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,469,238.28	

US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,603,385.16	
US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,735,937.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	3,775,260.95	
US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,949,296.88	
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	2,937,421.86	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,323,226.54	
US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,830,000.00	2,664,842.95	
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	3,766,900.80	
US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,411,757.83	
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,235,761.71	
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,571,783.60	
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,422,692.18	
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	2,640,000.00	2,548,734.38	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,514,606.25	
US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,679,296.90	
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,372,185.93	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,192,412.11	
US TREASURY N/B-0.375%-24/09/15	6,000,000.00	5,596,171.86	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	1,955,730.66	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,104,308.60	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,058,747.65	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,041,651.95	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,513,406.25	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,354,007.81	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,304,361.70	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,840,402.33	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,243,505.86	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,459,863.28	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,318,663.86	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,350,569.50	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,016,305.46	
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,443,689.84	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,960,221.10	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,186,707.04	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,157,117.18	

US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	1,961,791.02	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,648,296.85	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,150,000.00	1,127,404.29	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	2,020,000.00	1,831,256.25	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,337,087.88	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,409,681.24	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,703,632.82	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,502,368.75	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,922,656.25	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,120,757.80	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	320,000.00	286,724.99	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,372,738.27	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	3,800,000.00	3,395,210.92	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,288,828.13	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,288,031.25	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,060,232.03	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,934,843.76	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,787,959.95	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	5,000,000.00	4,449,804.70	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,945,898.28	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,082,437.50	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,720,917.18	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,255,201.18	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,969,896.08	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,156,437.48	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	6,100,000.00	5,827,882.78	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,455,939.04	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,485,318.75	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,589,192.97	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,503,484.36	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,869,687.50	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	2,960,000.00	2,762,859.38	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,886,628.12	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,668,125.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,665,078.14	

US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,492,171.87	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,673,632.82	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,251,798.82	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	4,950,000.00	4,451,519.55	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,836,462.51	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,635,803.52	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	1,995,906.25	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,845,078.12	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,641,875.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,060,000.00	1,937,848.42	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	892,851.56	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	1,210,000.00	1,051,943.75	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,000,000.00	861,601.56	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,331,368.55	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,374,624.99	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,657,281.25	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	2,000,000.00	1,699,218.76	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,768,929.69	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,100,000.00	1,790,742.19	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,454,931.63	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	4,260,000.00	3,613,844.52	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	2,400,000.00	2,692,031.04	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,816,975.78	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	187,515.62	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,367,392.17	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,435,525.38	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,823,437.52	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,342,273.43	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	3,960,000.00	3,472,270.32	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,949,144.93	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	4,940,000.00	4,744,715.62	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,756,285.16	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,878,218.75	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,501,846.88	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,028,718.75	

US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,361,845.70	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,469,843.76	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	4,000,000.00	3,492,812.48	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,170,772.17	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	4,384,741.78	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	6,000,000.00	5,275,078.14	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,370,000.00	4,122,992.55	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	550,000.00	509,781.25	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	3,580,000.00	3,316,674.20	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,140,000.00	2,760,378.89	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	1,390,000.00	1,230,530.08	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,754,439.04	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,258,708.55	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,678,992.58	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,052,117.18	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	4,951,009.37	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	637,503.10	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	8,400,000.00	6,928,851.55	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	6,415,707.00	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,600,000.00	6,272,968.71	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,677,437.50	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,500,000.00	5,644,843.75	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	901,718.72	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	886,435.50	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	743,333.57	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	809,662.46	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	795,984.37	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,579,876.93	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,593,533.94	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	827,211.90	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	773,619.47	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,750,738.98	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,450,816.39	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,482,581.23	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,972,382.81	

US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,089,142.89	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,126,466.79	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,725,234.30	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	3,149,835.94	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	951,664.37	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,906,697.28	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	964,331.23	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	990,000.00	719,006.83	
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,277,421.86	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	458,281.25	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	686,468.75	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,712,109.38	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,605,667.37	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,787,503.89	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,916,560.54	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	2,094,163.48	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	1,061,268.75	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,200,000.00	2,077,882.81	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,947,765.62	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	2,036,937.50	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,820,000.00	2,281,666.39	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,240,968.75	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	2,390,000.00	2,072,951.56	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	1,056,264.45	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	2,500,000.00	2,021,093.75	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,212,246.09	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,650,460.93	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,810,000.00	1,574,841.39	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,783,828.12	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,780,000.00	1,588,163.27	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,705,312.50	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	2,840,000.00	2,424,539.06	
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,470,595.71	
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,214,000.00	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,691,761.72	

		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,859,310.53
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,992,687.50
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,659,218.75
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	2,294,201.16
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,482,300.78
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,710,972.64
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,466,458.99
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	1,591,643.17
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,988,906.25
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	3,362,294.91
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	3,273,273.45
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,459,531.24
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,000,000.00	707,500.00
	米ドル小計		620,310,000.00	564,536,890.87 (76,218,125,636)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,020,000.00	1,003,133.28
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-23/08/01	810,000.00	782,723.25
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-23/09/01	1,470,000.00	1,446,649.05
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	500,000.00	480,708.00
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/02/01	590,000.00	565,186.37
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	775,039.77
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	950,000.00	898,093.90
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,010,000.00	992,305.81
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	762,299.26
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	400,000.00	376,307.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	575,339.19
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	918,184.50
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,925,000.00	1,750,500.67
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	882,459.53
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	713,010.76
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,440,000.00	1,297,160.64
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	420,000.00	377,943.30
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	750,000.00	663,433.50
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	647,409.79
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	620,000.00	701,069.34

		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	574,000.00	526,374.07	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	1,838,132.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,085,538.12	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,576,000.00	1,320,862.93	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,950,000.00	1,622,362.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	230,000.00	199,157.69	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	844,570.56	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	396,324.74	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	650,000.00	692,579.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	731,749.81	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	900,000.00	793,773.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,403,000.00	1,781,634.66	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	886,000.00	607,516.91	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	286,900.03	
加ドル小計			32,409,000.00	29,336,434.58	(3,056,856,483)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	15,200,000.00	14,886,120.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	18,900,000.00	18,303,468.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	16,700,000.00	16,851,343.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	21,377,890.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,000,000.00	2,548,350.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,600,000.00	19,058,218.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	18,370,000.00	17,612,237.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	20,700,000.00	18,817,593.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,300,000.00	4,717,828.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	3,900,000.00	4,135,218.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	13,970,000.00	13,077,229.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	13,200,000.00	11,337,562.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	14,570,000.00	12,721,431.25	
メキシコペソ小計			188,660,000.00	175,444,493.42	(1,151,880,821)

ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	116,475.23
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	660,000.00	670,378.10
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	665,000.00	659,169.94
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	845,000.00	867,608.82
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	780,000.00	764,650.38
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,265,000.00	1,236,480.57
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	740,805.60
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	977,000.00	950,332.78
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	789,085.98
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	448,227.45
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,270,000.00	1,525,272.54
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	903,486.07
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,060,000.00	981,114.80
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	680,085.02
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	899,014.00
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	640,000.00	516,915.20
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	600,000.00	688,632.00
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	855,000.00	767,533.50
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	573,235.32
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,185,000.00	1,511,223.39
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	366,135.80
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	441,779.71
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	223,743.30
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,187,000.00	1,452,261.26
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	605,000.00	709,914.56
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	519,588.38
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	514,155.20
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	335,000.00	237,196.41
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	361,665.54
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	403,744.01
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	475,000.00	236,115.85
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.35%-23/07/30	1,190,000.00	1,182,317.36
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	1,295,000.00	1,350,099.66

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,105,000.00	1,164,465.57
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	1,250,000.00	1,300,525.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 24/05/31	1,000,000.00	968,221.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	1,180,000.00	1,143,323.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,520,000.00	1,553,920.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 25/01/31	1,230,000.00	1,168,876.38
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,350,000.00	1,334,349.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,490,000.00	1,603,389.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,575,000.00	1,576,081.86
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 26/01/31	1,395,000.00	1,285,041.91
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,335,000.00	1,318,284.46
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,490,000.00	1,700,653.22
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,720,000.00	1,646,550.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 27/01/31	175,000.00	156,192.57
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,410,628.05
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,315,000.00	1,208,750.63
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,400,000.00	1,324,932.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	910,000.00	788,759.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,470,000.00	1,377,148.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,275,000.00	1,190,146.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,155,000.00	1,325,197.33

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,545,000.00	1,865,961.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,345,000.00	1,244,543.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,540,000.00	1,325,895.34
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,400,000.00	1,178,913.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,330,000.00	1,248,758.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,530,000.00	1,351,159.83
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,455,000.00	1,139,308.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,045,000.00	834,935.14
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%- 32/04/30	780,000.00	624,842.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,450,000.00	1,800,798.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,235,000.00	1,148,841.46
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,415,000.00	1,208,080.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,250,000.00	1,394,300.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%- 37/07/30	670,000.00	473,651.81
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,260,000.00	1,540,171.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%- 40/10/31	1,000,000.00	703,214.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,300,000.00	1,555,778.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 42/07/30	300,000.00	197,418.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	930,000.00	1,194,977.46
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,120,000.00	1,029,894.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	985,000.00	863,347.57

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	655,664.49
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	370,000.00	255,985.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	794,779.52
BUNDESobligation-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,095,063.84
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,276,138.50
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,321,238.64
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,550,000.00	1,493,877.60
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	1,045,000.00	999,283.34
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,515,609.60
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	270,000.00	250,837.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	1,850,000.00	1,879,655.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	856,640.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,230,000.00	1,246,067.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,575,000.00	1,587,078.67
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,020,000.00	1,015,455.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,770,000.00	1,733,890.23
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	1,740,000.00	1,721,119.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	2,340,000.00	2,264,754.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,320,000.00	2,184,918.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,795,000.00	2,640,721.59
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,128,577.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	2,090,000.00	1,981,671.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,150,000.00	1,057,711.35
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,150,000.00	1,399,376.35

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,845,000.00	1,738,567.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,148,520.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,539,816.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,080,000.00	976,827.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,875,000.00	1,717,355.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,830,000.00	1,632,116.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	660,000.00	877,103.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,410,000.00	1,246,198.89	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,920,000.00	1,681,572.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	420,000.00	368,440.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,451,093.01	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	2,120,000.00	1,840,367.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	1,065,000.00	914,269.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	344,093.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,475,000.00	1,957,922.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	951,770.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	777,765.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,290,301.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	1,669,595.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,405,000.00	2,028,881.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,185,105.34	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	2,135,000.00	2,411,888.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,407,000.00	2,753,728.35
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	1,814,367.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,330,000.00	804,273.61
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	360,000.00	218,729.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	300,000.00	174,056.63
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/09/15	1,215,000.00	1,203,891.25
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/12/15	900,000.00	889,500.75
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-24/03/15	830,000.00	815,635.19
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	179,319.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 23/06/15	1,000,000.00	993,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,430,000.00	1,481,996.23
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.3%- 23/08/15	990,000.00	976,992.39
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	1,310,000.00	1,322,527.53
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,160,000.00	1,144,585.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	944,714.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/15	1,110,000.00	1,075,327.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/30	250,000.00	241,831.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,717,669.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/04/15	1,360,000.00	1,304,990.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,066,126.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,180,000.00	1,164,246.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-	200,000.00	189,622.00

24/08/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,450,000.00	1,488,909.01	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,223,208.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,080,000.00	1,075,819.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/12/15	650,000.00	607,145.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,395,978.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,631,006.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	765,000.00	734,426.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,249,523.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	967,846.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,100,000.00	1,082,276.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	935,000.00	903,877.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	1,150,000.00	1,048,199.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,630,000.00	1,712,712.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,220,000.00	1,081,814.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,330,000.00	1,254,591.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,169,191.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	500,000.00	437,797.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	840,906.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,565,000.00	1,436,659.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,058,384.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-	200,000.00	179,796.40	

27/04/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,099,797.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	1,295,000.00	1,212,987.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,145,000.00	1,010,123.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,560,000.00	1,801,347.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,430,000.00	1,325,381.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,022,954.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,470,000.00	1,226,330.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,416,802.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,415,000.00	1,351,872.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	300,000.00	242,920.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,465,000.00	1,400,219.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,950,000.00	2,150,717.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,540,000.00	1,517,252.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,475,000.00	1,231,097.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	928,396.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,452,000.00	1,215,549.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,375,000.00	1,064,243.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	2,125,000.00	2,455,919.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,245,000.00	923,185.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	767,179.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-	1,610,000.00	1,307,667.76	

32/03/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	650,000.00	485,714.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,575,000.00	1,796,361.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	971,052.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	1,710,950.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	902,330.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	648,729.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	769,380.02	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,005,000.00	1,974,483.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	100,000.00	65,162.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,029,079.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,500,000.00	1,647,744.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	610,000.00	525,938.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,420,000.00	1,560,287.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	574,157.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,345,000.00	1,452,169.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	270,415.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	966,467.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	1,170,000.00	908,681.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	1,003,940.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	850,000.00	799,144.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-	870,000.00	619,260.78	

50/09/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	850,000.00	499,608.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 52/09/01	280,000.00	180,082.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	680,000.00	494,824.44
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-23/09/15	345,000.00	341,656.26
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	323,000.00	328,192.54
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	255,000.00	247,879.63
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	382,000.00	410,695.45
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	273,721.56
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	435,000.00	415,897.84
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	92,798.40
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	373,138.00
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	397,966.78
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	246,598.83
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	336,255.75
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	144,353.06
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	595,000.00	528,872.89
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	284,137.10
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	204,371.14
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	220,000.00	149,594.93
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	342,000.00	349,522.39
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	210,000.00	142,096.29
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	211,837.86
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	130,856.50
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	208,102.23
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	3,200,000.00	3,347,424.00
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25	1,140,000.00	1,120,364.64
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,343,362.13
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,514,000.00	2,562,537.79
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,758,000.00	2,780,932.77
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,635,000.00	2,527,294.37
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,532,796.20
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,090,000.00	2,390,897.30
	2,670,000.00	2,613,777.81

FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25			
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,692,149.40	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	3,070,000.00	3,277,783.74	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,335,205.25	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	3,010,000.00	2,811,568.76	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-27/02/25	1,390,000.00	1,275,116.50	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	2,275,000.00	2,183,317.50	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,350,000.00	3,497,902.50	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	3,150,000.00	2,940,008.40	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	3,030,000.00	2,802,059.16	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,375,000.00	2,903,378.12	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	2,780,000.00	2,506,890.02	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,212,122.96	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,365,000.00	3,470,590.33	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,538,502.88	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,490,000.00	3,294,814.77	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-31/11/25	2,445,000.00	1,978,398.64	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-32/05/25	723,000.00	574,671.47	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,440,000.00	3,207,941.20	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,425,000.00	2,128,871.12	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	1,735,000.00	2,179,784.60	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,183,947.57	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,906,732.77	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,060,000.00	1,847,729.36	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	3,035,000.00	3,879,288.44	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	960,000.00	620,481.60	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,730,000.00	1,912,871.38	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,830,000.00	1,613,373.75	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,520,274.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	2,250,000.00	1,363,898.25	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-53/05/25	425,000.00	251,326.30	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,651,741.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,382,085.83	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	825,000.00	624,467.25	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	500,000.00	519,865.00	

IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	685,000.00	758,005.24
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	695,000.00	678,657.77
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	490,000.00	452,379.14
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	489,040.76
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	600,000.00	564,919.20
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	626,000.00	641,878.49
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	239,377.95
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	475,000.00	443,338.40
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	555,000.00	447,665.22
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	254,009.10
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	239,757.10
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	352,504.62
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	174,090.25
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	636,000.00	567,977.88
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	494,000.00	379,286.28
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,010,000.00	1,020,884.77
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	980,000.00	963,697.70
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	1,104,000.00	1,120,490.44
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,305,000.00	1,257,122.16
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	250,000.00	235,954.68
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,140,000.00	1,089,858.24
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	968,000.00	895,488.08
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	925,000.00	880,760.95
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	775,000.00	927,464.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	902,562.55
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	535,000.00	472,666.61
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	575,434.17
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	875,000.00	749,770.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	640,000.00	536,259.18
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	380,000.00	325,873.46
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	965,000.00	1,002,962.13
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,110,000.00	1,367,631.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	100,000.00	71,291.70
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	888,000.00	671,328.88
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,200,000.00	1,499,011.20

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,219,000.00	1,374,472.47
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	777,000.00	421,384.19
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	99,448.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	115,039.33
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	326,514.63
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	78,123.84
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-23/07/15	480,000.00	476,034.08
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	815,000.00	824,532.24
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	541,363.65
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	795,000.00	802,358.52
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	400,000.00	383,696.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	702,208.46
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	616,656.70
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	963,000.00	923,548.77
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	644,185.64
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	540,000.00	658,567.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	618,608.10
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	835,000.00	754,757.33
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	577,660.68
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	548,771.97
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	300,000.00	263,434.20
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	610,000.00	613,951.58
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	198,750.24
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	930,000.00	1,130,150.88
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	219,552.48
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	429,000.00	486,809.89
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	420,631.73
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	150,000.00	132,944.25
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	405,000.00	265,610.74
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	240,000.00	316,027.20
		ユーロ小計	381,276,000.00	369,362,370.62 (52,006,221,783)
英債券	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	495,383.07
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	243,000.00	150,147.27
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,145,000.00	1,146,712.46

UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,530,000.00	1,481,300.10	
UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,030,000.00	1,009,681.39	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	885,790.15	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,292,662.78	
UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	778,157.09	
UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	660,278.70	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	798,232.60	
UK TREASURY-0.375%-26/10/22	630,000.00	580,923.00	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	890,000.00	848,983.46	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	910,000.00	1,001,849.21	
UK TREASURY-0.125%-28/01/31	845,000.00	749,633.30	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	693,358.56	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	867,009.40	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	770,878.33	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	779,000.80	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,075,000.00	1,267,316.21	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,715,000.00	1,399,399.16	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,573,858.74	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	120,000.00	99,907.96	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	949,000.00	1,129,060.60	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,007,000.00	774,231.95	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	1,140,422.59	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,435,000.00	1,256,342.50	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,343,709.00	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,170,601.82	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	1,135,470.17	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	820,000.00	635,332.38	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,280,000.00	1,625,961.98	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,245,000.00	1,342,981.50	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,302,761.20	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	294,425.92	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	920,000.00	1,164,490.00	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,340,000.00	1,040,606.21	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	552,071.70	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	1,156,501.10	

		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	540,000.00	321,197.40	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,272,000.00	1,554,848.02	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	493,483.90	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	1,304,568.20	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	862,300.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	1,010,635.72	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	830,000.00	412,326.07	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	980,000.00	1,242,326.40	
		UNITED KINGDOM GILT-0.75%-23/07/22	1,295,000.00	1,277,429.89	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	605,000.00	601,672.50	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	882,000.00	878,445.54	
英債券小計			45,705,000.00	46,354,668.50	(7,519,190,777)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	6,200,000.00	6,188,875.34	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,620,000.00	4,685,913.54	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	5,000,000.00	4,787,218.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,950,000.00	3,676,699.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	4,100,000.00	3,759,554.04	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,215,863.57	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,848,240.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	3,085,000.00	3,728,863.25	
スウェーデンクローナ小計			31,355,000.00	30,891,227.24	(409,308,760)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,140,000.00	4,159,665.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,190,000.00	3,084,002.68	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,600,521.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,261,004.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,340,000.00	2,201,687.28	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,570,000.00	2,342,169.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,550,000.00	3,105,682.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,732,200.72	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	1,700,000.00	1,556,180.00	
ノルウェークローネ小計			24,680,000.00	23,043,112.18	(310,851,583)
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	3,340,000.00	3,364,782.80	

ククローネ		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,260,000.00	1,216,177.20	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,660,000.00	3,673,812.84	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,510,000.00	4,192,908.21	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,830,000.00	2,544,736.00	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,150,000.00	949,343.02	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	10,280,000.00	13,739,795.68	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	762,963.50	
デンマーククローネ小計			28,330,000.00	30,444,519.25	(576,314,749)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,650,000.00	1,587,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	1,928,160.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-24/07/25	310,000.00	267,144.98	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,130,000.00	1,894,720.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,195,315.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,570,000.00	2,255,997.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	3,090,000.00	2,522,397.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,750,000.00	1,273,072.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,665,176.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,661,904.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	503,079.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,965,000.00	2,161,247.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,245,375.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	750,000.00	448,897.50	
ポーランドズロチ小計			25,645,000.00	20,609,789.23	(620,226,875)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	755,000.00	750,646.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,715,000.00	1,595,096.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	994,679.77	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,110,000.00	991,803.77	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,130,000.00	1,155,999.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,140,000.00	999,185.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,270,000.00	1,331,157.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	933,337.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	950,000.00	873,552.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	676,617.17	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,130,000.00	1,089,963.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	825,539.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,450,000.00	1,312,912.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,180,000.00	932,031.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,378,000.00	1,123,892.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,790,000.00	1,377,754.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,480,000.00	1,153,814.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	940,000.00	762,720.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,082,565.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	790,000.00	718,082.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	460,766.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	721,785.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	662,000.00	591,473.66	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	644,625.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	820,000.00	671,376.41	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	609,940.99	
豪ドル小計			27,405,000.00	24,381,321.18	(2,269,901,001)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	430,000.00	431,082.26	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	560,000.00	554,310.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	542,322.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	310,000.00	305,660.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	349,000.00	322,231.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	455,477.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	205,000.00	190,609.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	475,000.00	483,360.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	283,765.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	450,000.00	444,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	529,740.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	264,672.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	361,035.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	446,170.56	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	196,680.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	287,000.00	268,967.79	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	439,000.00	409,806.50	

		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	392,000.00	306,936.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	150,000.00	118,897.50	
シンガポールドドル小計			7,263,000.00	6,916,322.91	(670,537,506)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	700,000.00	705,915.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	775,387.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	839,960.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	420,000.00	422,769.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,550,000.00	1,559,300.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	777,589.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,070,000.00	1,064,430.65	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	920,000.00	910,800.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,278,420.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	857,935.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	698,864.26	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,004,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	909,120.04	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	890,000.00	888,220.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	587,971.81	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,380,000.00	1,192,320.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	653,807.15	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	750,000.00	718,862.19	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	790,000.00	776,303.21	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,260,000.00	1,082,970.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	940,000.00	952,690.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	920,000.00	936,820.63	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	330,000.00	327,818.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	924,635.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,620,000.00	1,575,774.00			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	916,802.52			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,020,188.50			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	920,589.29			
マレーシアアリンギット小計			26,115,000.00	25,281,114.66	(772,006,870)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.36%-23/07/02	3,000,000.00	3,009,223.50	

		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-23/10/18	9,000,000.00	9,144,886.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	9,000,000.00	9,092,011.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	9,000,000.00	9,157,986.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	7,000,000.00	7,026,974.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	5,000,000.00	5,075,514.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	7,000,000.00	6,917,204.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	9,000,000.00	9,162,868.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	8,000,000.00	8,148,364.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	10,000,000.00	10,049,240.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	8,000,000.00	8,187,716.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	4,000,000.00	4,040,554.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	5,000,000.00	5,165,565.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	6,000,000.00	6,094,395.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	8,000,000.00	8,074,768.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	6,000,000.00	6,214,365.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	7,000,000.00	6,914,386.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	8,000,000.00	8,273,068.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	5,000,000.00	5,065,787.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	4,000,000.00	3,978,867.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	6,000,000.00	6,518,880.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	6,000,000.00	6,425,757.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	4,000,000.00	4,154,890.00	
中国元小計			153,000,000.00	155,893,272.30	(3,121,981,028)
イスラエル シケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.15%-23/07/31	1,160,000.00	1,135,970.47	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	1,120,000.00	1,115,076.59	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,448,530.35	
		ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	280,000.00	264,477.43	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,270,724.43	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,202,789.83	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	481,920.62	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,072,151.09	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,209,402.71	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,040,000.00	985,655.73	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,291,261.46	

	ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	150,000.00	125,801.40	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	805,857.78	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,462,014.70	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,500,000.00	1,487,837.70	
イスラエルシェケル小計		15,745,000.00	15,359,472.29	(598,133,177)
合計			149,301,537,049	(149,301,537,049)

(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 220銘柄	100.0%	51.2%
加ドル	国債証券 34銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 338銘柄	100.0%	34.8%
英ポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	5.0%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
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%	0.4%
豪ドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 23銘柄	100.0%	2.1%
イスラエルシェケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	210,304,672	82,190,901
株式	41,523,001,320	40,571,484,680
派生商品評価勘定	3,693,950	-
未収配当金	4,783,878	352,157,819
前払金	-	15,752,000
流動資産合計	41,741,783,820	41,021,585,400
<b>資産合計</b>		
41,741,783,820		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	21,575,200
前受金	2,250,000	-
未払解約金	1,134,316	10,176,696
未払利息	67	35
流動負債合計	3,384,383	31,751,931
<b>負債合計</b>		
3,384,383		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	21,660,098,146	22,429,103,841
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	20,078,301,291	18,560,729,628
元本等合計	41,738,399,437	40,989,833,469
<b>純資産合計</b>		
41,738,399,437		
<b>負債純資産合計</b>		
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</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	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

		2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
1.	期首	2021年 6月16日	2021年12月16日
	期首元本額	21,062,249,461円	21,660,098,146円
	期首からの追加設定元本額	1,559,967,577円	1,713,014,095円
	期首からの一部解約元本額	962,118,892円	944,008,400円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	713,535,414円	777,678,129円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,891,794,953円	2,027,436,158円
	DCインデックスバランス(株式60)	3,728,234,867円	4,044,186,651円
	DCインデックスバランス(株式80)	4,102,788,647円	4,371,341,836円
	インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,432,042,255円	1,494,965,320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	3,075,583,467円	3,223,742,152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)	636,617,068円	603,320,077円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	44,981,652円	45,986,576円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	39,061,126円	39,658,089円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	47,318,716円	47,186,971円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	41,000,535円	42,247,582円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,900,045,612円	2,647,178,954円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	243,251,470円	252,276,862円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	691,633,341円	706,908,176円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,054,250,147円	1,065,297,432円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,017,958,876円	1,039,692,876円
	計	21,660,098,146円	22,429,103,841円
2.	受益権の総数	21,660,098,146口	22,429,103,841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	650,530,000円	571,065,000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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(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

（2022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	3,277,860,977
合計	3,277,860,977

(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

（2022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	466,042,000	-	444,480,000	21,562,000
合計		466,042,000	-	444,480,000	21,562,000

## (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12月15日現在		2022年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.9270円	1口当たり純資産額	1.8275円
(1万口当たり純資産額)	(19,270円)	(1万口当たり純資産額)	(18,275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	800	3,295.00	2,636,000	
日本水産	21,500	531.00	11,416,500	
マルハニチロ	3,200	2,320.00	7,424,000	
雪国まいたけ	1,600	864.00	1,382,400	
カネコ種苗	600	1,628.00	976,800	
サカタのタネ	2,500	4,565.00	11,412,500	
ホクト	1,800	1,900.00	3,420,000	
ホクリヨウ	300	634.00	190,200	
住石ホールディングス	4,000	186.00	744,000	
日鉄鉱業	500	5,550.00	2,775,000	
三井松島ホールディングス	900	2,720.00	2,448,000	
I N P E X	81,200	1,662.00	134,954,400	
石油資源開発	2,700	3,450.00	9,315,000	
K & O エナジーグループ	900	1,560.00	1,404,000	
ショーボンドホールディングス	2,800	6,080.00	17,024,000	
ミライト・ホールディングス	7,300	1,618.00	11,811,400	

サンヨーホームズ	400	723.00	289,200
日本アクア	1,100	595.00	654,500
ファーストコーポレーション	700	723.00	506,100
ベステラ	500	1,128.00	564,000
キャンディル	500	530.00	265,000
ダイセキ環境ソリューション	500	930.00	465,000
第一カッター興業	600	1,293.00	775,800
安藤・間	10,700	822.00	8,795,400
東急建設	6,400	612.00	3,916,800
コムシスホールディングス	7,300	2,457.00	17,936,100
ピーアールホールディングス	3,200	308.00	985,600
高松コンストラクショングループ	1,400	2,047.00	2,865,800
東建コーポレーション	600	7,650.00	4,590,000
ソネック	300	1,016.00	304,800
ヤマウラ	1,100	918.00	1,009,800
オリエンタル白石	8,000	239.00	1,912,000
大成建設	14,200	4,000.00	56,800,000
大林組	49,800	951.00	47,359,800
清水建設	46,300	716.00	33,150,800
飛島建設	1,500	999.00	1,498,500
長谷工コーポレーション	14,600	1,559.00	22,761,400
松井建設	1,900	665.00	1,263,500
銭高組	200	3,320.00	664,000
鹿島建設	36,500	1,438.00	52,487,000
不動テトラ	1,200	1,556.00	1,867,200
大末建設	600	1,538.00	922,800
鉄建建設	1,100	1,800.00	1,980,000
西松建設	3,200	4,215.00	13,488,000
三井住友建設	12,000	454.00	5,448,000
大豊建設	800	4,445.00	3,556,000
ナカノフドー建設	1,500	300.00	450,000
奥村組	2,700	2,913.00	7,865,100
東鉄工業	2,200	2,269.00	4,991,800
イチケン	400	1,814.00	725,600
富士ピー・エス	800	465.00	372,000
浅沼組	600	5,280.00	3,168,000
戸田建設	20,700	705.00	14,593,500
熊谷組	2,600	2,695.00	7,007,000
北野建設	400	2,051.00	820,400
植木組	500	1,447.00	723,500
矢作建設工業	2,300	750.00	1,725,000
ピーエス三菱	1,800	593.00	1,067,400

日本ハウスホールディングス	3,700	390.00	1,443,000
大東建託	5,300	11,020.00	58,406,000
新日本建設	2,300	720.00	1,656,000
東亜道路工業	300	5,400.00	1,620,000
日本道路	500	6,500.00	3,250,000
東亜建設工業	1,200	2,384.00	2,860,800
日本国土開発	4,500	509.00	2,290,500
若築建設	900	2,131.00	1,917,900
東洋建設	6,000	795.00	4,770,000
五洋建設	19,800	630.00	12,474,000
福田組	600	4,420.00	2,652,000
住友林業	12,100	1,955.00	23,655,500
日本基礎技術	1,500	569.00	853,500
巴コーポレーション	2,200	402.00	884,400
大和ハウス工業	43,600	3,041.00	132,587,600
ライト工業	3,000	1,789.00	5,367,000
積水ハウス	51,900	2,333.00	121,082,700
日特建設	1,200	781.00	937,200
北陸電気工事	1,100	743.00	817,300
ユアテック	3,100	702.00	2,176,200
日本リーテック	1,100	1,031.00	1,134,100
四電工	600	1,682.00	1,009,200
中電工	2,200	2,077.00	4,569,400
関電工	8,600	815.00	7,009,000
きんでん	11,000	1,506.00	16,566,000
東京エネシス	1,700	953.00	1,620,100
トーエネック	600	3,215.00	1,929,000
住友電設	1,300	2,482.00	3,226,600
日本電設工業	2,500	1,585.00	3,962,500
エクシオグループ	7,500	2,091.00	15,682,500
新日本空調	1,300	1,820.00	2,366,000
九電工	3,600	2,668.00	9,604,800
三機工業	3,400	1,474.00	5,011,600
日揮ホールディングス	15,200	1,873.00	28,469,600
中外炉工業	500	1,695.00	847,500
ヤマト	1,400	743.00	1,040,200
太平電業	1,000	2,721.00	2,721,000
高砂熱学工業	4,300	1,595.00	6,858,500
三晃金属工業	200	2,570.00	514,000
朝日工業社	700	1,575.00	1,102,500
明星工業	2,900	729.00	2,114,100
大気社	2,300	3,075.00	7,072,500

ダイダ	1,100	2,050.00	2,255,000
日比谷総合設備	1,500	1,886.00	2,829,000
フィル・カンパニー	300	1,116.00	334,800
テスホールディングス	1,500	1,196.00	1,794,000
インフロニア・ホールディングス	20,300	910.00	18,473,000
東洋エンジニアリング	2,300	620.00	1,426,000
レイズネクスト	2,400	1,120.00	2,688,000
ニッポン	4,300	1,559.00	6,703,700
日清製粉グループ本社	16,800	1,499.00	25,183,200
日東富士製粉	200	4,215.00	843,000
昭和産業	1,400	2,413.00	3,378,200
鳥越製粉	1,300	630.00	819,000
中部飼料	1,800	989.00	1,780,200
フィード・ワン	2,000	650.00	1,300,000
東洋精糖	300	950.00	285,000
日本甜菜製糖	900	1,636.00	1,472,400
D M三井製糖ホールディングス	1,400	1,860.00	2,604,000
塩水港精糖	2,000	208.00	416,000
日新製糖	800	1,724.00	1,379,200
森永製菓	3,500	3,835.00	13,422,500
中村屋	400	3,050.00	1,220,000
江崎グリコ	4,100	3,565.00	14,616,500
名糖産業	700	1,608.00	1,125,600
井村屋グループ	900	2,204.00	1,983,600
不二家	900	2,265.00	2,038,500
山崎製パン	11,000	1,482.00	16,302,000
第一屋製パン	300	505.00	151,500
モロゾフ	500	3,385.00	1,692,500
亀田製菓	900	4,485.00	4,036,500
寿スピリッツ	1,500	7,120.00	10,680,000
カルビー	7,600	2,391.00	18,171,600
森永乳業	2,900	4,335.00	12,571,500
六甲バター	1,100	1,390.00	1,529,000
ヤクルト本社	11,200	7,360.00	82,432,000
明治ホールディングス	9,700	6,210.00	60,237,000
雪印メグミルク	3,800	1,685.00	6,403,000
プリマハム	2,100	2,100.00	4,410,000
日本ハム	6,000	4,030.00	24,180,000
林兼産業	500	486.00	243,000
丸大食品	1,600	1,481.00	2,369,600
S Foods	1,500	3,010.00	4,515,000
柿安本店	600	2,347.00	1,408,200

伊藤ハム米久ホールディングス	10,700	662.00	7,083,400
サッポロホールディングス	5,200	2,764.00	14,372,800
アサヒグループホールディングス	35,800	4,223.00	151,183,400
麒麟ホールディングス	61,400	2,033.00	124,826,200
宝ホールディングス	10,000	950.00	9,500,000
オエノンホールディングス	4,500	291.00	1,309,500
養命酒製造	500	1,730.00	865,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,000	1,423.00	15,653,000
サントリー食品インターナショナル	11,200	4,660.00	52,192,000
ダイドーグループホールディングス	900	4,870.00	4,383,000
伊藤園	5,100	5,160.00	26,316,000
キーコーヒー	1,600	2,058.00	3,292,800
ユニカフェ	500	907.00	453,500
ジャパンフーズ	200	1,168.00	233,600
日清オイリオグループ	2,000	2,979.00	5,958,000
不二製油グループ本社	3,600	1,867.00	6,721,200
J - オイルミルズ	1,600	1,503.00	2,404,800
キッコーマン	10,700	6,650.00	71,155,000
味の素	34,300	3,044.00	104,409,200
ブルドックソース	600	1,806.00	1,083,600
キューピー	7,800	2,143.00	16,715,400
ハウス食品グループ本社	5,600	2,703.00	15,136,800
カゴメ	6,300	3,225.00	20,317,500
焼津水産化学工業	700	902.00	631,400
アリアケジャパン	1,500	5,200.00	7,800,000
ピエトロ	200	1,803.00	360,600
エバラ食品工業	400	2,950.00	1,180,000
やまみ	200	1,548.00	309,600
ニチレイ	6,700	2,215.00	14,840,500
東洋水産	7,600	4,825.00	36,670,000
イートアンドホールディングス	600	2,232.00	1,339,200
大冷	200	1,896.00	379,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	511.00	459,900
日清食品ホールディングス	5,800	8,430.00	48,894,000
永谷園ホールディングス	700	1,950.00	1,365,000
一正蒲鉾	700	800.00	560,000
フジッコ	1,600	1,912.00	3,059,200
ロック・フィールド	1,700	1,366.00	2,322,200
日本たばこ産業	89,600	2,380.00	213,248,000
ケンコーマヨネーズ	900	1,396.00	1,256,400
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,700.00	1,700,000
なとり	900	1,963.00	1,766,700

イフジ産業	300	956.00	286,800
ピックルスコーポレーション	800	1,298.00	1,038,400
ファーマフーズ	2,100	1,483.00	3,114,300
ユーグレナ	8,600	858.00	7,378,800
紀文食品	1,300	930.00	1,209,000
ミヨシ油脂	600	1,036.00	621,600
理研ビタミン	1,500	1,590.00	2,385,000
片倉工業	1,600	2,059.00	3,294,400
ゲンゼ	1,000	3,635.00	3,635,000
東洋紡	6,400	1,020.00	6,528,000
ユニチカ	4,400	230.00	1,012,000
富士紡ホールディングス	700	3,320.00	2,324,000
倉敷紡績	1,200	1,988.00	2,385,600
シキボウ	900	882.00	793,800
日本毛織	4,300	947.00	4,072,100
ダイトウボウ	2,700	90.00	243,000
トーア紡コーポレーション	600	372.00	223,200
ダイドーリミテッド	2,300	135.00	310,500
帝国繊維	1,700	1,542.00	2,621,400
帝人	14,700	1,384.00	20,344,800
東レ	106,800	704.20	75,208,560
住江織物	300	1,651.00	495,300
日本フェルト	900	415.00	373,500
イチカワ	200	1,378.00	275,600
日東製網	200	1,328.00	265,600
アツギ	1,300	496.00	644,800
ダイニック	600	662.00	397,200
セーレン	3,100	1,907.00	5,911,700
ソトー	600	833.00	499,800
東海染工	200	1,142.00	228,400
小松マテーレ	2,500	1,259.00	3,147,500
ワコールホールディングス	3,600	2,093.00	7,534,800
ホギメディカル	2,100	2,846.00	5,976,600
クラウディアホールディングス	400	238.00	95,200
T S Iホールディングス	5,200	350.00	1,820,000
マツオカコーポレーション	500	974.00	487,000
ワールド	2,100	1,266.00	2,658,600
三陽商会	700	844.00	590,800
ナイガイ	500	289.00	144,500
オンワードホールディングス	9,200	247.00	2,272,400
ルックホールディングス	500	1,528.00	764,000
ゴールドウイン	2,800	7,790.00	21,812,000

デサント	2,900	2,770.00	8,033,000
キング	800	536.00	428,800
ヤマトインターナショナル	1,300	281.00	365,300
特種東海製紙	900	3,080.00	2,772,000
王子ホールディングス	64,600	563.00	36,369,800
日本製紙	7,000	946.00	6,622,000
三菱製紙	2,200	297.00	653,400
北越コーポレーション	10,000	679.00	6,790,000
中越パルプ工業	600	896.00	537,600
巴川製紙所	500	607.00	303,500
大王製紙	7,300	1,376.00	10,044,800
阿波製紙	300	308.00	92,400
レンゴー	13,500	710.00	9,585,000
トモク	900	1,498.00	1,348,200
ザ・パック	1,100	2,149.00	2,363,900
北の達人コーポレーション	5,800	200.00	1,160,000
クラレ	22,600	1,122.00	25,357,200
旭化成	103,300	1,057.00	109,188,100
共和レザー	1,000	575.00	575,000
昭和電工	14,300	2,577.00	36,851,100
住友化学	114,000	555.00	63,270,000
住友精化	700	2,952.00	2,066,400
日産化学	7,900	6,710.00	53,009,000
ラサ工業	600	1,932.00	1,159,200
クレハ	1,200	10,490.00	12,588,000
多木化学	600	4,530.00	2,718,000
テイカ	1,000	1,211.00	1,211,000
石原産業	2,800	1,109.00	3,105,200
片倉コープアグリ	400	1,415.00	566,000
日本曹達	1,900	4,365.00	8,293,500
東ソー	21,300	1,787.00	38,063,100
トクヤマ	5,000	1,813.00	9,065,000
セントラル硝子	2,500	3,035.00	7,587,500
東亜合成	8,200	1,031.00	8,454,200
大阪ソーダ	1,300	3,140.00	4,082,000
関東電化工業	3,200	917.00	2,934,400
デンカ	5,600	3,320.00	18,592,000
信越化学工業	26,600	17,300.00	460,180,000
日本カーバイド工業	600	1,398.00	838,800
堺化学工業	1,100	1,924.00	2,116,400
第一稀元素化学工業	1,400	1,116.00	1,562,400
エア・ウォーター	13,800	1,697.00	23,418,600

日本酸素ホールディングス	14,200	2,425.00	34,435,000
日本化学工業	500	2,091.00	1,045,500
東邦アセチレン	300	1,148.00	344,400
日本パーカラライジング	7,300	895.00	6,533,500
高压ガス工業	2,400	648.00	1,555,200
四国化成工業	1,900	1,239.00	2,354,100
戸田工業	400	2,550.00	1,020,000
ステラ ケミファ	800	2,519.00	2,015,200
保土谷化学工業	500	3,850.00	1,925,000
日本触媒	2,500	5,330.00	13,325,000
大日精化工業	1,200	1,803.00	2,163,600
カネカ	3,700	3,395.00	12,561,500
三菱瓦斯化学	13,600	2,097.00	28,519,200
三井化学	13,400	3,150.00	42,210,000
J S R	15,200	3,680.00	55,936,000
東京応化工業	2,500	6,990.00	17,475,000
大阪有機化学工業	1,200	2,380.00	2,856,000
三菱ケミカルホールディングス	103,800	801.80	83,226,840
K Hネオケム	2,600	2,541.00	6,606,600
ダイセル	22,400	881.00	19,734,400
住友ベークライト	2,400	4,530.00	10,872,000
積水化学工業	32,500	1,829.00	59,442,500
日本ゼオン	13,100	1,373.00	17,986,300
アイカ工業	4,100	2,800.00	11,480,000
U B E	7,700	2,088.00	16,077,600
積水樹脂	2,300	1,675.00	3,852,500
タキロンシーアイ	3,500	532.00	1,862,000
旭有機材	900	2,104.00	1,893,600
ニチバン	900	1,601.00	1,440,900
リケンテクノス	3,500	426.00	1,491,000
大倉工業	700	1,715.00	1,200,500
積水化成成品工業	2,000	407.00	814,000
群栄化学工業	300	2,612.00	783,600
タイガースポリマー	800	430.00	344,000
ミライアル	500	1,834.00	917,000
ダイキアクシス	600	733.00	439,800
ダイキョーニシカワ	3,400	497.00	1,689,800
竹本容器	600	798.00	478,800
森六ホールディングス	800	1,774.00	1,419,200
恵和	400	4,005.00	1,602,000
日本化薬	11,700	1,113.00	13,022,100
カーリットホールディングス	1,500	709.00	1,063,500

日本精化	1,100	2,000.00	2,200,000
扶桑化学工業	1,300	3,620.00	4,706,000
トリケミカル研究所	1,700	2,435.00	4,139,500
A D E K A	6,800	2,509.00	17,061,200
日油	5,000	4,980.00	24,900,000
新日本理化	2,600	248.00	644,800
ハリマ化成グループ	1,100	755.00	830,500
花王	35,200	5,100.00	179,520,000
第一工業製薬	600	2,125.00	1,275,000
石原ケミカル	800	1,298.00	1,038,400
日華化学	600	868.00	520,800
ニイタカ	300	2,120.00	636,000
三洋化成工業	1,000	4,680.00	4,680,000
有機合成薬品工業	1,200	271.00	325,200
大日本塗料	1,900	735.00	1,396,500
日本ペイントホールディングス	61,200	918.00	56,181,600
関西ペイント	15,000	1,767.00	26,505,000
神東塗料	1,300	152.00	197,600
中国塗料	3,600	853.00	3,070,800
日本特殊塗料	1,100	966.00	1,062,600
藤倉化成	2,100	474.00	995,400
太陽ホールディングス	2,400	2,952.00	7,084,800
D I C	6,200	2,505.00	15,531,000
サカタインクス	3,200	893.00	2,857,600
東洋インキ S C ホールディングス	3,200	1,943.00	6,217,600
T & K T O K A	1,300	797.00	1,036,100
富士フィルムホールディングス	29,300	6,919.00	202,726,700
資生堂	31,000	5,091.00	157,821,000
ライオン	17,600	1,394.00	24,534,400
高砂香料工業	1,000	2,367.00	2,367,000
マンダム	3,300	1,432.00	4,725,600
ミルボン	2,000	4,930.00	9,860,000
ファンケル	6,700	2,213.00	14,827,100
コーセー	3,100	11,400.00	35,340,000
コタ	1,200	1,434.00	1,720,800
ポーラ・オルビスホールディングス	7,100	1,512.00	10,735,200
ノエビアホールディングス	1,300	5,480.00	7,124,000
アジュバンホールディングス	400	954.00	381,600
新日本製薬	700	1,348.00	943,600
エステー	1,100	1,450.00	1,595,000
アグロ カネショウ	600	1,239.00	743,400
コニシ	2,600	1,528.00	3,972,800

長谷川香料	2,900	2,405.00	6,974,500	
星光PMC	1,000	556.00	556,000	
小林製薬	4,700	7,970.00	37,459,000	
荒川化学工業	1,200	996.00	1,195,200	
メック	1,200	2,469.00	2,962,800	
日本高純度化学	400	2,304.00	921,600	
タカラバイオ	4,300	1,847.00	7,942,100	
JCU	1,700	3,395.00	5,771,500	
新田ゼラチン	1,100	602.00	662,200	
OATアグリオ	700	1,668.00	1,167,600	
デクセリアルズ	4,300	4,055.00	17,436,500	
アース製薬	1,400	4,990.00	6,986,000	
北興化学工業	1,400	1,029.00	1,440,600	
大成ラミック	500	2,609.00	1,304,500	
クミアイ化学工業	6,200	1,148.00	7,117,600	
日本農薬	3,000	734.00	2,202,000	
アキレス	1,100	1,343.00	1,477,300	
有沢製作所	2,300	1,084.00	2,493,200	
日東電工	10,100	9,400.00	94,940,000	
レック	2,000	673.00	1,346,000	
三光合成	1,900	334.00	634,600	
きもと	2,700	223.00	602,100	
藤森工業	1,400	3,500.00	4,900,000	
前澤化成工業	1,000	1,288.00	1,288,000	
未来工業	600	1,481.00	888,600	
ウェーブロックホールディングス	600	649.00	389,400	
JSP	1,000	1,398.00	1,398,000	
エフピコ	3,100	2,603.00	8,069,300	
天馬	1,300	2,346.00	3,049,800	
信越ポリマー	3,000	1,129.00	3,387,000	
東リ	4,000	206.00	824,000	
ニフコ	5,500	3,085.00	16,967,500	
バルカー	1,400	2,734.00	3,827,600	
ユニ・チャーム	32,100	4,181.00	134,210,100	
ショーエイコーポレーション	500	572.00	286,000	
協和キリン	17,700	2,822.00	49,949,400	
武田薬品工業	131,000	3,535.00	463,085,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	142,500	1,995.00	284,287,500	
住友ファーマ	10,300	1,042.00	10,732,600	
塩野義製薬	19,900	6,493.00	129,210,700	
わかもと製薬	1,700	255.00	433,500	
日本新薬	3,900	7,240.00	28,236,000	

中外製薬	52,100	3,380.00	176,098,000
科研製薬	2,400	3,715.00	8,916,000
エーザイ	18,900	5,084.00	96,087,600
ロート製薬	8,100	3,460.00	28,026,000
小野薬品工業	33,900	3,234.00	109,632,600
久光製薬	3,800	3,315.00	12,597,000
持田製薬	1,900	3,065.00	5,823,500
参天製薬	29,700	978.00	29,046,600
扶桑薬品工業	600	2,123.00	1,273,800
日本ケミファ	200	1,889.00	377,800
ツムラ	4,900	2,832.00	13,876,800
キッセイ薬品工業	2,600	2,400.00	6,240,000
生化学工業	2,900	790.00	2,291,000
栄研化学	2,600	1,623.00	4,219,800
日水製薬	600	1,710.00	1,026,000
鳥居薬品	900	2,854.00	2,568,600
JCRファーマ	4,700	2,258.00	10,612,600
東和薬品	2,400	2,240.00	5,376,000
富士製薬工業	900	930.00	837,000
ゼリア新薬工業	2,700	2,061.00	5,564,700
第一三共	124,200	3,081.00	382,660,200
キョーリン製薬ホールディングス	3,100	1,676.00	5,195,600
大幸薬品	2,500	570.00	1,425,000
ダイト	1,100	2,680.00	2,948,000
大塚ホールディングス	32,700	4,311.00	140,969,700
大正製薬ホールディングス	3,400	4,895.00	16,643,000
ペプチドリーム	8,700	1,318.00	11,466,600
あすか製薬ホールディングス	1,700	965.00	1,640,500
サワイグループホールディングス	3,300	3,820.00	12,606,000
日本コークス工業	14,100	125.00	1,762,500
ニチレキ	1,900	1,303.00	2,475,700
ユシロ化学工業	800	965.00	772,000
ビーピー・カストロール	600	1,190.00	714,000
富士石油	3,900	327.00	1,275,300
MORESCO	500	1,227.00	613,500
出光興産	17,400	3,550.00	61,770,000
ENEOSホールディングス	250,500	538.70	134,944,350
コスモエネルギーホールディングス	6,000	3,790.00	22,740,000
横浜ゴム	8,500	1,722.00	14,637,000
TOYO TIRE	8,200	1,710.00	14,022,000
ブリヂストン	45,500	5,065.00	230,457,500
住友ゴム工業	14,000	1,190.00	16,660,000

藤倉コンポジット	1,300	847.00	1,101,100
オカモト	900	3,795.00	3,415,500
フコク	700	947.00	662,900
ニッタ	1,600	2,845.00	4,552,000
住友理工	3,300	573.00	1,890,900
三ツ星ベルト	2,000	2,790.00	5,580,000
バンドー化学	2,700	913.00	2,465,100
日東紡績	2,200	2,443.00	5,374,600
A G C	14,500	5,030.00	72,935,000
日本板硝子	7,600	387.00	2,941,200
石塚硝子	300	1,652.00	495,600
日本山村硝子	600	695.00	417,000
日本電気硝子	6,300	2,767.00	17,432,100
オハラ	600	1,188.00	712,800
住友大阪セメント	2,800	3,585.00	10,038,000
太平洋セメント	9,400	2,059.00	19,354,600
日本ヒューム	1,400	661.00	925,400
日本コンクリート工業	3,000	281.00	843,000
三谷セキサン	700	4,325.00	3,027,500
アジアパイルホールディングス	2,400	447.00	1,072,800
東海カーボン	13,100	1,163.00	15,235,300
日本カーボン	900	4,235.00	3,811,500
東洋炭素	1,000	2,704.00	2,704,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,140.00	3,726,000
T O T O	10,700	4,265.00	45,635,500
日本碍子	16,900	1,894.00	32,008,600
日本特殊陶業	12,000	2,571.00	30,852,000
ダントーホールディングス	1,000	258.00	258,000
M A R U W A	600	14,900.00	8,940,000
品川リフラクトリーズ	400	3,525.00	1,410,000
黒崎播磨	300	4,225.00	1,267,500
ヨータイ	1,000	1,387.00	1,387,000
東京窯業	1,800	272.00	489,600
ニッカトー	700	474.00	331,800
フジインコーポレーテッド	1,300	5,660.00	7,358,000
クニミネ工業	500	913.00	456,500
エーアンドエーマテリアル	300	863.00	258,900
ニチアス	3,600	2,296.00	8,265,600
ニチハ	2,200	2,492.00	5,482,400
日本製鉄	70,400	2,015.00	141,856,000
神戸製鋼所	29,400	658.00	19,345,200
合同製鐵	900	1,311.00	1,179,900

ジェイ エフ イー ホールディングス	40,200	1,512.00	60,782,400
東京製鐵	5,100	1,529.00	7,797,900
共英製鋼	1,700	1,301.00	2,211,700
大和工業	2,800	4,410.00	12,348,000
東京鐵鋼	700	1,210.00	847,000
大阪製鐵	900	1,421.00	1,278,900
淀川製鋼所	1,900	2,209.00	4,197,100
丸一鋼管	4,900	2,900.00	14,210,000
モリ工業	400	2,412.00	964,800
大同特殊鋼	2,400	3,515.00	8,436,000
日本高周波鋼業	700	338.00	236,600
日本冶金工業	1,200	2,134.00	2,560,800
山陽特殊製鋼	1,500	2,000.00	3,000,000
愛知製鋼	1,000	2,038.00	2,038,000
日立金属	17,700	1,990.00	35,223,000
日本金属	400	1,104.00	441,600
大平洋金属	1,000	2,638.00	2,638,000
新日本電工	9,800	357.00	3,498,600
栗本鐵工所	700	1,617.00	1,131,900
虹技	300	970.00	291,000
日本鑄鉄管	200	1,000.00	200,000
三菱製鋼	1,100	951.00	1,046,100
日亜鋼業	2,200	256.00	563,200
日本精線	300	4,165.00	1,249,500
エンビプロ・ホールディングス	1,100	862.00	948,200
シンニッタン	2,100	222.00	466,200
新家工業	400	1,460.00	584,000
大紀アルミニウム工業所	2,200	1,233.00	2,712,600
日本軽金属ホールディングス	4,200	1,526.00	6,409,200
三井金属鉱業	4,400	3,270.00	14,388,000
東邦亜鉛	900	2,289.00	2,060,100
三菱マテリアル	10,000	1,977.00	19,770,000
住友金属鉱山	19,000	4,893.00	92,967,000
D O W Aホールディングス	4,100	4,555.00	18,675,500
古河機械金属	2,600	1,218.00	3,166,800
エス・サイエンス	8,900	28.00	249,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,900	2,510.00	4,769,000
東邦チタニウム	2,900	2,470.00	7,163,000
U A C J	2,300	2,134.00	4,908,200
C Kサンエツ	300	3,875.00	1,162,500
古河電気工業	4,900	2,232.00	10,936,800
住友電気工業	58,800	1,453.50	85,465,800

フジクラ	18,400	805.00	14,812,000
昭和電線ホールディングス	1,400	1,709.00	2,392,600
タツタ電線	2,900	474.00	1,374,600
カナレ電気	300	1,611.00	483,300
平河ヒューテック	900	1,081.00	972,900
リョービ	1,800	1,060.00	1,908,000
アーレスティ	1,800	366.00	658,800
アサヒホールディングス	6,600	2,031.00	13,404,600
稲葉製作所	900	1,349.00	1,214,100
宮地エンジニアリンググループ	500	3,295.00	1,647,500
トーカロ	4,200	1,271.00	5,338,200
アルファC o	700	954.00	667,800
SUMCO	26,500	2,021.00	53,556,500
川田テクノロジーズ	300	3,500.00	1,050,000
RS Technologies	500	6,010.00	3,005,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,967.00	393,400
信和	1,000	780.00	780,000
東洋製罐グループホールディングス	9,100	1,368.00	12,448,800
ホッカンホールディングス	800	1,208.00	966,400
コロナ	900	820.00	738,000
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,965.00	4,912,500
駒井ハルテック	300	1,687.00	506,100
高田機工	100	2,476.00	247,600
三和ホールディングス	15,500	1,248.00	19,344,000
文化シャッター	5,000	971.00	4,855,000
三協立山	2,000	579.00	1,158,000
アルインコ	1,200	841.00	1,009,200
東洋シャッター	400	621.00	248,400
LIXIL	25,900	2,533.00	65,604,700
日本フィルコン	1,200	495.00	594,000
ノーリツ	2,800	1,472.00	4,121,600
長府製作所	1,700	1,740.00	2,958,000
リンナイ	2,900	8,980.00	26,042,000
ダイニチ工業	900	620.00	558,000
日東精工	2,000	483.00	966,000
三洋工業	200	1,703.00	340,600
岡部	2,800	621.00	1,738,800
ジーテクト	1,900	1,280.00	2,432,000
東プレ	2,700	1,032.00	2,786,400
高周波熱錬	2,700	666.00	1,798,200
東京製綱	1,000	890.00	890,000
サンコール	1,400	623.00	872,200

モリテック スチール	1,300	288.00	374,400
パイオラックス	2,200	1,948.00	4,285,600
エイチワン	1,600	590.00	944,000
日本発條	14,300	935.00	13,370,500
中央発條	900	684.00	615,600
アドバネクス	200	1,300.00	260,000
立川ブラインド工業	700	1,053.00	737,100
三益半導体工業	1,300	2,315.00	3,009,500
日本ドライケミカル	400	1,524.00	609,600
日本製鋼所	4,500	3,085.00	13,882,500
三浦工業	6,700	2,633.00	17,641,100
タクマ	5,000	1,366.00	6,830,000
ツガミ	3,500	1,146.00	4,011,000
オークマ	1,700	5,380.00	9,146,000
芝浦機械	1,900	2,833.00	5,382,700
アマダ	26,000	1,039.00	27,014,000
アイダエンジニアリング	3,800	903.00	3,431,400
滝澤鉄工所	500	1,193.00	596,500
F U J I	6,900	2,058.00	14,200,200
牧野フライス製作所	1,700	4,445.00	7,556,500
オーエスジー	7,300	1,606.00	11,723,800
ダイジェット工業	200	918.00	183,600
旭ダイヤモンド工業	4,100	599.00	2,455,900
D M G 森精機	9,300	1,842.00	17,130,600
ソディック	3,600	808.00	2,908,800
ディスコ	2,400	31,850.00	76,440,000
日東工器	800	1,499.00	1,199,200
日進工具	1,300	1,242.00	1,614,600
パンチ工業	1,400	461.00	645,400
富士ダイス	900	649.00	584,100
豊和工業	900	975.00	877,500
O K K	600	1,016.00	609,600
東洋機械金属	1,100	576.00	633,600
島精機製作所	2,400	2,084.00	5,001,600
オプトラン	2,100	1,965.00	4,126,500
N C ホールディングス	400	1,868.00	747,200
イワキポンプ	1,000	919.00	919,000
フリーー	1,500	1,063.00	1,594,500
ヤマシンフィルタ	2,900	315.00	913,500
日阪製作所	1,800	845.00	1,521,000
やまびこ	2,900	1,173.00	3,401,700
野村マイクロ・サイエンス	500	3,800.00	1,900,000

平田機工	700	4,100.00	2,870,000
ペガサスミシン製造	1,700	589.00	1,001,300
マルマエ	700	1,895.00	1,326,500
タツモ	800	1,169.00	935,200
ナブテスコ	9,000	3,120.00	28,080,000
三井海洋開発	1,700	1,210.00	2,057,000
レオン自動機	1,800	1,218.00	2,192,400
S M C	4,900	60,730.00	297,577,000
ホソカワミクロン	1,100	2,589.00	2,847,900
ユニオンツール	600	3,525.00	2,115,000
オイレス工業	2,200	1,539.00	3,385,800
日精エー・エス・ビー機械	600	3,390.00	2,034,000
サトーホールディングス	2,200	1,901.00	4,182,200
技研製作所	1,500	3,160.00	4,740,000
日本エアーテック	800	1,005.00	804,000
カワタ	500	1,013.00	506,500
日精樹脂工業	1,100	893.00	982,300
オカダアイヨン	500	1,462.00	731,000
ワイエイシイホールディングス	700	1,651.00	1,155,700
小松製作所	75,400	3,302.00	248,970,800
住友重機械工業	9,100	3,150.00	28,665,000
日立建機	6,700	3,315.00	22,210,500
日工	2,100	602.00	1,264,200
巴工業	600	2,270.00	1,362,000
井関農機	1,400	1,217.00	1,703,800
T O W A	1,400	1,764.00	2,469,600
丸山製作所	300	1,531.00	459,300
北川鉄工所	700	1,452.00	1,016,400
ローツェ	800	9,410.00	7,528,000
タカキタ	600	533.00	319,800
クボタ	80,600	2,208.50	178,005,100
荏原実業	800	2,274.00	1,819,200
三菱化工機	500	2,046.00	1,023,000
月島機械	2,800	897.00	2,511,600
帝国電機製作所	1,100	1,563.00	1,719,300
新東工業	3,300	680.00	2,244,000
澁谷工業	1,400	2,250.00	3,150,000
アイチ コーポレーション	2,400	848.00	2,035,200
小森コーポレーション	4,000	795.00	3,180,000
鶴見製作所	1,200	1,821.00	2,185,200
住友精密工業	300	2,813.00	843,900
酒井重工業	300	2,923.00	876,900

荏原製作所	6,700	5,460.00	36,582,000
石井鐵工所	200	2,817.00	563,400
西島製作所	1,400	1,365.00	1,911,000
北越工業	1,500	814.00	1,221,000
ダイキン工業	19,200	19,885.00	381,792,000
オルガノ	500	9,720.00	4,860,000
トーヨーカネツ	600	2,674.00	1,604,400
栗田工業	8,600	5,030.00	43,258,000
椿本チエイン	2,200	3,150.00	6,930,000
大同工業	700	812.00	568,400
木村化工機	1,300	673.00	874,900
アネスト岩田	2,600	867.00	2,254,200
ダイフク	8,300	7,580.00	62,914,000
サムコ	400	2,532.00	1,012,800
加藤製作所	800	809.00	647,200
油研工業	300	1,747.00	524,100
タダノ	8,200	957.00	7,847,400
フジテック	5,400	2,686.00	14,504,400
C K D	4,400	1,814.00	7,981,600
キトー	1,300	2,615.00	3,399,500
平和	4,600	1,915.00	8,809,000
理想科学工業	1,400	2,230.00	3,122,000
S A N K Y O	3,600	4,100.00	14,760,000
日本金銭機械	1,700	657.00	1,116,900
マースグループホールディングス	1,100	1,696.00	1,865,600
フクシマガリレイ	1,100	3,245.00	3,569,500
オーイズミ	600	406.00	243,600
ダイコク電機	800	1,197.00	957,600
竹内製作所	2,500	2,411.00	6,027,500
アマノ	4,400	2,430.00	10,692,000
J U K I	2,300	705.00	1,621,500
サンデン	2,300	219.00	503,700
ジャノメ	1,400	688.00	963,200
マックス	2,000	1,599.00	3,198,000
グローリー	4,100	2,030.00	8,323,000
新晃工業	1,600	1,612.00	2,579,200
大和冷機工業	2,400	1,032.00	2,476,800
セガサミーホールディングス	16,500	2,161.00	35,656,500
日本ピストンリング	600	1,285.00	771,000
リケン	600	2,330.00	1,398,000
T P R	2,000	1,230.00	2,460,000
ツバキ・ナカシマ	3,700	965.00	3,570,500

ホシザキ	4,900	7,720.00	37,828,000
大豊工業	1,400	698.00	977,200
日本精工	29,400	763.00	22,432,200
NTN	32,100	280.00	8,988,000
ジェイテクト	14,800	1,058.00	15,658,400
不二越	1,200	3,640.00	4,368,000
日本トムソン	4,000	526.00	2,104,000
THK	9,400	2,654.00	24,947,600
ユーシン精機	1,300	690.00	897,000
前澤給装工業	1,100	870.00	957,000
イーグル工業	1,900	961.00	1,825,900
前澤工業	1,100	593.00	652,300
日本ピラー工業	1,500	2,737.00	4,105,500
キッツ	5,000	676.00	3,380,000
マキタ	19,300	3,467.00	66,913,100
三井E & Sホールディングス	6,000	358.00	2,148,000
日立造船	13,500	849.00	11,461,500
三菱重工業	25,000	5,225.00	130,625,000
IHI	10,400	3,920.00	40,768,000
サノヤスホールディングス	2,000	127.00	254,000
スター精密	2,300	1,712.00	3,937,600
日清紡ホールディングス	9,600	1,064.00	10,214,400
イビデン	8,200	4,105.00	33,661,000
コニカミノルタ	34,600	460.00	15,916,000
ブラザー工業	19,400	2,378.00	46,133,200
ミネベアミツミ	27,200	2,314.00	62,940,800
日立製作所	80,100	6,675.00	534,667,500
東芝	29,100	5,475.00	159,322,500
三菱電機	159,100	1,405.50	223,615,050
富士電機	9,500	5,780.00	54,910,000
東洋電機製造	600	895.00	537,000
安川電機	17,000	4,290.00	72,930,000
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,373.00	2,471,400
明電舎	2,500	1,984.00	4,960,000
オリジン	400	1,215.00	486,000
山洋電気	700	5,250.00	3,675,000
デンヨー	1,300	1,545.00	2,008,500
PHCホールディングス	2,600	1,298.00	3,374,800
東芝テック	1,800	4,020.00	7,236,000
芝浦メカトロニクス	300	11,050.00	3,315,000
マブチモーター	3,800	3,585.00	13,623,000
日本電産	39,000	8,243.00	321,477,000

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	454.00	317,800
トレックス・セミコンダクター	800	2,831.00	2,264,800
東光高岳	900	1,699.00	1,529,100
ダブル・スコープ	4,800	1,443.00	6,926,400
ダイヘン	1,600	4,210.00	6,736,000
ヤーマン	2,700	1,399.00	3,777,300
JVCケンウッド	13,800	178.00	2,456,400
ミマキエンジニアリング	1,500	520.00	780,000
I - P E X	800	1,342.00	1,073,600
日新電機	3,900	1,536.00	5,990,400
大崎電気工業	3,000	488.00	1,464,000
オムロン	13,900	6,699.00	93,116,100
日東工業	2,100	2,272.00	4,771,200
I D E C	2,100	2,643.00	5,550,300
正興電機製作所	500	1,081.00	540,500
不二電機工業	300	1,117.00	335,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,100	2,113.00	10,776,300
サクサホールディングス	400	1,384.00	553,600
メルコホールディングス	400	3,370.00	1,348,000
テクノメディカ	400	1,525.00	610,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,211.00	605,500
日本電気	20,200	5,110.00	103,222,000
富士通	15,000	17,100.00	256,500,000
沖電気工業	6,500	792.00	5,148,000
岩崎通信機	700	813.00	569,100
電気興業	800	2,494.00	1,995,200
サンケン電気	1,500	4,945.00	7,417,500
ナカヨ	300	1,084.00	325,200
アイホン	800	1,705.00	1,364,000
ルネサスエレクトロニクス	90,500	1,340.00	121,270,000
セイコーエプソン	19,300	2,168.00	41,842,400
ワコム	12,900	837.00	10,797,300
アルバック	3,300	5,050.00	16,665,000
アクセル	700	815.00	570,500
E I Z O	1,200	3,795.00	4,554,000
日本信号	3,800	904.00	3,435,200
京三製作所	3,400	422.00	1,434,800
能美防災	2,000	1,682.00	3,364,000
ホーチキ	1,100	1,239.00	1,362,900
星和電機	800	467.00	373,600
エレコム	3,800	1,517.00	5,764,600
パナソニック ホールディングス	177,600	1,105.50	196,336,800

シャープ	16,800	1,026.00	17,236,800	
アンリツ	10,700	1,468.00	15,707,600	
富士通ゼネラル	4,500	2,395.00	10,777,500	
ソニーグループ	104,300	11,115.00	1,159,294,500	代用有価証券 35,000株
T D K	24,100	4,385.00	105,678,500	
帝国通信工業	700	1,335.00	934,500	
タムラ製作所	6,200	559.00	3,465,800	
アルプスアルパイン	14,000	1,457.00	20,398,000	
池上通信機	600	595.00	357,000	
日本電波工業	1,700	1,124.00	1,910,800	
鈴木	900	802.00	721,800	
メイコー	1,800	3,875.00	6,975,000	
日本トリム	300	2,435.00	730,500	
ローランド ディー . ジー .	1,000	3,290.00	3,290,000	
フォスター電機	1,600	740.00	1,184,000	
S M K	400	2,091.00	836,400	
ヨコオ	1,200	2,186.00	2,623,200	
ホシデン	3,800	1,222.00	4,643,600	
ヒロセ電機	2,400	17,650.00	42,360,000	
日本航空電子工業	3,500	2,119.00	7,416,500	
T O A	1,800	760.00	1,368,000	
マクセル	3,100	1,313.00	4,070,300	
古野電気	2,000	1,033.00	2,066,000	
ユニデンホールディングス	400	3,850.00	1,540,000	
スミダコーポレーション	1,600	809.00	1,294,400	
アイコム	600	2,419.00	1,451,400	
リオン	600	2,501.00	1,500,600	
本多通信工業	1,400	523.00	732,200	
横河電機	15,700	2,257.00	35,434,900	
新電元工業	600	3,300.00	1,980,000	
アズビル	9,800	3,450.00	33,810,000	
東亜ディーケーケー	900	828.00	745,200	
日本光電工業	6,600	2,917.00	19,252,200	
チノー	500	1,610.00	805,000	
共和電業	1,700	318.00	540,600	
日本電子材料	800	1,856.00	1,484,800	
堀場製作所	2,900	6,400.00	18,560,000	
アドバンテスト	12,400	7,730.00	95,852,000	
小野測器	700	439.00	307,300	
エスペック	1,300	1,783.00	2,317,900	
キーエンス	15,100	46,250.00	698,375,000	
日置電機	800	6,600.00	5,280,000	

シスメックス	12,600	7,724.00	97,322,400
日本マイクロニクス	2,600	1,382.00	3,593,200
メガチップス	1,500	3,050.00	4,575,000
O B A R A G R O U P	700	2,883.00	2,018,100
澤藤電機	200	1,441.00	288,200
原田工業	800	910.00	728,000
コーセル	1,900	811.00	1,540,900
イリソ電子工業	1,400	3,270.00	4,578,000
オブテックスグループ	2,700	1,939.00	5,235,300
千代田インテグレ	700	1,930.00	1,351,000
レーザーテック	7,000	17,100.00	119,700,000
スタンレー電気	11,000	2,230.00	24,530,000
岩崎電気	600	2,588.00	1,552,800
ウシオ電機	8,100	1,656.00	13,413,600
岡谷電機産業	1,300	257.00	334,100
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	295.00	442,500
エノモト	500	1,571.00	785,500
日本セラミック	1,600	2,020.00	3,232,000
遠藤照明	800	746.00	596,800
古河電池	1,200	1,213.00	1,455,600
双信電機	800	555.00	444,000
山一電機	1,100	1,869.00	2,055,900
図研	1,100	2,807.00	3,087,700
日本電子	3,300	5,720.00	18,876,000
カシオ計算機	10,700	1,250.00	13,375,000
ファナック	14,600	20,040.00	292,584,000
日本シイエムケイ	3,100	458.00	1,419,800
エンプラス	400	3,360.00	1,344,000
大真空	2,100	986.00	2,070,600
ローム	7,100	9,970.00	70,787,000
浜松ホトニクス	11,400	5,750.00	65,550,000
三井ハイテック	1,500	9,400.00	14,100,000
新光電気工業	4,900	4,225.00	20,702,500
京セラ	23,400	7,196.00	168,386,400
太陽誘電	7,600	5,160.00	39,216,000
村田製作所	46,600	8,050.00	375,130,000
双葉電子工業	2,900	649.00	1,882,100
北陸電気工業	700	1,113.00	779,100
ニチコン	4,700	1,363.00	6,406,100
日本ケミコン	1,600	1,808.00	2,892,800
K O A	2,400	1,650.00	3,960,000
市光工業	2,100	368.00	772,800

小糸製作所	8,600	4,535.00	39,001,000	
ミツバ	2,800	387.00	1,083,600	
S C R E E Nホールディングス	2,700	10,440.00	28,188,000	
キャノン電子	1,500	1,527.00	2,290,500	
キャノン	82,700	3,251.00	268,857,700	代用有価証券 10,000株
リコー	41,800	1,104.00	46,147,200	
象印マホービン	4,200	1,414.00	5,938,800	
M U T O Hホールディングス	200	2,056.00	411,200	
東京エレクトロン	10,600	51,000.00	540,600,000	
トヨタ紡織	6,200	2,061.00	12,778,200	
芦森工業	300	1,023.00	306,900	
ユニプレス	2,700	913.00	2,465,100	
豊田自動織機	12,400	8,220.00	101,928,000	
モリタホールディングス	2,700	1,275.00	3,442,500	
三櫻工業	2,300	645.00	1,483,500	
デンソー	33,900	7,548.00	255,877,200	
東海理化電機製作所	4,400	1,442.00	6,344,800	
川崎重工業	11,600	2,831.00	32,839,600	
名村造船所	4,700	409.00	1,922,300	
日本車輛製造	600	2,031.00	1,218,600	
三菱ロジスネクスト	2,300	800.00	1,840,000	
近畿車輛	300	1,125.00	337,500	
日産自動車	196,400	533.60	104,799,040	
いすゞ自動車	49,600	1,571.00	77,921,600	
トヨタ自動車	787,100	2,080.00	1,637,168,000	
日野自動車	20,800	692.00	14,393,600	
三菱自動車工業	61,700	439.00	27,086,300	
エフテック	1,200	542.00	650,400	
レシップホールディングス	700	544.00	380,800	
G M B	300	700.00	210,000	
ファルテック	300	603.00	180,900	
武蔵精密工業	3,800	1,337.00	5,080,600	
日産車体	2,500	582.00	1,455,000	
新明和工業	4,500	1,113.00	5,008,500	
極東開発工業	2,800	1,435.00	4,018,000	
トピー工業	1,300	1,293.00	1,680,900	
ティラド	400	2,726.00	1,090,400	
タチエス	2,800	1,111.00	3,110,800	
N O K	6,900	1,173.00	8,093,700	
フタバ産業	3,900	383.00	1,493,700	
K Y B	1,600	2,992.00	4,787,200	
大同メタル工業	3,300	518.00	1,709,400	

プレス工業	7,800	420.00	3,276,000
ミクニ	2,100	345.00	724,500
太平洋工業	3,300	1,027.00	3,389,100
河西工業	2,300	275.00	632,500
アイシン	12,200	4,255.00	51,911,000
マツダ	50,100	1,107.00	55,460,700
今仙電機製作所	1,100	584.00	642,400
本田技研工業	124,900	3,305.00	412,794,500
スズキ	34,700	4,035.00	140,014,500
S U B A R U	45,100	2,447.50	110,382,250
安永	800	698.00	558,400
ヤマハ発動機	21,700	2,580.00	55,986,000
T B K	1,900	340.00	646,000
エクセディ	2,500	1,749.00	4,372,500
豊田合成	4,900	2,091.00	10,245,900
愛三工業	2,700	705.00	1,903,500
盟和産業	300	1,009.00	302,700
日本プラスト	1,400	451.00	631,400
ヨロズ	1,400	871.00	1,219,400
エフ・シー・シー	2,800	1,364.00	3,819,200
シマノ	6,300	21,075.00	132,772,500
テイ・エス テック	7,100	1,393.00	9,890,300
ジャムコ	1,000	1,227.00	1,227,000
テルモ	47,100	3,827.00	180,251,700
クリエートメディック	500	978.00	489,000
日機装	4,500	855.00	3,847,500
日本エム・ディ・エム	900	1,506.00	1,355,400
島津製作所	20,400	4,445.00	90,678,000
J M S	1,300	566.00	735,800
長野計器	1,100	1,145.00	1,259,500
ブイ・テクノロジー	700	2,805.00	1,963,500
東京計器	1,000	1,384.00	1,384,000
愛知時計電機	600	1,414.00	848,400
インターアクション	800	1,898.00	1,518,400
オーバル	1,500	309.00	463,500
東京精密	2,700	4,700.00	12,690,000
マニー	6,300	1,356.00	8,542,800
ニコン	24,100	1,669.00	40,222,900
トプコン	7,800	1,847.00	14,406,600
オリンパス	82,900	2,705.00	224,244,500
理研計器	1,200	3,750.00	4,500,000
タムロン	1,200	2,454.00	2,944,800

HOYA	32,100	12,215.00	392,101,500
シード	800	489.00	391,200
ノーリツ鋼機	1,500	2,330.00	3,495,000
A & D ホロンホールディングス	1,900	955.00	1,814,500
朝日インテック	18,300	1,780.00	32,574,000
シチズン時計	17,300	560.00	9,688,000
リズム	500	1,748.00	874,000
大研医器	1,300	494.00	642,200
メニコン	5,300	2,685.00	14,230,500
シンシア	200	416.00	83,200
松風	600	1,640.00	984,000
セイコーホールディングス	2,300	2,772.00	6,375,600
ニプロ	11,800	1,016.00	11,988,800
中本パックス	500	1,565.00	782,500
スノーピーク	2,200	2,410.00	5,302,000
パラマウントベッドホールディングス	3,200	1,975.00	6,320,000
トランザクション	1,000	1,081.00	1,081,000
粧美堂	400	394.00	157,600
ニホンフラッシュ	1,300	977.00	1,270,100
前田工織	1,600	2,607.00	4,171,200
永大産業	2,000	270.00	540,000
アートネイチャー	1,400	715.00	1,001,000
バンダイナムコホールディングス	14,100	9,306.00	131,214,600
アイフィスジャパン	500	680.00	340,000
共立印刷	2,200	153.00	336,600
SHOEI	1,500	5,020.00	7,530,000
フランスベッドホールディングス	2,200	890.00	1,958,000
パイロットコーポレーション	2,500	5,040.00	12,600,000
萩原工業	1,000	1,094.00	1,094,000
フジシールインターナショナル	3,600	1,475.00	5,310,000
タカラトミー	6,900	1,263.00	8,714,700
広済堂ホールディングス	1,000	1,145.00	1,145,000
エステールホールディングス	400	635.00	254,000
タカノ	500	766.00	383,000
プロネクサス	1,300	1,031.00	1,340,300
ホクシン	1,200	144.00	172,800
ウッドワン	500	1,177.00	588,500
大建工業	900	1,743.00	1,568,700
凸版印刷	22,900	2,336.00	53,494,400
大日本印刷	18,600	2,878.00	53,530,800
共同印刷	400	2,600.00	1,040,000
NISSHA	3,100	1,483.00	4,597,300

光村印刷	100	1,256.00	125,600
TAKARA & COMPANY	1,000	1,814.00	1,814,000
アシックス	13,400	2,437.00	32,655,800
ツツミ	400	1,887.00	754,800
ローランド	1,200	4,280.00	5,136,000
小松ウオール工業	500	1,860.00	930,000
ヤマハ	9,700	5,320.00	51,604,000
河合楽器製作所	400	2,620.00	1,048,000
クリナップ	1,500	545.00	817,500
ピジョン	10,000	1,701.00	17,010,000
兼松サステック	100	1,587.00	158,700
キングジム	1,300	913.00	1,186,900
リンテック	3,300	2,392.00	7,893,600
イトーキ	3,000	381.00	1,143,000
任天堂	9,400	56,210.00	528,374,000
三菱鉛筆	2,400	1,378.00	3,307,200
タカラスタANDARD	2,900	1,254.00	3,636,600
コクヨ	7,500	1,634.00	12,255,000
ナカバヤシ	1,400	491.00	687,400
グローブライド	1,300	2,119.00	2,754,700
オカムラ	5,000	1,105.00	5,525,000
美津濃	1,500	2,213.00	3,319,500
東京電力ホールディングス	124,500	492.00	61,254,000
中部電力	48,300	1,255.00	60,616,500
関西電力	59,800	1,254.00	74,989,200
中国電力	24,700	832.00	20,550,400
北陸電力	14,500	499.00	7,235,500
東北電力	37,200	701.00	26,077,200
四国電力	14,200	739.00	10,493,800
九州電力	32,700	830.00	27,141,000
北海道電力	14,400	459.00	6,609,600
沖縄電力	3,500	1,220.00	4,270,000
電源開発	12,900	2,059.00	26,561,100
エフオン	1,100	546.00	600,600
イーレックス	2,300	2,036.00	4,682,800
レノバ	3,300	2,010.00	6,633,000
東京瓦斯	30,400	2,615.00	79,496,000
大阪瓦斯	28,700	2,420.00	69,454,000
東邦瓦斯	6,900	3,050.00	21,045,000
北海道瓦斯	800	1,593.00	1,274,400
広島ガス	3,100	313.00	970,300
西部ガスホールディングス	1,700	1,827.00	3,105,900

静岡ガス	4,100	834.00	3,419,400
メタウォーター	1,700	1,962.00	3,335,400
SBSホールディングス	1,300	2,655.00	3,451,500
東武鉄道	15,600	2,965.00	46,254,000
相鉄ホールディングス	5,100	2,281.00	11,633,100
東急	39,900	1,480.00	59,052,000
京浜急行電鉄	19,500	1,418.00	27,651,000
小田急電鉄	22,200	1,705.00	37,851,000
京王電鉄	7,800	4,435.00	34,593,000
京成電鉄	10,400	3,470.00	36,088,000
富士急行	1,800	3,990.00	7,182,000
東日本旅客鉄道	26,700	6,770.00	180,759,000
西日本旅客鉄道	18,500	4,771.00	88,263,500
東海旅客鉄道	12,400	15,410.00	191,084,000
西武ホールディングス	20,700	1,380.00	28,566,000
鴻池運輸	2,500	1,142.00	2,855,000
西日本鉄道	4,200	2,787.00	11,705,400
ハマキョウレックス	1,100	2,883.00	3,171,300
サカイ引越センター	800	4,260.00	3,408,000
近鉄グループホールディングス	15,100	3,870.00	58,437,000
阪急阪神ホールディングス	18,900	3,505.00	66,244,500
南海電気鉄道	6,800	2,546.00	17,312,800
京阪ホールディングス	6,400	3,180.00	20,352,000
神戸電鉄	400	3,205.00	1,282,000
名古屋鉄道	15,900	2,093.00	33,278,700
山陽電気鉄道	1,200	2,094.00	2,512,800
アルプス物流	1,100	1,092.00	1,201,200
ヤマトホールディングス	22,100	2,079.00	45,945,900
山九	3,900	3,835.00	14,956,500
丸運	1,000	238.00	238,000
丸全昭和運輸	1,200	2,939.00	3,526,800
センコーグループホールディングス	7,600	837.00	6,361,200
トナミホールディングス	300	3,405.00	1,021,500
ニッコンホールディングス	5,100	2,035.00	10,378,500
日本石油輸送	200	2,521.00	504,200
福山通運	2,200	3,075.00	6,765,000
セイノーホールディングス	9,400	1,032.00	9,700,800
エスライン	500	848.00	424,000
神奈川中央交通	400	3,370.00	1,348,000
日立物流	3,000	8,550.00	25,650,000
丸和運輸機関	2,900	1,416.00	4,106,400
C&Fロジホールディングス	1,500	1,000.00	1,500,000

九州旅客鉄道	11,100	2,635.00	29,248,500
S Gホールディングス	27,600	2,209.00	60,968,400
NIPPON EXPRESSホールディングス	4,900	7,610.00	37,289,000
日本郵船	13,200	9,680.00	127,776,000
商船三井	25,100	3,205.00	80,445,500
川崎汽船	4,900	9,200.00	45,080,000
NSユニテッド海運	900	3,920.00	3,528,000
飯野海運	7,100	758.00	5,381,800
乾汽船	1,200	1,773.00	2,127,600
日本航空	34,600	2,268.00	78,472,800
ANAホールディングス	38,400	2,432.50	93,408,000
パスコ	300	1,277.00	383,100
トランコム	400	6,120.00	2,448,000
日新	1,200	1,576.00	1,891,200
三菱倉庫	4,400	3,180.00	13,992,000
三井倉庫ホールディングス	1,600	2,990.00	4,784,000
住友倉庫	4,900	2,012.00	9,858,800
澁澤倉庫	900	2,198.00	1,978,200
東陽倉庫	2,400	295.00	708,000
日本トランスシティ	3,000	498.00	1,494,000
ケイヒン	300	1,324.00	397,200
中央倉庫	800	960.00	768,000
川西倉庫	300	1,091.00	327,300
安田倉庫	1,100	945.00	1,039,500
ファイズホールディングス	400	707.00	282,800
東洋埠頭	500	1,271.00	635,500
上組	8,100	2,551.00	20,663,100
サンリツ	400	731.00	292,400
キムラユニティー	400	1,465.00	586,000
キューソー流通システム	800	1,075.00	860,000
近鉄エクスプレス	3,000	4,170.00	12,510,000
東海運	900	292.00	262,800
エーアイティー	1,000	1,414.00	1,414,000
内外トランスライン	600	1,889.00	1,133,400
日本コンセプト	500	1,430.00	715,000
NEC ネットズエスアイ	5,400	1,809.00	9,768,600
クロスキャット	900	981.00	882,900
システナ	23,300	412.00	9,599,600
デジタルアーツ	900	5,660.00	5,094,000
日鉄ソリューションズ	2,700	3,530.00	9,531,000
キューブシステム	800	895.00	716,000
WOW WORLD	200	1,021.00	204,200

コア	700	1,395.00	976,500
手間いらず	200	4,980.00	996,000
ラクーンホールディングス	1,400	1,574.00	2,203,600
ソリトンシステムズ	800	1,211.00	968,800
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,760.00	2,632,000
T I S	14,700	3,175.00	46,672,500
J N Sホールディングス	800	428.00	342,400
グリー	7,400	820.00	6,068,000
G M Oペパボ	200	1,995.00	399,000
コーエーテクモホールディングス	5,200	4,210.00	21,892,000
三菱総合研究所	800	4,115.00	3,292,000
ボルテージ	500	348.00	174,000
電算	200	2,238.00	447,600
A G S	700	736.00	515,200
ファインデックス	1,400	620.00	868,000
ブレインパッド	1,400	1,037.00	1,451,800
K L a b	2,800	481.00	1,346,800
ポルトゥウィンホールディングス	2,400	932.00	2,236,800
ネクソン	37,100	2,932.00	108,777,200
アイスタイル	4,200	229.00	961,800
エムアップホールディングス	1,900	1,180.00	2,242,000
エイチーム	1,100	716.00	787,600
エニグモ	1,800	518.00	932,400
テクノスジャパン	1,300	490.00	637,000
e n i s h	1,200	314.00	376,800
コロプラ	5,400	625.00	3,375,000
ブロードリーフ	8,100	422.00	3,418,200
クロス・マーケティンググループ	600	801.00	480,600
デジタルハーツホールディングス	700	1,577.00	1,103,900
システム情報	1,200	965.00	1,158,000
メディアドゥ	600	1,724.00	1,034,400
じげん	4,600	334.00	1,536,400
ブイキューブ	1,700	954.00	1,621,800
エンカレッジ・テクノロジー	400	517.00	206,800
サイバーリンクス	600	1,122.00	673,200
フィックスターズ	1,600	951.00	1,521,600
C A R T A H O L D I N G S	700	1,796.00	1,257,200
オブティム	1,200	755.00	906,000
セレス	600	1,156.00	693,600
S H I F T	1,000	17,390.00	17,390,000
ティーガイア	1,400	1,606.00	2,248,400
セック	200	2,425.00	485,000

テクマトリックス	2,800	1,592.00	4,457,600
プロシップ	500	1,410.00	705,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,200	2,343.00	9,840,600
GMOペイメントゲートウェイ	3,200	9,090.00	29,088,000
ザッパラス	600	388.00	232,800
システムリサーチ	500	2,025.00	1,012,500
インターネットイニシアティブ	4,300	4,450.00	19,135,000
さくらインターネット	1,700	542.00	921,400
ヴィンクス	500	1,114.00	557,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	5,650.00	2,260,000
SRAホールディングス	800	2,794.00	2,235,200
システムインテグレータ	500	479.00	239,500
朝日ネット	1,500	565.00	847,500
eBASE	2,000	522.00	1,044,000
アバント	1,700	1,251.00	2,126,700
アドソル日進	600	1,477.00	886,200
ODKソリューションズ	400	574.00	229,600
フリービット	900	756.00	680,400
コムチュア	1,800	2,592.00	4,665,600
サイバーコム	300	1,139.00	341,700
アステリア	1,200	1,018.00	1,221,600
アイル	800	1,454.00	1,163,200
マークラインズ	800	2,086.00	1,668,800
メディカル・データ・ビジョン	2,100	972.00	2,041,200
gumi	2,200	565.00	1,243,000
ショーケース	400	461.00	184,400
モバイルファクトリー	400	1,139.00	455,600
テラスカイ	600	1,403.00	841,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,355.00	948,500
PCIホールディングス	700	961.00	672,700
パイプHD	300	2,726.00	817,800
アイビーシー	300	454.00	136,200
ネオジャパン	500	1,071.00	535,500
PR TIMES	400	1,986.00	794,400
ラクス	7,500	1,409.00	10,567,500
ランドコンピュータ	400	891.00	356,400
ダブルスタンダード	500	1,804.00	902,000
オープンドア	1,000	1,734.00	1,734,000
マイネット	600	497.00	298,200
アカツキ	700	2,744.00	1,920,800
ベネフィットジャパン	100	1,868.00	186,800
Ubicomホールディングス	400	2,239.00	895,600

カナミックネットワーク	1,900	520.00	988,000
ノムラシステムコーポレーション	900	234.00	210,600
チェンジ	3,300	1,842.00	6,078,600
シンクロ・フード	900	332.00	298,800
オークネット	900	1,794.00	1,614,600
キャピタル・アセット・プランニング	300	686.00	205,800
エイトレッド	200	1,957.00	391,400
マクロミル	3,300	921.00	3,039,300
ビーグリー	400	1,333.00	533,200
オロ	500	1,654.00	827,000
ユーザーローカル	500	1,650.00	825,000
テモナ	300	374.00	112,200
マネーフォワード	3,300	3,265.00	10,774,500
サインポスト	500	812.00	406,000
電算システムホールディングス	700	2,271.00	1,589,700
ソルクシーズ	1,500	359.00	538,500
フェイス	500	640.00	320,000
プロトコーポレーション	1,700	942.00	1,601,400
ハイマックス	500	1,236.00	618,000
野村総合研究所	29,500	3,645.00	107,527,500
サイバネットシステム	1,200	768.00	921,600
C Eホールディングス	800	417.00	333,600
日本システム技術	300	2,403.00	720,900
インテージホールディングス	1,900	1,351.00	2,566,900
東邦システムサイエンス	400	884.00	353,600
ソースネクスト	7,100	250.00	1,775,000
インフォコム	1,800	2,077.00	3,738,600
シンプレクス・ホールディングス	2,600	1,813.00	4,713,800
HEROZ	500	906.00	453,000
ラクスル	1,900	1,547.00	2,939,300
I P S	400	2,259.00	903,600
F I G	1,900	301.00	571,900
システムサポート	600	1,158.00	694,800
イーソル	1,000	541.00	541,000
アルテリア・ネットワークス	1,700	1,230.00	2,091,000
東海ソフト	300	953.00	285,900
ウイングアーク1st	1,300	1,467.00	1,907,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,484.00	593,600
サーバーワークス	300	2,022.00	606,600
東名	100	1,123.00	112,300
ヴィッツ	200	1,083.00	216,600
トピラシステムズ	300	858.00	257,400

Sansan	5,400	898.00	4,849,200
Link-U	300	651.00	195,300
ギフトィ	1,400	1,052.00	1,472,800
ベース	300	5,740.00	1,722,000
JMDC	2,000	5,010.00	10,020,000
フォーカスシステムズ	1,000	885.00	885,000
クレスコ	1,200	1,949.00	2,338,800
フジ・メディア・ホールディングス	14,900	1,120.00	16,688,000
オービック	5,100	18,350.00	93,585,000
ジャストシステム	2,300	3,715.00	8,544,500
TDCソフト	1,300	1,004.00	1,305,200
Zホールディングス	235,600	396.50	93,415,400
トレンドマイクロ	8,200	6,570.00	53,874,000
IDホールディングス	1,000	823.00	823,000
日本オラクル	2,600	7,370.00	19,162,000
アルファシステムズ	400	4,155.00	1,662,000
フューチャー	3,500	1,539.00	5,386,500
CAC Holdings	900	1,392.00	1,252,800
SBテクノロジー	700	2,211.00	1,547,700
トーセ	400	743.00	297,200
オービックビジネスコンサルタント	1,600	4,245.00	6,792,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,400	3,145.00	23,273,000
アイティフォー	2,000	768.00	1,536,000
東計電算	200	5,960.00	1,192,000
エクスネット	300	998.00	299,400
大塚商会	8,800	3,845.00	33,836,000
サイボウズ	2,200	950.00	2,090,000
電通国際情報サービス	2,100	3,715.00	7,801,500
ACCESS	1,800	692.00	1,245,600
デジタルガレージ	2,700	3,775.00	10,192,500
EMシステムズ	2,700	956.00	2,581,200
ウェザーニューズ	500	6,030.00	3,015,000
CIJ	1,300	759.00	986,700
ビジネスエンジニアリング	400	2,022.00	808,800
日本エンタープライズ	1,700	157.00	266,900
WOWOW	700	1,463.00	1,024,100
スカラ	1,400	754.00	1,055,600
インテリジェント ウェイブ	900	803.00	722,700
IMAGICA GROUP	1,300	710.00	923,000
ネットワンシステムズ	6,000	2,762.00	16,572,000
システムソフト	4,500	100.00	450,000
アルゴグラフィックス	1,300	3,085.00	4,010,500

マーベラス	2,600	668.00	1,736,800
エイベックス	2,800	1,251.00	3,502,800
B I P R O G Y	5,100	2,803.00	14,295,300
兼松エレクトロニクス	900	3,860.00	3,474,000
都築電気	800	1,267.00	1,013,600
T B S ホールディングス	8,600	1,713.00	14,731,800
日本テレビホールディングス	13,600	1,243.00	16,904,800
朝日放送グループホールディングス	1,400	648.00	907,200
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,475.00	5,752,500
スカパーJ S A Tホールディングス	13,800	514.00	7,093,200
テレビ東京ホールディングス	1,100	1,965.00	2,161,500
日本BS放送	600	1,042.00	625,200
ビジョン	2,700	1,295.00	3,496,500
スマートバリュー	400	469.00	187,600
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,300	1,877.00	2,440,100
コネクシオ	1,200	1,285.00	1,542,000
日本通信	13,500	188.00	2,538,000
クロップス	300	1,023.00	306,900
日本電信電話	179,000	3,824.00	684,496,000
K D D I	119,100	4,353.00	518,442,300
ソフトバンク	247,400	1,458.50	360,832,900
光通信	1,900	13,710.00	26,049,000
エムティーアイ	1,400	443.00	620,200
G M O インターネット	5,700	2,246.00	12,802,200
ファイバーゲート	700	906.00	634,200
アйдママーケティングコミュニケーション	400	299.00	119,600
K A D O K A W A	8,800	2,698.00	23,742,400
学研ホールディングス	2,300	849.00	1,952,700
ゼンリン	2,700	898.00	2,424,600
昭文社ホールディングス	700	385.00	269,500
インプレスホールディングス	1,400	209.00	292,600
アイネット	800	1,203.00	962,400
松竹	1,000	12,600.00	12,600,000
東宝	9,600	4,810.00	46,176,000
東映	500	17,080.00	8,540,000
エヌ・ティ・ティ・データ	43,500	1,859.00	80,866,500
ピー・シー・エー	1,000	1,044.00	1,044,000
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,386.00	693,000
D T S	3,000	3,020.00	9,060,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,600	5,760.00	43,776,000
シーイーシー	1,700	1,108.00	1,883,600
カブコン	15,400	3,215.00	49,511,000

アイ・エス・ピー	800	1,003.00	802,400
ジャステック	900	1,149.00	1,034,100
S C S K	11,300	2,133.00	24,102,900
日本システムウエア	600	2,373.00	1,423,800
アイネス	1,400	1,515.00	2,121,000
T K C	2,600	3,145.00	8,177,000
富士ソフト	1,600	7,210.00	11,536,000
N S D	5,100	2,303.00	11,745,300
コナミホールディングス	5,900	7,840.00	46,256,000
福井コンピュータホールディングス	700	3,135.00	2,194,500
J B C Cホールディングス	1,100	1,570.00	1,727,000
ミロク情報サービス	1,500	1,088.00	1,632,000
ソフトバンクグループ	98,000	5,028.00	492,744,000
高千穂交易	600	1,790.00	1,074,000
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,768.00	530,400
伊藤忠食品	400	4,705.00	1,882,000
エレマテック	1,300	1,291.00	1,678,300
あらた	1,300	3,775.00	4,907,500
トーメンデバイス	300	5,800.00	1,740,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,410.00	2,705,000
フィールズ	1,500	996.00	1,494,000
双日	17,300	2,028.00	35,084,400
アルフレッサ ホールディングス	17,400	1,657.00	28,831,800
横浜冷凍	4,200	835.00	3,507,000
神栄	300	889.00	266,700
ラサ商事	800	955.00	764,000
アルコニックス	2,100	1,285.00	2,698,500
神戸物産	11,800	3,045.00	35,931,000
ハイパー	500	457.00	228,500
あい ホールディングス	2,400	1,585.00	3,804,000
ディーブイエックス	600	1,007.00	604,200
ダイワボウホールディングス	7,300	1,673.00	12,212,900
マクニカ・富士エレホールディングス	3,900	2,763.00	10,775,700
ラクト・ジャパン	600	1,996.00	1,197,600
グリムス	700	1,358.00	950,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	670.00	1,809,000
八洲電機	1,200	947.00	1,136,400
メディアスホールディングス	1,000	969.00	969,000
レスターホールディングス	1,600	1,947.00	3,115,200
ジュテックホールディングス	400	995.00	398,000
大光	800	697.00	557,600
O C H Iホールディングス	400	1,218.00	487,200

TO K A Iホールディングス	7,900	858.00	6,778,200
黒谷	500	585.00	292,500
C o m i n i x	300	718.00	215,400
三洋貿易	1,600	958.00	1,532,800
ビューティガレージ	300	2,434.00	730,200
ウイン・パートナーズ	1,200	993.00	1,191,600
ミタチ産業	400	909.00	363,600
シップヘルスケアホールディングス	4,900	2,318.00	11,358,200
明治電機工業	600	1,070.00	642,000
デリカフーズホールディングス	700	520.00	364,000
スターティアホールディングス	400	715.00	286,000
コメダホールディングス	3,600	2,268.00	8,164,800
ピーバンドットコム	300	520.00	156,000
アセンテック	600	640.00	384,000
富士興産	400	1,097.00	438,800
協栄産業	200	1,383.00	276,600
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,828.00	4,242,000
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,152.00	1,152,000
小野建	1,500	1,389.00	2,083,500
南陽	400	1,781.00	712,400
佐島電機	1,000	1,185.00	1,185,000
エコートレーディング	400	567.00	226,800
伯東	1,000	2,742.00	2,742,000
コンドーテック	1,300	988.00	1,284,400
中山福	1,000	319.00	319,000
ナガイレーベン	2,100	1,838.00	3,859,800
三菱食品	1,600	3,130.00	5,008,000
松田産業	1,200	1,981.00	2,377,200
第一興商	3,100	3,725.00	11,547,500
メディバルホールディングス	16,000	1,799.00	28,784,000
S P K	700	1,319.00	923,300
萩原電気ホールディングス	600	2,022.00	1,213,200
アズワン	2,400	5,730.00	13,752,000
スズデン	500	1,961.00	980,500
シモジマ	1,000	935.00	935,000
ドウシシャ	1,600	1,500.00	2,400,000
小津産業	400	1,834.00	733,600
高速	900	1,489.00	1,340,100
たけびし	600	1,437.00	862,200
リックス	400	1,833.00	733,200
丸文	1,400	752.00	1,052,800
ハピネット	1,300	1,537.00	1,998,100

橋本総業ホールディングス	300	1,916.00	574,800
日本ライフライン	4,900	903.00	4,424,700
タカショー	1,300	750.00	975,000
I D O M	5,000	706.00	3,530,000
進和	1,000	2,076.00	2,076,000
エスケイジャパン	500	457.00	228,500
ダイترون	700	1,926.00	1,348,200
シークス	2,200	998.00	2,195,600
田中商事	600	593.00	355,800
オーハシテクニカ	900	1,281.00	1,152,900
白銅	500	2,436.00	1,218,000
ダイコー通産	200	1,125.00	225,000
伊藤忠商事	101,800	3,702.00	376,863,600
丸紅	149,800	1,333.00	199,683,400
高島	300	2,479.00	743,700
長瀬産業	7,900	1,847.00	14,591,300
蝶理	900	1,901.00	1,710,900
豊田通商	15,300	4,785.00	73,210,500
三共生興	2,100	538.00	1,129,800
兼松	5,800	1,329.00	7,708,200
ツカモトコーポレーション	300	1,143.00	342,900
三井物産	121,700	3,213.00	391,022,100
日本紙パルプ商事	800	3,610.00	2,888,000
カメイ	1,800	1,047.00	1,884,600
東都水産	100	4,355.00	435,500
O U Gホールディングス	300	2,738.00	821,400
スターゼン	1,200	1,934.00	2,320,800
山善	6,200	993.00	6,156,600
椿本興業	300	3,535.00	1,060,500
住友商事	99,200	1,849.00	183,420,800
内田洋行	700	5,200.00	3,640,000
三菱商事	112,600	4,383.00	493,525,800
第一実業	700	3,350.00	2,345,000
キャノンマーケティングジャパン	4,100	2,887.00	11,836,700
西華産業	800	1,615.00	1,292,000
佐藤商事	1,200	1,100.00	1,320,000
菱洋エレクトロ	1,000	2,272.00	2,272,000
東京産業	1,400	690.00	966,000
ユアサ商事	1,400	3,355.00	4,697,000
神鋼商事	400	3,810.00	1,524,000
トルク	1,100	197.00	216,700
阪和興業	3,000	2,907.00	8,721,000

正栄食品工業	1,100	3,535.00	3,888,500
カナデン	1,400	1,003.00	1,404,200
菱電商事	1,300	1,585.00	2,060,500
岩谷産業	3,700	5,230.00	19,351,000
ナイス	600	1,622.00	973,200
ニチモウ	200	2,292.00	458,400
極東貿易	500	2,616.00	1,308,000
アステナホールディングス	2,300	416.00	956,800
三愛オブリ	3,800	950.00	3,610,000
稲畑産業	3,300	2,252.00	7,431,600
G S Iクレオス	800	1,268.00	1,014,400
明和産業	1,600	685.00	1,096,000
クワザワホールディングス	700	462.00	323,400
ワキタ	3,200	1,150.00	3,680,000
東邦ホールディングス	4,700	1,876.00	8,817,200
サンゲツ	4,100	1,521.00	6,236,100
ミツウロコグループホールディングス	2,100	891.00	1,871,100
シナネンホールディングス	600	3,340.00	2,004,000
伊藤忠エネクス	3,700	1,053.00	3,896,100
サンリオ	4,800	2,497.00	11,985,600
サンワテクノス	900	1,367.00	1,230,300
リョーサン	1,700	2,287.00	3,887,900
新光商事	2,300	871.00	2,003,300
トーヨー	700	1,312.00	918,400
三信電気	700	1,569.00	1,098,300
東陽テクニカ	1,700	1,095.00	1,861,500
モスフードサービス	2,200	3,010.00	6,622,000
加賀電子	1,400	3,085.00	4,319,000
ソーダニッカ	1,500	600.00	900,000
立花エレテック	1,200	1,518.00	1,821,600
フォーバル	700	809.00	566,300
P A L T A C	2,300	4,160.00	9,568,000
三谷産業	2,700	306.00	826,200
太平洋興発	700	626.00	438,200
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	3,870.00	1,548,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,842.00	368,400
コア商事ホールディングス	1,100	777.00	854,700
国際紙パルプ商事	3,200	455.00	1,456,000
ヤマタネ	700	1,554.00	1,087,800
丸紅建材リース	200	1,927.00	385,400
日鉄物産	1,100	5,100.00	5,610,000
泉州電業	400	5,190.00	2,076,000

トラスコ中山	3,400	1,708.00	5,807,200
オートバックスセブン	5,200	1,361.00	7,077,200
モリト	1,300	737.00	958,100
加藤産業	2,000	3,010.00	6,020,000
北恵	500	860.00	430,000
イノテック	1,000	1,320.00	1,320,000
イエローハット	2,700	1,607.00	4,338,900
J Kホールディングス	1,200	904.00	1,084,800
日伝	1,200	1,911.00	2,293,200
北沢産業	1,100	210.00	231,000
杉本商事	800	2,103.00	1,682,400
因幡電機産業	4,200	2,667.00	11,201,400
東テク	500	2,822.00	1,411,000
ミスミグループ本社	20,600	2,758.00	56,814,800
アルテック	1,200	234.00	280,800
タキヒヨー	500	998.00	499,000
葺王産業	300	1,913.00	573,900
スズケン	6,100	3,475.00	21,197,500
ジェコス	1,200	810.00	972,000
グローセル	2,000	400.00	800,000
ローソン	3,600	4,285.00	15,426,000
サンエー	1,200	3,955.00	4,746,000
カワチ薬品	1,300	2,025.00	2,632,500
エービーシー・マート	2,600	5,730.00	14,898,000
ハードオフコーポレーション	800	855.00	684,000
アスクル	3,800	1,435.00	5,453,000
ゲオホールディングス	2,100	1,199.00	2,517,900
アダストリア	1,800	1,959.00	3,526,200
ジーフット	1,100	330.00	363,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	398.00	119,400
くら寿司	1,700	2,906.00	4,940,200
キャンドウ	600	2,128.00	1,276,800
アイケイ	600	515.00	309,000
パルグループホールディングス	1,500	1,743.00	2,614,500
エディオン	7,600	1,177.00	8,945,200
サーラコーポレーション	3,400	619.00	2,104,600
ワッツ	900	705.00	634,500
ハローズ	800	2,941.00	2,352,800
フジオフードグループ本社	1,300	1,345.00	1,748,500
あみやき亭	400	2,868.00	1,147,200
大黒天物産	500	4,030.00	2,015,000
ハニーズホールディングス	1,400	1,157.00	1,619,800

ファーマライズホールディングス	400	700.00	280,000
アルペン	1,200	1,960.00	2,352,000
ハブ	600	566.00	339,600
クオールホールディングス	2,000	1,269.00	2,538,000
ジーンズホールディングス	1,000	4,035.00	4,035,000
ビックカメラ	9,800	1,095.00	10,731,000
D C Mホールディングス	9,800	1,014.00	9,937,200
M o n o t a R O	20,700	1,785.00	36,949,500
東京一番フーズ	400	589.00	235,600
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,115.00	2,538,000
J . フロント リテイリング	18,700	1,113.00	20,813,100
ドトール・日レスホールディングス	2,700	1,527.00	4,122,900
マツキヨココカラ&カンパニー	9,800	4,815.00	47,187,000
ブロンコビリー	900	2,420.00	2,178,000
Z O Z O	11,300	2,368.00	26,758,400
トレジャー・ファクトリー	500	1,036.00	518,000
物語コーポレーション	800	5,680.00	4,544,000
三越伊勢丹ホールディングス	26,000	1,040.00	27,040,000
H a m e e	600	1,020.00	612,000
マーケットエンタープライズ	200	1,025.00	205,000
ウエルシアホールディングス	8,700	2,345.00	20,401,500
クリエイティブSDホールディングス	2,400	2,689.00	6,453,600
丸善C H Iホールディングス	2,100	384.00	806,400
ミサワ	400	612.00	244,800
ティーライフ	200	1,357.00	271,400
シュッピン	1,400	1,400.00	1,960,000
オイシックス・ラ・大地	2,400	1,526.00	3,662,400
ネクステージ	3,300	2,054.00	6,778,200
ジョイフル本田	5,000	1,570.00	7,850,000
鳥貴族ホールディングス	600	2,354.00	1,412,400
ホットランド	1,200	1,332.00	1,598,400
すかいらーくホールディングス	20,400	1,573.00	32,089,200
S F Pホールディングス	800	1,515.00	1,212,000
綿半ホールディングス	1,200	1,290.00	1,548,000
ヨシックスホールディングス	300	2,368.00	710,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,800	1,027.00	4,929,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,420.00	1,278,000
B E E N O S	800	1,959.00	1,567,200
あさひ	1,400	1,283.00	1,796,200
日本調剤	1,000	1,259.00	1,259,000
コスモス薬品	1,700	11,580.00	19,686,000
トーエル	800	874.00	699,200

セブン&アイ・ホールディングス	58,000	5,206.00	301,948,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	10,300	935.00	9,630,500
ツルハホールディングス	3,600	6,380.00	22,968,000
サンマルクホールディングス	1,300	1,527.00	1,985,100
フェリシモ	400	1,133.00	453,200
トリドールホールディングス	4,100	2,199.00	9,015,900
TOKYO BASE	1,700	329.00	559,300
ウイルプラスホールディングス	400	889.00	355,600
JMホールディングス	1,200	1,442.00	1,730,400
サツドラホールディングス	800	647.00	517,600
アレンザホールディングス	1,200	969.00	1,162,800
串カツ田中ホールディングス	500	1,810.00	905,000
バロックジャパンリミテッド	1,200	790.00	948,000
クスリのアオキホールディングス	1,500	5,060.00	7,590,000
FOOD & LIFE COMPANIE	8,800	2,762.00	24,305,600
メディカルシステムネットワーク	1,600	405.00	648,000
一家ホールディングス	400	580.00	232,000
藤久ホールディングス	600	707.00	424,200
はるやまホールディングス	800	431.00	344,800
ノジマ	2,700	2,832.00	7,646,400
カップ・クリエイト	2,300	1,390.00	3,197,000
ライトオン	1,300	715.00	929,500
良品計画	18,900	1,341.00	25,344,900
パリミキホールディングス	2,300	268.00	616,400
アドヴァングループ	1,500	785.00	1,177,500
アルビス	500	2,192.00	1,096,000
コナカ	2,100	333.00	699,300
ハウス オブ ローゼ	200	1,659.00	331,800
G - 7ホールディングス	1,900	1,362.00	2,587,800
イオン北海道	2,400	1,048.00	2,515,200
コジマ	2,900	588.00	1,705,200
ヒマラヤ	600	938.00	562,800
コーナン商事	2,300	3,525.00	8,107,500
エコス	600	1,985.00	1,191,000
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	32,800	1,902.00	62,385,600
西松屋チェーン	3,400	1,418.00	4,821,200
ゼンショーホールディングス	8,000	3,040.00	24,320,000
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,277.00	1,277,000
ハークスレイ	700	571.00	399,700
サイゼリヤ	2,400	2,579.00	6,189,600
V Tホールディングス	6,300	458.00	2,885,400

魚力	500	2,240.00	1,120,000
フジ・コーポレーション	900	1,166.00	1,049,400
ユナイテッドアローズ	1,700	1,924.00	3,270,800
ハイデイ日高	2,400	2,030.00	4,872,000
YU-WA Creation Holdings	1,100	234.00	257,400
コロワイド	6,800	1,792.00	12,185,600
ピーシーデポコーポレーション	2,100	337.00	707,700
壱番屋	1,200	4,805.00	5,766,000
PLANT	400	650.00	260,000
スギホールディングス	3,300	5,060.00	16,698,000
薬王堂ホールディングス	800	2,019.00	1,615,200
スクロール	2,600	869.00	2,259,400
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,749.00	2,623,500
木曽路	2,200	2,078.00	4,571,600
SRSホールディングス	2,400	836.00	2,006,400
千趣会	3,100	392.00	1,215,200
リテールパートナーズ	2,400	1,100.00	2,640,000
ケーヨー	3,100	927.00	2,873,700
上新電機	1,700	1,825.00	3,102,500
日本瓦斯	8,000	1,905.00	15,240,000
ロイヤルホールディングス	2,700	2,234.00	6,031,800
東天紅	200	913.00	182,600
いなげや	1,800	1,155.00	2,079,000
チヨダ	1,500	729.00	1,093,500
ライフコーポレーション	1,400	2,472.00	3,460,800
リンガーハット	2,000	2,277.00	4,554,000
MrMaxHD	2,100	578.00	1,213,800
AOKIホールディングス	3,200	663.00	2,121,600
オークワ	2,500	847.00	2,117,500
コメリ	2,500	2,638.00	6,595,000
青山商事	3,300	871.00	2,874,300
しまむら	1,900	11,250.00	21,375,000
はせがわ	1,000	264.00	264,000
高島屋	11,300	1,278.00	14,441,400
松屋	3,000	871.00	2,613,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,400	995.00	7,363,000
近鉄百貨店	500	2,385.00	1,192,500
丸井グループ	12,200	2,271.00	27,706,200
アクシアル リテイリング	1,200	2,953.00	3,543,600
イオン	57,100	2,172.00	124,021,200
イズミ	2,700	2,934.00	7,921,800
平和堂	2,600	1,861.00	4,838,600

フジ	3,900	2,216.00	8,642,400
ヤオコー	1,900	6,040.00	11,476,000
ゼビオホールディングス	2,300	890.00	2,047,000
ケーズホールディングス	14,400	1,234.00	17,769,600
Olympicグループ	900	643.00	578,700
日産東京販売ホールディングス	2,700	255.00	688,500
シルバーライフ	400	1,672.00	668,800
Genky DrugStores	700	3,185.00	2,229,500
ナルミヤ・インターナショナル	400	861.00	344,400
ブックオフグループホールディングス	1,000	966.00	966,000
ギフトホールディングス	300	2,037.00	611,100
アインホールディングス	2,100	6,780.00	14,238,000
元気寿司	500	2,475.00	1,237,500
ヤマダホールディングス	59,700	460.00	27,462,000
アークランドサカモト	2,600	1,458.00	3,790,800
ニトリホールディングス	6,500	12,155.00	79,007,500
愛眼	1,400	185.00	259,000
ケーユーホールディングス	900	1,019.00	917,100
吉野家ホールディングス	5,700	2,427.00	13,833,900
松屋フーズホールディングス	800	3,785.00	3,028,000
サガミホールディングス	2,400	1,121.00	2,690,400
関西フードマーケット	1,500	1,183.00	1,774,500
王将フードサービス	1,100	6,550.00	7,205,000
プレナス	1,900	1,924.00	3,655,600
ミニストップ	1,300	1,392.00	1,809,600
アークス	3,000	1,930.00	5,790,000
パローホールディングス	3,500	1,790.00	6,265,000
ベルク	700	5,030.00	3,521,000
大庄	900	1,136.00	1,022,400
ファーストリテイリング	2,200	67,140.00	147,708,000
サンドラッグ	6,200	2,767.00	17,155,400
サクスパーホールディングス	1,600	541.00	865,600
ヤマザワ	400	1,497.00	598,800
やまや	400	2,453.00	981,200
ベルーナ	3,600	686.00	2,469,600
島根銀行	500	512.00	256,000
じもとホールディングス	1,100	570.00	627,000
めぶきフィナンシャルグループ	71,200	259.00	18,440,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	2,000.00	4,000,000
九州フィナンシャルグループ	30,300	387.00	11,726,100
ゆうちょ銀行	38,700	986.00	38,158,200
富山第一銀行	3,700	434.00	1,605,800

コンコルディア・フィナンシャルグループ	85,400	467.00	39,881,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,100	756.00	6,879,600	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,359.00	1,902,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,493.00	5,983,200	
ひろぎんホールディングス	22,000	605.00	13,310,000	
おきなわフィナンシャルグループ	1,400	2,100.00	2,940,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,291.00	4,582,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,400	4,465.00	6,251,000	
プロクレアホールディングス	1,700	1,869.00	3,177,300	
新生銀行	10,700	1,936.00	20,715,200	
あおぞら銀行	9,200	2,649.00	24,370,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	984,000	740.20	728,356,800	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	177,900	510.20	90,764,580	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,400	4,110.00	116,724,000	
三井住友フィナンシャルグループ	108,900	4,016.00	437,342,400	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	49,200	746.00	36,703,200	
群馬銀行	27,900	373.00	10,406,700	
武蔵野銀行	2,200	1,752.00	3,854,400	
千葉興業銀行	3,700	257.00	950,900	
筑波銀行	6,500	186.00	1,209,000	
七十七銀行	4,600	1,918.00	8,822,800	
秋田銀行	1,000	1,558.00	1,558,000	
山形銀行	1,600	856.00	1,369,600	
岩手銀行	1,000	2,012.00	2,012,000	
東邦銀行	12,400	200.00	2,480,000	
東北銀行	800	980.00	784,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,500	2,472.00	30,900,000	
静岡銀行	35,900	809.00	29,043,100	
スルガ銀行	14,500	356.00	5,162,000	
八十二銀行	33,400	469.00	15,664,600	
山梨中央銀行	1,700	1,118.00	1,900,600	
大垣共立銀行	3,000	1,707.00	5,121,000	
福井銀行	1,400	1,308.00	1,831,200	
清水銀行	600	1,455.00	873,000	
富山銀行	300	1,849.00	554,700	
滋賀銀行	2,800	2,707.00	7,579,600	
南都銀行	2,300	1,950.00	4,485,000	
百五銀行	14,500	322.00	4,669,000	
京都銀行	5,400	5,870.00	31,698,000	
紀陽銀行	5,100	1,340.00	6,834,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,500	817.00	7,761,500	

山陰合同銀行	9,300	656.00	6,100,800
中国銀行	12,400	956.00	11,854,400
鳥取銀行	600	1,170.00	702,000
伊予銀行	19,500	656.00	12,792,000
百十四銀行	1,600	1,719.00	2,750,400
四国銀行	2,300	809.00	1,860,700
阿波銀行	2,300	1,996.00	4,590,800
大分銀行	900	1,802.00	1,621,800
宮崎銀行	1,000	2,050.00	2,050,000
佐賀銀行	900	1,426.00	1,283,400
琉球銀行	3,600	775.00	2,790,000
セブン銀行	48,800	250.00	12,200,000
みずほフィナンシャルグループ	201,200	1,509.00	303,610,800
高知銀行	600	728.00	436,800
山口フィナンシャルグループ	17,300	758.00	13,113,400
長野銀行	500	1,223.00	611,500
名古屋銀行	1,100	3,040.00	3,344,000
北洋銀行	22,100	217.00	4,795,700
愛知銀行	500	5,520.00	2,760,000
中京銀行	500	1,764.00	882,000
大光銀行	500	1,296.00	648,000
愛媛銀行	2,200	898.00	1,975,600
トマト銀行	600	1,009.00	605,400
京葉銀行	6,900	469.00	3,236,100
栃木銀行	7,700	256.00	1,971,200
北日本銀行	500	1,507.00	753,500
東和銀行	2,700	507.00	1,368,900
福島銀行	1,800	221.00	397,800
大東銀行	800	640.00	512,000
トモニホールディングス	12,200	308.00	3,757,600
フィデアホールディングス	1,500	1,262.00	1,893,000
池田泉州ホールディングス	18,000	193.00	3,474,000
F P G	5,600	910.00	5,096,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,395.00	1,813,500
マーキュリアホールディングス	900	592.00	532,800
S B Iホールディングス	20,300	2,560.00	51,968,000
ジャフコ グループ	6,300	1,612.00	10,155,600
大和証券グループ本社	117,100	615.60	72,086,760
野村ホールディングス	250,700	490.00	122,843,000
岡三証券グループ	12,200	334.00	4,074,800
丸三証券	4,900	476.00	2,332,400
東洋証券	5,200	180.00	936,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,000	371.00	6,307,000
光世証券	400	463.00	185,200
水戸証券	4,200	256.00	1,075,200
いちよし証券	3,000	630.00	1,890,000
松井証券	8,000	809.00	6,472,000
マネックスグループ	13,700	425.00	5,822,500
極東証券	2,000	675.00	1,350,000
岩井コスモホールディングス	1,600	1,228.00	1,964,800
アイザワ証券グループ	2,400	676.00	1,622,400
マネーパートナーズグループ	1,800	240.00	432,000
スパークス・グループ	7,700	245.00	1,886,500
かんぽ生命保険	16,500	2,223.00	36,679,500
S O M P Oホールディングス	24,600	5,914.00	145,484,400
アニコム ホールディングス	5,000	644.00	3,220,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,800	4,059.00	141,253,200
第一生命ホールディングス	78,200	2,645.00	206,839,000
東京海上ホールディングス	48,000	7,435.00	356,880,000
T & Dホールディングス	38,600	1,606.00	61,991,600
アドバンスクリエイト	800	958.00	766,400
全国保証	3,900	4,265.00	16,633,500
あんしん保証	700	264.00	184,800
ジェイリース	600	1,773.00	1,063,800
イントラスト	700	532.00	372,400
日本モーゲージサービス	900	943.00	848,700
C a s a	600	833.00	499,800
アルヒ	2,400	990.00	2,376,000
プレミアグループ	800	3,835.00	3,068,000
ネットプロテクションズホールディングス	5,000	512.00	2,560,000
クレディセゾン	9,900	1,525.00	15,097,500
芙蓉総合リース	1,500	7,510.00	11,265,000
みずほリース	2,200	3,050.00	6,710,000
東京センチュリー	2,800	4,105.00	11,494,000
日本証券金融	6,500	857.00	5,570,500
アイフル	27,500	343.00	9,432,500
リコーリース	1,500	3,420.00	5,130,000
イオンフィナンシャルサービス	8,900	1,200.00	10,680,000
アコム	32,400	314.00	10,173,600
ジャックス	1,700	3,285.00	5,584,500
オリエントコーポレーション	44,500	123.00	5,473,500
オリックス	97,500	2,314.50	225,663,750
三菱HCキャピタル	55,600	618.00	34,360,800
九州リースサービス	700	565.00	395,500

日本取引所グループ	39,100	2,076.50	81,191,150
イー・ギャランティ	2,400	1,952.00	4,684,800
アサックス	900	596.00	536,400
NECキャピタルソリューション	700	1,955.00	1,368,500
いちご	18,700	286.00	5,348,200
日本駐車場開発	17,400	166.00	2,888,400
スター・マイカ・ホールディングス	1,000	1,556.00	1,556,000
SREホールディングス	500	1,819.00	909,500
ADワークスグループ	3,900	153.00	596,700
ヒューリック	37,000	1,055.00	39,035,000
三栄建築設計	700	1,607.00	1,124,900
野村不動産ホールディングス	8,500	3,215.00	27,327,500
三重交通グループホールディングス	3,500	482.00	1,687,000
サムティ	2,500	1,999.00	4,997,500
ディア・ライフ	2,200	534.00	1,174,800
コーセーアールイー	700	618.00	432,600
地主	1,100	1,970.00	2,167,000
プレサンスコーポレーション	2,000	1,490.00	2,980,000
THEグローバル社	1,700	145.00	246,500
ハウスコム	400	973.00	389,200
JPMC	900	996.00	896,400
サンセイランディック	600	874.00	524,400
エストラスト	400	547.00	218,800
フージャースホールディングス	2,300	793.00	1,823,900
オープンハウスグループ	5,200	5,100.00	26,520,000
東急不動産ホールディングス	46,000	672.00	30,912,000
飯田グループホールディングス	13,700	2,031.00	27,824,700
イーランド	300	1,411.00	423,300
ムゲンエステート	1,300	482.00	626,600
ビーロッド	1,400	485.00	679,000
ファーストブラザーズ	500	849.00	424,500
And Doホールディングス	900	876.00	788,400
シーアールイー	600	1,583.00	949,800
プロパティエージェント	300	1,429.00	428,700
ケイアイスター不動産	800	4,365.00	3,492,000
アグレ都市デザイン	300	1,435.00	430,500
グッドコムアセット	800	1,219.00	975,200
ジェイ・エス・ビー	400	3,260.00	1,304,000
ロードスターキャピタル	500	1,519.00	759,500
テンポイノベーション	600	821.00	492,600
グローバル・リンク・マネジメント	400	915.00	366,000
フェイスネットワーク	300	1,339.00	401,700

パーク24	9,800	1,861.00	18,237,800
パラカ	500	1,717.00	858,500
三井不動産	67,800	2,888.00	195,806,400
三菱地所	98,300	1,936.50	190,357,950
平和不動産	2,700	3,870.00	10,449,000
東京建物	14,800	1,707.00	25,263,600
京阪神ビルディング	2,400	1,245.00	2,988,000
住友不動産	31,200	3,485.00	108,732,000
テオオーシー	2,800	621.00	1,738,800
東京楽天地	300	3,890.00	1,167,000
スターツコーポレーション	2,300	2,560.00	5,888,000
フジ住宅	2,100	631.00	1,325,100
空港施設	1,900	524.00	995,600
明和地所	1,000	608.00	608,000
ゴールドクレスト	1,400	1,665.00	2,331,000
エスリード	700	1,638.00	1,146,600
日神グループホールディングス	2,900	432.00	1,252,800
日本エスコン	3,200	762.00	2,438,400
タカラレーベン	7,200	333.00	2,397,600
A V A N T I A	900	826.00	743,400
イオンモール	8,300	1,599.00	13,271,700
毎日コムネット	700	656.00	459,200
ファースト住建	700	1,080.00	756,000
カチタス	4,100	2,622.00	10,750,200
トーセイ	2,300	1,130.00	2,599,000
サンフロンティア不動産	2,400	1,058.00	2,539,200
F Jネクストホールディングス	1,700	1,044.00	1,774,800
インテリックス	600	585.00	351,000
ランドビジネス	1,100	233.00	256,300
グランディハウス	1,400	523.00	732,200
日本空港ビルデング	5,600	5,000.00	28,000,000
明豊ファシリティワークス	700	619.00	433,300
日本工営	1,000	3,270.00	3,270,000
L I F U L L	5,000	161.00	805,000
ミクシィ	3,600	2,169.00	7,808,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	1,658.00	2,155,400
日本M&Aセンターホールディングス	26,100	1,331.00	34,739,100
メンバーズ	400	2,628.00	1,051,200
中広	300	382.00	114,600
UTグループ	2,300	2,300.00	5,290,000
アイティメディア	800	1,553.00	1,242,400
E・Jホールディングス	900	1,142.00	1,027,800

夢真ビーネックスグループ	5,200	1,355.00	7,046,000
コシダカホールディングス	4,300	764.00	3,285,200
アルトナー	400	832.00	332,800
パソナグループ	1,700	1,868.00	3,175,600
C D S	400	1,812.00	724,800
リンクアンドモチベーション	3,500	424.00	1,484,000
エス・エム・エス	5,400	2,556.00	13,802,400
サニーサイドアップグループ	600	560.00	336,000
パーソルホールディングス	15,900	2,267.00	36,045,300
リニカル	900	762.00	685,800
クックパッド	5,000	202.00	1,010,000
エスクリ	700	400.00	280,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	563.00	450,400
学情	700	943.00	660,100
スタジオアリス	700	2,266.00	1,586,200
シミックホールディングス	800	1,406.00	1,124,800
エプコ	400	726.00	290,400
N J S	400	1,933.00	773,200
総合警備保障	6,000	3,520.00	21,120,000
カカクコム	11,700	2,155.00	25,213,500
アイロムグループ	600	1,746.00	1,047,600
セントケア・ホールディング	1,100	799.00	878,900
サイネックス	300	588.00	176,400
ルネサンス	1,100	921.00	1,013,100
ディップ	2,800	3,440.00	9,632,000
デジタルホールディングス	1,100	1,287.00	1,415,700
新日本科学	1,900	1,910.00	3,629,000
キャリアデザインセンター	400	1,113.00	445,200
ベネフィット・ワン	5,800	1,690.00	9,802,000
エムスリー	28,100	3,566.00	100,204,600
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	323.00	355,300
プラス	200	848.00	169,600
アウトソーシング	9,100	1,061.00	9,655,100
ウェルネット	1,500	486.00	729,000
ワールドホールディングス	600	2,299.00	1,379,400
ディー・エヌ・エー	6,100	1,728.00	10,540,800
博報堂D Yホールディングス	20,800	1,176.00	24,460,800
ぐるなび	2,400	402.00	964,800
タカミヤ	2,000	363.00	726,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	764.00	764,000
ファンコミュニケーションズ	3,700	388.00	1,435,600
ライク	500	2,060.00	1,030,000

ビジネス・ブレイクスルー	600	414.00	248,400
エスプール	4,500	1,108.00	4,986,000
WDBホールディングス	700	2,184.00	1,528,800
ティア	1,000	431.00	431,000
CDG	200	1,283.00	256,600
アドウェイズ	2,400	658.00	1,579,200
バリューコマース	1,200	2,963.00	3,555,600
インフォマート	17,500	378.00	6,615,000
JPHホールディングス	4,200	219.00	919,800
エコナックホールディングス	2,900	86.00	249,400
CLホールディングス	400	971.00	388,400
プレステージ・インターナショナル	6,000	609.00	3,654,000
アミューズ	900	1,971.00	1,773,900
ドリームインキュベータ	500	2,145.00	1,072,500
クイック	1,000	1,397.00	1,397,000
TAC	900	225.00	202,500
電通グループ	15,400	4,205.00	64,757,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,487.00	1,040,900
ぴあ	500	3,280.00	1,640,000
イオンファンタジー	600	2,474.00	1,484,400
シーティーエス	1,800	785.00	1,413,000
ネクシィーズグループ	500	527.00	263,500
H.U.グループホールディングス	4,200	2,687.00	11,285,400
アルプス技研	1,300	1,801.00	2,341,300
ダイオーズ	300	1,045.00	313,500
日本空調サービス	1,700	781.00	1,327,700
オリエンタルランド	17,500	18,085.00	316,487,500
ダスキン	3,500	2,676.00	9,366,000
明光ネットワークジャパン	1,900	592.00	1,124,800
ファルコホールディングス	700	2,040.00	1,428,000
秀英予備校	400	430.00	172,000
ラウンドワン	4,400	1,575.00	6,930,000
リゾートトラスト	6,900	2,064.00	14,241,600
ビー・エム・エル	2,000	3,435.00	6,870,000
りらいあコミュニケーションズ	2,300	1,042.00	2,396,600
リソー教育	7,300	316.00	2,306,800
早稲田アカデミー	900	1,126.00	1,013,400
ユー・エス・エス	17,800	2,355.00	41,919,000
東京個別指導学院	1,400	595.00	833,000
サイバーエージェント	35,800	1,250.00	44,750,000
楽天グループ	76,500	649.00	49,648,500
クリーク・アンド・リバー社	800	1,876.00	1,500,800

モーニングスター	2,800	499.00	1,397,200
テー・オー・ダブリュー	3,100	324.00	1,004,400
山田コンサルティンググループ	800	1,100.00	880,000
セントラルスポーツ	600	2,389.00	1,433,400
フルキャストホールディングス	1,400	2,101.00	2,941,400
エン・ジャパン	2,800	1,707.00	4,779,600
リソルホールディングス	200	4,500.00	900,000
テクノプロ・ホールディングス	9,500	2,670.00	25,365,000
アトラグループ	400	200.00	80,000
インターワークス	500	370.00	185,000
アイ・アールジャパンホールディングス	700	1,991.00	1,393,700
K e e P e r 技研	1,000	3,210.00	3,210,000
ファーストロジック	300	810.00	243,000
三機サービス	300	1,025.00	307,500
G u n o s y	900	916.00	824,400
デザインワン・ジャパン	500	176.00	88,000
イー・ガーディアン	600	2,810.00	1,686,000
リブセンス	900	164.00	147,600
ジャパンマテリアル	4,900	1,869.00	9,158,100
ベクトル	2,200	998.00	2,195,600
ウチヤマホールディングス	800	291.00	232,800
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	967.00	1,160,400
キャリアリンク	600	1,903.00	1,141,800
I B J	1,300	696.00	904,800
アサンテ	700	1,500.00	1,050,000
バリューHR	1,300	1,230.00	1,599,000
M & A キャピタルパートナーズ	1,300	3,065.00	3,984,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,162.00	697,200
E R I ホールディングス	500	1,422.00	711,000
アビスト	300	2,803.00	840,900
シグマクシス・ホールディングス	1,900	978.00	1,858,200
ウィルグループ	1,200	1,063.00	1,275,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	167.00	317,300
メドピア	1,200	1,859.00	2,230,800
レアジョブ	300	539.00	161,700
リクルートホールディングス	116,900	4,017.00	469,587,300
エラン	2,200	992.00	2,182,400
土木管理総合試験所	800	324.00	259,200
ネットマーケティング	800	633.00	506,400
日本郵政	190,500	964.80	183,794,400
ベルシステム24ホールディングス	2,300	1,365.00	3,139,500
鎌倉新書	1,900	498.00	946,200

SMN	400	600.00	240,000
一蔵	200	506.00	101,200
グローバルキッズCOMPANY	300	671.00	201,300
エアトリ	1,000	2,550.00	2,550,000
アトラエ	1,100	1,728.00	1,900,800
ストライク	700	3,370.00	2,359,000
ソラスト	3,900	649.00	2,531,100
セラク	500	1,051.00	525,500
インソース	1,700	1,990.00	3,383,000
ベikalent・コンサルティング	1,100	31,650.00	34,815,000
Orchestra Holdings	300	2,505.00	751,500
アイモバイル	700	1,351.00	945,700
キャリアインデックス	600	461.00	276,600
MS - Japan	700	873.00	611,100
船場	300	670.00	201,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,000	1,300.00	6,500,000
フルテック	200	1,311.00	262,200
ツナググループ・ホールディングス	500	313.00	156,500
GameWith	500	466.00	233,000
MS&Consulting	200	701.00	140,200
ウェルビー	1,100	739.00	812,900
エル・ティー・エス	200	3,470.00	694,000
ミダックホールディングス	700	2,620.00	1,834,000
日総工産	1,300	556.00	722,800
キュービーネットホールディングス	700	1,273.00	891,100
RPAホールディングス	2,300	375.00	862,500
スプリックス	500	963.00	481,500
マネジメントソリューションズ	800	2,515.00	2,012,000
プロレド・パートナーズ	400	487.00	194,800
and factory	500	411.00	205,500
テノ・ホールディングス	200	640.00	128,000
フロンティア・マネジメント	400	1,185.00	474,000
ピアラ	300	707.00	212,100
コプロ・ホールディングス	300	893.00	267,900
ギークス	300	955.00	286,500
カーブスホールディングス	4,400	652.00	2,868,800
フォーラムエンジニアリング	1,000	925.00	925,000
Fast Fitness Japan	300	1,359.00	407,700
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	1,676.00	2,849,200
ポピンズ	400	1,878.00	751,200
LITALICO	1,300	2,247.00	2,921,100
アドバンテッジリスクマネジメント	800	456.00	364,800

リログループ	8,700	1,995.00	17,356,500
東祥	1,200	1,267.00	1,520,400
ビーウィズ	400	1,358.00	543,200
TREホールディングス	2,700	1,876.00	5,065,200
人・夢・技術グループ	600	2,366.00	1,419,600
エイチ・アイ・エス	3,400	1,959.00	6,660,600
ラックランド	500	2,970.00	1,485,000
共立メンテナンス	2,800	4,885.00	13,678,000
イチネンホールディングス	1,600	1,198.00	1,916,800
建設技術研究所	900	2,500.00	2,250,000
スペース	1,100	901.00	991,100
燦ホールディングス	700	1,770.00	1,239,000
スバル興業	100	8,860.00	886,000
東京テアトル	600	1,210.00	726,000
タナベ経営	600	651.00	390,600
ナガワ	500	7,890.00	3,945,000
東京都競馬	1,200	3,750.00	4,500,000
常盤興産	600	1,280.00	768,000
カナモト	2,700	1,959.00	5,289,300
西尾レントオール	1,400	2,728.00	3,819,200
トランス・コスモス	2,000	3,450.00	6,900,000
乃村工藝社	6,800	860.00	5,848,000
藤田観光	700	2,871.00	2,009,700
KNT-CTホールディングス	1,000	1,589.00	1,589,000
日本管財	1,700	2,520.00	4,284,000
トーカイ	1,300	1,638.00	2,129,400
白洋舎	200	1,461.00	292,200
セコム	15,700	8,106.00	127,264,200
セントラル警備保障	800	2,194.00	1,755,200
丹青社	3,100	822.00	2,548,200
メイテック	1,900	6,520.00	12,388,000
応用地質	1,600	1,708.00	2,732,800
船井総研ホールディングス	3,100	2,012.00	6,237,200
進学会ホールディングス	600	361.00	216,600
オオバ	1,000	736.00	736,000
いであ	400	1,730.00	692,000
学究社	500	1,542.00	771,000
ベネッセホールディングス	5,300	2,066.00	10,949,800
イオンディライト	1,800	2,754.00	4,957,200
ナック	800	936.00	748,800
ダイセキ	2,900	4,410.00	12,789,000
ステップ	600	1,729.00	1,037,400

合 計	17,354,900	40,571,484,680
-----	------------	----------------

## (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12月15日現在	2022年 6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	427,455,715	621,206,543
コール・ローン	2,621,684,108	1,599,829,970
株式	245,457,434,444	228,190,935,256
投資証券	5,880,793,918	5,633,395,197
派生商品評価勘定	20,785,506	90,712,645
未収入金	29,621,522	41,752,959
未収配当金	229,488,883	308,157,720
差入委託証拠金	780,462,553	474,982,389
流動資産合計	255,447,726,649	236,960,972,679
資産合計	255,447,726,649	236,960,972,679
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,633,585	158,808,027
未払金	213,450	7,760
未払解約金	180,294,879	40,386,287
未払利息	838	697
流動負債合計	222,142,752	199,202,771
負債合計	222,142,752	199,202,771
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	62,271,175,728	59,803,606,565
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	192,954,408,169	176,958,163,343
元本等合計	255,225,583,897	236,761,769,908
純資産合計	255,225,583,897	236,761,769,908
負債純資産合計	255,447,726,649	236,960,972,679

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
1.	期首	2021年 6月16日	2021年12月16日
	期首元本額	63,265,396,098円	62,271,175,728円
	期首からの追加設定元本額	4,096,403,568円	4,389,469,559円
	期首からの一部解約元本額	5,090,623,938円	6,857,038,722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)	26,237,072,340円	28,224,580,157円
	DCインデックスバランス(株式20)	110,060,865円	117,650,029円
	DCインデックスバランス(株式40)	297,255,260円	311,581,626円
	DCインデックスバランス(株式60)	592,759,003円	622,227,394円
	DCインデックスバランス(株式80)	639,167,850円	669,506,159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	1,482,800,678円	1,425,455,379円
	日興五大陸株式ファンド	3,846,262,587円	3,752,729,441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)	19,208,793円	14,764,881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)	104,560,092円	89,961,945円

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	6,104,455,535円	5,911,056,803円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	16,214,802,024円	12,286,822,515円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,504,286円	3,481,865円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,088,122円	2,914,533円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	3,796,020円	3,518,782円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	3,214,240円	3,188,755円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,272,831,900円	1,962,413,877円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	18,914,144円	19,310,821円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	53,955,110円	53,473,246円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	82,128,936円	80,281,654円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	79,547,174円	78,497,020円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,101,790,769円	4,170,189,683円
計	62,271,175,728円	59,803,606,565円
2. 受益権の総数	62,271,175,728口	59,803,606,565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 2021年 6月16日 至 2021年12月15日	自 2021年12月16日 至 2022年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月15日現在	2022年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(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

(2022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	48,776,992,756
投資証券	1,199,855,777
合計	49,976,848,533

(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

(2022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	2,558,359,158	-	2,400,974,581	157,384,577
合計		2,558,359,158	-	2,400,974,581	157,384,577

## (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

(2022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	1,916,698,840	-	2,007,407,390	90,708,550
	米ドル	1,602,382,860	-	1,683,450,800	81,067,940
	ユーロ	314,315,980	-	323,956,590	9,640,610
	売建	519,195,500	-	520,614,855	1,419,355
	米ドル	498,071,000	-	499,494,450	1,423,450
	ユーロ	21,124,500	-	21,120,405	4,095
	合計	2,435,894,340	-	2,528,022,245	89,289,195

## （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12月15日現在		2022年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	4.0986円	1口当たり純資産額	3.9590円
(1万口当たり純資産額)	(40,986円)	(1万口当たり純資産額)	(39,590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	APA CORP	12,760	46.00	586,960.00
	BAKER HUGHES CO	35,865	32.93	1,181,034.45
	CHENIERE ENERGY INC	9,010	130.52	1,175,985.20
	CHEVRON CORP	73,581	167.55	12,328,496.55
	CONOCOPHILLIPS	49,906	111.49	5,564,019.94
	COTERRA ENERGY INC	26,800	31.11	833,748.00
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,690	70.59	1,742,867.10
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,600	149.63	987,558.00
	EOG RESOURCES INC	22,352	131.26	2,933,923.52
	EQT CORP	12,460	40.83	508,741.80
	EXXON MOBIL CORP	160,671	96.10	15,440,483.10
	HALLIBURTON CO	33,827	36.67	1,240,436.09
	HESS CORP	10,280	120.07	1,234,319.60
	KINDER MORGAN INC	77,230	17.89	1,381,644.70
	MARATHON OIL CORP	26,600	28.79	765,814.00
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,572	102.67	2,214,797.24
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,571	62.09	2,208,603.39
	ONEOK INC	17,270	60.39	1,042,935.30
	PHILLIPS 66	18,185	104.13	1,893,604.05
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,890	264.55	2,351,849.50
	SCHLUMBERGER LTD	53,731	43.22	2,322,253.82
	TARGA RESOURCES CORP	7,970	66.30	528,411.00
	VALERO ENERGY CORP	15,632	133.75	2,090,780.00
	WILLIAMS COS INC	47,104	32.34	1,523,343.36
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,505	239.22	2,034,566.10
	ALBEMARLE CORP	4,260	223.33	951,385.80
	ALCOA CORP	6,700	48.92	327,764.00
	AMCOR PLC	59,510	12.09	719,475.90
	AVERY DENNISON CORP	3,200	161.09	515,488.00
	BALL CORP	11,780	66.50	783,370.00
	CELANESE CORP	4,030	136.21	548,926.30
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,060	93.25	751,595.00
	CLEVELAND-CLIFFS INC	19,100	17.64	336,924.00
CORTEVA INC	27,302	56.39	1,539,559.78	
CROWN HOLDINGS INC	4,855	94.02	456,467.10	

DOW INC	27,835	58.56	1,630,017.60
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	60.37	1,156,809.94
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	96.24	490,342.80
ECOLAB INC	9,990	150.28	1,501,297.20
FMC CORP	4,840	107.92	522,332.80
FREEMPORT-MCMORAN INC	56,018	36.82	2,062,582.76
INTERNATIONAL PAPER CO	13,840	43.62	603,700.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	117.17	1,130,104.65
LINDE PLC	19,475	295.62	5,757,199.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	97.48	979,674.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	316.47	746,869.20
MOSAIC CO/THE	14,160	52.73	746,656.80
NEWMONT CORP	31,732	63.09	2,001,971.88
NUCOR CORP	10,389	113.72	1,181,437.08
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	147.23	527,083.40
PPG INDUSTRIES INC	8,774	111.51	978,388.74
RPM INTERNATIONAL INC	4,810	77.74	373,929.40
SEALED AIR CORP	5,746	58.58	336,600.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,521	229.48	2,184,879.08
STEEL DYNAMICS INC	7,510	71.02	533,360.20
VULCAN MATERIALS CO	4,923	151.04	743,569.92
WESTLAKE CORP	1,310	114.37	149,824.70
WESTROCK CO	9,989	42.77	427,229.53
3M CO	21,646	135.25	2,927,621.50
AERCAP HOLDINGS NV	4,850	39.63	192,205.50
ALLEGION PLC	3,340	101.27	338,241.80
AMETEK INC	8,753	111.34	974,559.02
BOEING CO/THE	21,252	122.16	2,596,144.32
CARRIER GLOBAL CORP	30,498	35.94	1,096,098.12
CATERPILLAR INC	20,416	206.69	4,219,783.04
CUMMINS INC	5,365	196.61	1,054,812.65
DEERE & CO	11,200	326.58	3,657,696.00
DOVER CORP	5,350	123.00	658,050.00
EATON CORP PLC	15,446	130.52	2,016,011.92
EMERSON ELECTRIC CO	23,010	84.70	1,948,947.00

FASTENAL CO	21,616	49.13	1,061,994.08
FORTIVE CORP	12,674	56.07	710,631.18
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,050	61.32	309,666.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	240.15	585,966.00
GENERAL DYNAMICS CORP	9,012	215.90	1,945,690.80
GENERAL ELECTRIC CO	41,787	68.05	2,843,605.35
HEICO CORP	2,000	133.39	266,780.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	108.06	267,988.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,916	183.28	4,749,884.48
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	32.20	470,216.60
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	204.81	313,359.30
IDEX CORP	2,830	179.41	507,730.30
ILLINOIS TOOL WORKS	11,835	185.93	2,200,481.55
INGERSOLL-RAND INC	15,268	43.77	668,280.36
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,370	53.68	449,301.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	26,334	49.60	1,306,166.40
KORNIT DIGITAL LTD	1,640	33.95	55,678.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,590	226.92	1,722,322.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,270	195.49	248,272.30
LOCKHEED MARTIN CORP	9,276	416.17	3,860,392.92
MASCO CORP	8,979	51.21	459,814.59
NORDSON CORP	2,010	200.82	403,648.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,644	454.46	2,564,972.24
OTIS WORLDWIDE CORP	14,944	69.21	1,034,274.24
OWENS CORNING	3,510	82.66	290,136.60
PACCAR INC	13,274	84.16	1,117,139.84
PARKER HANNIFIN CORP	4,895	252.63	1,236,623.85
PENTAIR PLC	5,588	45.86	256,265.68
PLUG POWER INC	20,280	14.20	287,976.00
QUANTA SERVICES INC	5,300	123.55	654,815.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	56,836	91.32	5,190,263.52
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	200.42	862,407.26
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	43.54	281,703.80
SMITH (A.O.) CORP	4,770	55.64	265,402.80
SNAP-ON INC	2,080	205.57	427,585.60

STANLEY BLACK & DECKER INC	6,156	106.77	657,276.12
TEXTRON INC	7,956	60.19	478,871.64
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,996	126.68	1,139,613.28
TRANSDIGM GROUP INC	1,980	527.65	1,044,747.00
UNITED RENTALS INC	2,740	260.12	712,728.80
WABTEC CORP	5,780	86.32	498,929.60
MW GRAINGER INC	1,667	469.90	783,323.30
XYLEM INC	6,808	76.50	520,812.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	82.02	415,841.40
CINTAS CORP	3,667	352.44	1,292,397.48
CLARIVATE PLC	13,360	13.21	176,485.60
COPART INC	8,140	103.59	843,222.60
COSTAR GROUP INC	14,910	55.17	822,584.70
EQUIFAX INC	4,654	172.02	800,581.08
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,880	124.32	606,681.60
LEIDOS HOLDINGS INC	4,840	97.91	473,884.40
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	123.06	1,000,477.80
ROBERT HALF INTL INC	4,055	81.43	330,198.65
ROLLINS INC	9,015	32.78	295,511.70
TRANSUNION	7,270	77.33	562,189.10
VERISK ANALYTICS INC	5,800	158.23	917,734.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,566	117.36	1,122,665.76
WASTE MANAGEMENT INC	16,104	145.62	2,345,064.48
AMERCO	375	464.38	174,142.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	106.35	524,305.50
CSX CORP	82,539	29.34	2,421,694.26
DELTA AIR LINES INC	5,105	31.38	160,194.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	98.60	643,562.20
FEDEX CORP	9,583	229.95	2,203,610.85
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	38,100	2.45	93,345.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	161.42	529,457.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,180	45.17	279,150.60
LYFT INC-A	10,570	14.16	149,671.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,970	222.81	1,998,605.70
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	239.47	875,262.85

SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	37.22	203,593.40
UBER TECHNOLOGIES INC	54,310	21.09	1,145,397.90
UNION PACIFIC CORP	24,051	208.49	5,014,392.99
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,687	174.16	4,821,967.92
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,920	49.95	145,854.00
APTIV PLC	10,120	94.92	960,590.40
BORGWARNER INC	9,890	35.06	346,743.40
FORD MOTOR COMPANY	150,375	12.20	1,834,575.00
GENERAL MOTORS CORP	50,195	33.20	1,666,474.00
LEAR CORP	2,140	126.34	270,367.60
LUCID GROUP INC	16,510	16.60	274,066.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	6,450	27.30	176,085.00
TESLA INC	33,325	662.67	22,083,477.75
DR HORTON INC	12,876	65.72	846,210.72
GARMIN LTD	5,865	96.72	567,262.80
HASBRO INC	4,668	80.75	376,941.00
LENNAR CORP-CL A	10,480	69.14	724,587.20
LULULEMON ATHLETICA INC	4,470	280.50	1,253,835.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,118	123.61	261,805.98
NEWELL BRANDS INC	14,466	18.47	267,187.02
NIKE INC -CL B	48,528	110.72	5,373,020.16
NVR INC	125	3,905.08	488,135.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,230	9.58	98,003.40
PULTE GROUP INC	10,010	39.88	399,198.80
VF CORP	12,160	45.42	552,307.20
WHIRLPOOL CORP	2,259	155.36	350,958.24
AIRBNB INC-CLASS A	12,100	98.87	1,196,327.00
ARAMARK	8,020	30.33	243,246.60
BOOKING HOLDINGS INC	1,573	1,951.51	3,069,725.23
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	39.39	313,938.30
CARNIVAL CORP	30,727	9.52	292,521.04
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,080	1,204.01	1,300,330.80
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	114.03	575,053.29
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	377.13	518,553.75
EXPEDIA GROUP INC	5,422	101.93	552,664.46

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,800	119.14	1,286,712.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	12,900	32.27	416,283.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,633	152.22	1,618,555.26	
MCDONALD'S CORP	28,171	238.76	6,726,107.96	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,080	29.40	413,952.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	39.49	345,458.52	
STARBUCKS CORP	44,704	72.31	3,232,546.24	
VAIL RESORTS INC	1,520	230.86	350,907.20	
WYNN RESORTS LTD	4,180	58.01	242,481.80	
YUM! BRANDS INC	10,804	110.23	1,190,924.92	
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,820	74.64	2,225,764.80	
ALPHABET INC-CL A	11,405	2,134.31	24,341,805.55	
ALPHABET INC-CL C	10,760	2,143.88	23,068,148.80	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	19,410	11.92	231,367.20	
CABLE ONE INC	240	1,223.85	293,724.00	
CHARTER COMMUNICATION-A	4,556	451.97	2,059,175.32	
COMCAST CORP-CLASS A	171,144	39.84	6,818,376.96	
DISH NETWORK CORP-A	9,279	17.63	163,588.77	
ELECTRONIC ARTS INC	10,884	127.37	1,386,295.08	
FOX CORP - CLASS A	12,624	32.03	404,346.72	
FOX CORP- CLASS B	5,466	29.65	162,066.90	
IAC/INTERACTIVECORP	3,090	78.84	243,615.60	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,536	27.78	376,030.08	
LIBERTY BROADBAND-C	5,630	113.59	639,511.70	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	36.28	120,631.00	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,616	36.22	239,631.52	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,680	58.12	446,361.60	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	84.94	545,314.80	
MATCH GROUP INC	9,892	73.07	722,808.44	
META PLATFORMS INC-CLASS A	87,630	163.73	14,347,659.90	
NETFLIX INC	16,845	167.54	2,822,211.30	
NEWS CORP - CLASS A	16,290	15.55	253,309.50	
OMNICOM GROUP	7,807	64.95	507,064.65	
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	25.41	579,932.43	
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	17.19	360,130.50	

ROBLOX CORP -CLASS A	12,670	26.12	330,940.40
ROKU INC	4,350	74.29	323,161.50
SEA LTD-ADR	12,270	70.95	870,556.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	5.93	179,560.40
SNAP INC - A	40,460	11.91	481,878.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,450	121.41	661,684.50
THE WALT DISNEY CO.	69,462	94.22	6,544,709.64
TWITTER INC	30,590	37.22	1,138,559.80
WARNER BROS DISCOVERY INC	86,760	13.98	1,212,904.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	10,760	31.07	334,313.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,268	171.48	388,916.64
AMAZON.COM INC	347,320	102.31	35,534,309.20
AUTOZONE INC	807	2,033.58	1,641,099.06
BATH & BODY WORKS INC	9,970	32.80	327,016.00
BEST BUY CO INC	8,354	70.59	589,708.86
BURLINGTON STORES INC	2,585	158.43	409,541.55
CARMAX INC	6,249	89.79	561,097.71
CHEWY INC - CLASS A	3,410	27.05	92,240.50
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,960	230.02	2,060,979.20
DOLLAR TREE INC	8,426	156.02	1,314,624.52
DOORDASH INC - A	6,960	58.46	406,881.60
EBAY INC	22,417	42.58	954,515.86
ETSY INC	4,780	71.61	342,295.80
GENUINE PARTS CO	5,321	132.44	704,713.24
HOME DEPOT INC	39,645	278.67	11,047,872.15
LKQ CORP	10,810	48.52	524,501.20
LOWE'S COS INC	25,592	177.94	4,553,840.48
MERCADOLIBRE INC	1,740	616.40	1,072,536.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,600	596.69	1,551,394.00
POOL CORP	1,540	349.44	538,137.60
ROSS STORES INC	13,162	74.00	973,988.00
TARGET CORP	18,200	142.70	2,597,140.00
TJX COMPANIES INC	45,896	57.33	2,631,217.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,230	192.17	812,879.10
ULTA BEAUTY INC	1,945	392.67	763,743.15

WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	47.14	133,877.60
COSTCO WHOLESALE CORP	16,884	454.80	7,678,843.20
KROGER CO	26,620	50.39	1,341,381.80
SYSCO CORP	19,586	80.14	1,569,622.04
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,082	40.20	1,088,696.40
WALMART INC	57,682	119.46	6,890,691.72
ALTRIA GROUP INC	68,908	46.29	3,189,751.32
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,403	82.67	1,769,386.01
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	65.16	761,068.80
BUNGE LTD	5,157	104.35	538,132.95
CAMPBELL SOUP CO	7,885	45.44	358,294.40
COCA-COLA CO/THE	155,682	59.23	9,221,044.86
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	50.68	418,616.80
CONAGRA BRANDS INC	18,040	31.80	573,672.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,245	231.50	1,445,717.50
GENERAL MILLS INC	23,369	66.45	1,552,870.05
HERSHEY CO/THE	5,535	206.79	1,144,582.65
HORMEL FOODS CORP	11,500	45.12	518,880.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	125.36	513,976.00
KELLOGG CO	9,778	68.34	668,228.52
KEURIG DR PEPPER INC	26,090	34.40	897,496.00
KRAFT HEINZ CO/THE	25,761	36.14	931,002.54
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,250	83.80	775,150.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,200	51.36	369,792.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	52,325	58.47	3,059,442.75
MONSTER BEVERAGE CORP	15,130	88.06	1,332,347.80
PEPSICO INC	52,321	156.12	8,168,354.52
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	58,568	98.97	5,796,474.96
TYSON FOODS INC-CL A	11,216	83.92	941,246.72
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,090	82.00	745,380.00
CLOROX COMPANY	4,646	124.64	579,077.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,900	74.27	2,220,673.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,070	240.78	2,183,874.60
KIMBERLY-CLARK CORP	12,763	123.31	1,573,805.53
PROCTER & GAMBLE CO	90,729	133.84	12,143,169.36

ABBOTT LABORATORIES	66,776	102.94	6,873,921.44
ABIOMED INC	1,770	229.66	406,498.20
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	238.08	676,147.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	141.21	815,346.54
ANTHEM INC	9,111	460.40	4,194,704.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,499	67.48	1,315,792.52
BECTON DICKINSON AND CO	10,847	236.32	2,563,363.04
BOSTON SCIENTIFIC CORP	55,178	35.24	1,944,472.72
CARDINAL HEALTH INC	10,715	51.11	547,643.65
CENTENE CORP	23,297	76.23	1,775,930.31
CIGNA CORP	12,260	245.71	3,012,404.60
COOPER COS INC/THE	1,840	314.92	579,452.80
CVS HEALTH CORP	50,178	90.64	4,548,133.92
DAVITA INC	2,108	89.97	189,656.76
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	35.59	292,620.98
DEXCOM INC	3,660	69.31	253,674.60
DEXCOM INC (N)	10,980	69.31	761,023.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23,750	86.50	2,054,375.00
HCA HEALTHCARE INC	9,240	179.28	1,656,547.20
HENRY SCHEIN INC	5,280	75.00	396,000.00
HOLOGIC INC	9,208	67.87	624,946.96
HUMANA INC	4,785	423.93	2,028,505.05
IDEXX LABORATORIES INC	3,155	328.99	1,037,963.45
INSULET CORP	2,585	205.55	531,346.75
INTUITIVE SURGICAL INC	13,565	191.10	2,592,271.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,575	213.86	764,549.50
MASIMO CORP	2,020	123.06	248,581.20
MCKESSON CORP	5,599	306.52	1,716,205.48
MEDTRONIC PLC	50,698	88.48	4,485,759.04
MOLINA HEALTHCARE INC	2,230	261.69	583,568.70
NOVOCURE LTD	3,430	59.87	205,354.10
QUEST DIAGNOSTICS	4,656	127.07	591,637.92
RESMED INC	5,515	202.01	1,114,085.15
STERIS PLC	3,710	203.67	755,615.70
STRYKER CORP	12,893	200.58	2,586,077.94

TELADOC HEALTH INC	5,180	29.27	151,618.60
TELEFLEX INC	1,760	252.51	444,417.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,630	461.75	16,452,152.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,730	104.87	286,295.10
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,240	179.32	939,636.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,952	105.27	837,107.04
ABBVIE INC	67,176	137.62	9,244,761.12
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,650	116.01	1,351,516.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,520	133.52	603,510.40
AMGEN INC	21,041	235.70	4,959,363.70
AVANTOR INC	21,080	29.72	626,497.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	469.96	404,165.60
BIO-TECHNE CORP	1,480	324.18	479,786.40
BIOGEN INC	5,543	194.18	1,076,339.74
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	71.48	510,367.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	83,895	72.87	6,113,428.65
CATALENT INC	6,520	104.29	679,970.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	209.50	400,145.00
DANAHER CORP	25,849	242.42	6,266,314.58
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	20.90	345,393.40
ELI LILLY & CO	30,734	290.79	8,937,139.86
EXACT SCIENCES CORP	6,510	37.14	241,781.40
GILEAD SCIENCES INC	47,894	57.79	2,767,794.26
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,990	81.27	649,347.30
ILLUMINA INC	5,555	189.41	1,052,172.55
INCYTE CORP	7,110	66.18	470,539.80
IQVIA HOLDINGS INC	7,253	200.88	1,456,982.64
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	143.06	319,023.80
JOHNSON & JOHNSON	99,551	168.19	16,743,482.69
MERCK & CO. INC.	95,843	84.50	8,098,733.50
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	860	1,157.63	995,561.80
MODERNA INC	12,955	121.56	1,574,809.80
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	91.22	331,128.60
PERKINELMER INC	4,360	138.14	602,290.40
PFIZER INC	213,440	47.92	10,228,044.80

REGENERON PHARMACEUTICALS	4,055	548.35	2,223,559.25
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,010	38.20	496,982.00
SEAGEN INC	5,320	144.64	769,484.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	7.85	342,181.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,959	507.45	7,590,944.55
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,615	249.08	2,394,904.20
VIATRIS INC	45,819	10.32	472,852.08
WATERS CORP	2,336	321.49	751,000.64
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,830	280.61	794,126.30
ZOETIS INC	18,015	157.80	2,842,767.00
BANK OF AMERICA CORP	275,869	31.46	8,678,838.74
CITIGROUP INC	75,677	45.96	3,478,114.92
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,740	35.66	703,928.40
FIFTH THIRD BANCORP	25,549	34.58	883,484.42
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	622.75	280,237.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	136.96	924,480.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	56,330	12.24	689,479.20
JPMORGAN CHASE & CO	112,070	114.06	12,782,704.20
KEYCORP	35,998	17.54	631,404.92
M & T BANK CORP	6,343	164.90	1,045,960.70
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,960	155.66	2,484,333.60
REGIONS FINANCIAL CORP	37,044	19.35	716,801.40
SIGNATURE BANK	2,390	178.06	425,563.40
SVB FINANCIAL GROUP	2,155	406.39	875,770.45
TRUIST FINANCIAL CORP	50,400	46.24	2,330,496.00
US BANCORP	53,241	45.72	2,434,178.52
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,000	45.06	270,360.00
WELLS FARGO & CO	144,480	37.43	5,407,886.40
ALLY FINANCIAL INC	14,000	34.08	477,120.00
AMERICAN EXPRESS CO	24,614	144.60	3,559,184.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,265	243.07	1,036,693.55
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	13,290	49.36	655,994.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,662	40.60	1,244,877.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,885	277.64	13,572,431.40
BLACKROCK INC	5,790	591.23	3,423,221.70

BLACKSTONE INC	25,990	95.42	2,479,965.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,085	106.58	1,714,339.30
CARLYLE GROUP INC/THE	6,070	33.19	201,463.30
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	107.52	423,628.80
CME GROUP INC	13,610	196.11	2,669,057.10
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,270	51.58	220,246.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,860	91.84	997,382.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	26.21	377,948.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,460	350.72	512,051.20
FRANKLIN RESOURCES INC	10,315	23.08	238,070.20
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	43.83	78,894.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,858	282.54	3,632,899.32
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,340	94.05	2,007,027.00
INVESCO LTD	13,527	16.24	219,678.48
KKR & CO INC -A	20,050	47.10	944,355.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2,940	188.53	554,278.20
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	268.48	381,241.60
MOODY'S CORP	6,442	257.68	1,659,974.56
MORGAN STANLEY	51,163	74.96	3,835,178.48
MSCI INC	3,115	391.00	1,217,965.00
NASDAQ INC	4,485	145.87	654,226.95
NORTHERN TRUST CORP	7,340	93.60	687,024.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,010	86.78	608,327.80
S&P GLOBAL INC	13,475	317.43	4,277,369.25
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,103	61.11	3,367,344.33
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,605	52.86	243,420.30
STATE STREET CORP	15,277	62.18	949,923.86
SYNCHRONY FINANCIAL	20,820	29.51	614,398.20
T ROWE PRICE GROUP INC	8,125	107.68	874,900.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,010	64.74	324,347.40
UPSTART HOLDINGS INC	1,620	34.27	55,517.40
AFLAC INC	23,484	53.71	1,261,325.64
ALLEGHANY CORP	500	832.00	416,000.00
ALLSTATE CORP	10,523	121.99	1,283,700.77
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	132.01	382,829.00

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	31,705	52.02	1,649,294.10
AON PLC	8,192	251.13	2,057,256.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,055	44.55	626,150.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,940	153.23	1,216,646.20
ASSURANT INC	2,170	176.01	381,941.70
BROWN & BROWN INC	9,090	54.66	496,859.40
CHUBB LTD	16,095	197.94	3,185,844.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,900	116.42	686,878.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,055	173.04	182,557.20
EVEREST RE GROUP LTD	1,554	272.67	423,729.18
FNF GROUP	10,241	37.38	382,808.58
GLOBE LIFE INC	3,856	89.45	344,919.20
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	66.60	824,641.20
LINCOLN NATIONAL CORP	6,453	48.32	311,808.96
LOEWS CORP	7,105	58.54	415,926.70
MARKEL CORP	525	1,296.65	680,741.25
MARSH & MCLENNAN COS	19,273	147.26	2,838,141.98
METLIFE INC	26,495	61.86	1,638,980.70
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,930	63.94	634,924.20
PROGRESSIVE CORP	22,130	112.41	2,487,633.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,442	94.14	1,359,569.88
TRAVELERS COS INC/THE	9,144	166.31	1,520,738.64
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,538	194.87	884,320.06
WR BERKLEY CORP	8,091	66.74	539,993.34
CBRE GROUP INC - A	12,410	70.58	875,897.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.86	239,112.00
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	30.19	192,310.30
ACCENTURE PLC-CL A	23,938	275.12	6,585,822.56
ADOBE INC	17,934	370.82	6,650,285.88
AFFIRM HOLDINGS INC	6,670	17.70	118,059.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	89.30	538,479.00
ANSYS INC	3,295	229.76	757,059.20
APPROVIN CORP-CLASS A	3,960	32.35	128,106.00
AUTODESK INC	8,895	171.59	1,526,293.05
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,151	204.13	3,296,903.63

AVALARA INC	3,310	69.76	230,905.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,340	30.83	195,462.20
BILL.COM HOLDINGS INC	2,960	105.97	313,671.20
BLACK KNIGHT INC	5,860	64.42	377,501.20
BLOCK INC	19,410	60.30	1,170,423.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	134.42	591,448.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,400	143.39	1,491,256.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	45.16	238,444.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	121.45	491,872.50
CITRIX SYSTEMS INC	4,968	92.41	459,092.88
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	40.79	397,702.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,868	67.87	1,348,441.16
COUPA SOFTWARE INC	2,800	53.41	149,548.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,490	159.26	1,192,857.40
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,890	119.47	225,798.30
DATADOG INC-CLASS A	8,220	87.11	716,044.20
DOCUSIGN INC	7,340	57.28	420,435.20
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	20.55	239,613.00
DYNATRACE INC	7,560	38.82	293,479.20
EPAM SYSTEMS INC	2,205	278.36	613,783.80
FAIR ISAAC CORP	1,055	379.41	400,277.55
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23,268	95.25	2,216,277.00
FISERV INC	23,604	89.89	2,121,763.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,910	227.04	660,686.40
FORTINET INC	5,265	269.23	1,417,495.95
GARTNER INC	3,050	234.60	715,530.00
GLOBAL PAYMENTS INC	11,159	112.15	1,251,481.85
GODADDY INC-CLASS A	6,420	66.36	426,031.20
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	71.23	204,430.10
HUBSPOT INC	1,725	295.85	510,341.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,122	135.72	4,631,037.84
INTUIT INC	10,211	364.78	3,724,768.58
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	177.11	502,992.40
MASTERCARD INC	33,160	322.14	10,682,162.40
MICROSOFT CORP	270,044	244.49	66,023,057.56

MONGODB INC	2,320	241.00	559,120.00
NORTONLIFELOCK INC	22,205	21.99	488,287.95
OKTA INC	5,670	81.47	461,934.90
ORACLE CORP	60,463	70.72	4,275,943.36
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	61,210	7.82	478,662.20
PALO ALTO NETWORKS INC	3,740	481.63	1,801,296.20
PAYCHEX INC	12,502	117.47	1,468,609.94
PAYCOM SOFTWARE INC	1,930	270.45	521,968.50
PAYPAL HOLDINGS INC	42,417	72.46	3,073,535.82
PTC INC	4,450	99.89	444,510.50
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,990	48.69	145,583.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,065	380.66	1,547,382.90
SALESFORCE INC	37,176	164.45	6,113,593.20
SERVICENOW INC	7,565	444.75	3,364,533.75
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,740	113.87	995,223.80
SPLUNK INC	6,120	86.47	529,196.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	57.06	483,298.20
SYNOPSYS INC	5,837	295.16	1,722,848.92
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	16,510	45.40	749,554.00
TWILIO INC - A	7,425	81.86	607,810.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,570	310.58	487,610.60
UNITY SOFTWARE INC	6,770	33.76	228,555.20
VERISIGN INC	3,690	161.18	594,754.20
VISA INC-CLASS A SHARES	63,002	193.52	12,192,147.04
VMWARE INC-CLASS A	7,697	121.32	933,800.04
WESTERN UNION CO	14,561	16.46	239,674.06
WIX.COM LTD	2,280	55.59	126,745.20
WORKDAY INC-CLASS A	7,280	139.38	1,014,686.40
ZENDESK INC	5,650	57.01	322,106.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,290	106.86	992,729.40
ZSCALER INC	3,120	142.11	443,383.20
AMPHENOL CORP-CL A	23,480	65.53	1,538,644.40
APPLE INC	619,044	132.76	82,184,281.44
ARISTA NETWORKS INC	8,720	91.93	801,629.60
ARROW ELECTRONICS INC	2,750	114.04	313,610.00

CDW CORP/DE	5,150	162.50	836,875.00
CISCO SYSTEMS INC	157,030	42.91	6,738,157.30
COGNEX CORP	6,480	43.02	278,769.60
CORNING INC	29,878	32.10	959,083.80
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	47.35	481,644.20
F5 INC	2,385	150.79	359,634.15
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	48,285	13.67	660,055.95
HP INC	40,565	33.75	1,369,068.75
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	28.32	358,616.16
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,950	135.17	939,431.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,505	203.31	1,322,531.55
NETAPP INC	8,686	64.32	558,683.52
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,274	75.63	625,762.62
TE CONNECTIVITY LTD	12,355	118.39	1,462,708.45
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	364.83	638,452.50
TRIMBLE INC	9,520	59.16	563,203.20
WESTERN DIGITAL CORP	11,818	49.24	581,918.32
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,025	300.74	608,998.50
AT&T INC	271,047	19.45	5,271,864.15
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,285	21.45	113,363.25
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,131	22.51	250,558.81
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	10.59	364,147.74
T-MOBILE US INC	23,619	124.90	2,950,013.10
VERIZON COMMUNICATIONS INC	158,167	49.16	7,775,489.72
AES CORP	25,138	18.91	475,359.58
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	55.61	459,338.60
AMEREN CORPORATION	9,572	83.30	797,347.60
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,618	90.44	1,774,251.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	133.47	894,916.35
ATMOS ENERGY CORP	4,880	105.54	515,035.20
CENTERPOINT ENERGY INC	22,262	27.60	614,431.20
CMS ENERGY CORP	11,100	62.52	693,972.00
CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	88.78	1,144,906.88
CONSTELLATION ENERGY	12,568	54.44	684,201.92
DOMINION ENERGY INC	30,701	74.60	2,290,294.60

DTE ENERGY COMPANY	7,188	119.11	856,162.68
DUKE ENERGY CORP	29,356	100.94	2,963,194.64
EDISON INTERNATIONAL	14,439	60.98	880,490.22
ENTERGY CORP	7,507	107.29	805,426.03
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	41.84	384,509.60
EVERGY INC	8,720	61.32	534,710.40
EVERSOURCE ENERGY	13,070	80.74	1,055,271.80
EXELON CORP	37,166	42.31	1,572,493.46
FIRSTENERGY CORP	20,365	38.39	781,812.35
NEXTERA ENERGY INC	75,030	71.48	5,363,144.40
NISOURCE INC	15,050	27.60	415,380.00
NRG ENERGY INC	8,700	39.42	342,954.00
P G & E CORP	57,890	9.96	576,584.40
PPL CORP	28,368	26.03	738,419.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,908	60.97	1,213,790.76
SEMPRA ENERGY	12,317	144.82	1,783,747.94
SOUTHERN CO	40,215	66.78	2,685,557.70
UGI CORP	7,720	39.71	306,561.20
VISTRA CORP	16,750	22.96	384,580.00
WEC ENERGY GROUP INC	12,040	92.05	1,108,282.00
XCEL ENERGY INC	21,274	65.88	1,401,531.12
ADVANCED MICRO DEVICES	62,014	86.99	5,394,597.86
ANALOG DEVICES INC	20,297	147.17	2,987,109.49
APPLIED MATERIALS INC	33,433	96.62	3,230,296.46
BROADCOM INC	15,575	520.17	8,101,647.75
ENPHASE ENERGY INC	4,930	179.52	885,033.60
ENTEGRIS INC	5,050	98.76	498,738.00
INTEL CORP	154,222	37.93	5,849,640.46
KLA CORP	5,749	316.47	1,819,386.03
LAM RESEARCH CORP	5,322	449.77	2,393,675.94
MARVELL TECHNOLOGY INC	30,864	48.52	1,497,521.28
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,248	60.95	1,295,065.60
MICRON TECHNOLOGY INC	42,447	58.70	2,491,638.90
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	407.16	694,207.80
NVIDIA CORP	94,860	158.36	15,022,029.60

	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,037	168.29	1,689,126.73	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,640	56.65	942,656.00	
	QORVO INC	4,150	96.66	401,139.00	
	QUALCOMM INC	42,442	130.26	5,528,494.92	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,210	92.76	576,039.60	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	264.63	530,583.15	
	TERADYNE INC	6,190	90.91	562,732.90	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	34,922	154.08	5,380,781.76	
米ドル小計		12,451,492		1,229,920,989.15 (166,051,632,745)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	24,800	19.70	488,560.00	
	CAMECO CORP	16,672	28.86	481,153.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,954	78.48	3,527,989.92	
	CENOVUS ENERGY INC	49,873	28.73	1,432,851.29	
	ENBRIDGE INC	76,767	55.64	4,271,315.88	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	69.00	663,918.00	
	KEYERA CORP	8,460	33.47	283,156.20	
	PARKLAND CORP	6,170	37.22	229,647.40	
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,272	49.82	1,059,771.04	
	SUNCOR ENERGY INC	55,669	51.00	2,839,119.00	
	TC ENERGY CORP	37,383	70.19	2,623,912.77	
	TOURMALINE OIL CORP	11,250	70.36	791,550.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,586	62.89	1,105,983.54	
	BARRICK GOLD CORP	66,724	25.21	1,682,112.04	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	57.70	331,775.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	31.92	722,988.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,335	179.44	1,316,192.40	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	9.19	225,246.90	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	5.26	242,091.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	9.97	249,349.70	
	NUTRIEN LTD	21,298	113.00	2,406,674.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,660	27.05	207,203.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	51.16	919,601.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,700	105.71	391,127.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,985	50.40	906,444.00	

CAE INC	12,305	30.78	378,747.90
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	104.95	342,137.00
WSP GLOBAL INC	4,030	138.84	559,525.20
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	5,730	34.14	195,622.20
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	78.53	317,261.20
THOMSON REUTERS CORP	6,546	125.77	823,290.42
AIR CANADA	7,190	17.97	129,204.30
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,538	140.52	3,167,039.76
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	36,291	88.74	3,220,463.34
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	97.74	313,745.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,178	74.15	828,848.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,930	36.50	289,445.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,858	62.02	673,413.16
QUEBECOR INC -CL B	6,110	27.48	167,902.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	34.07	595,032.55
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,260	163.57	369,668.20
DOLLARAMA INC	11,190	72.28	808,813.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-A	32,620	54.35	1,772,897.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	39.77	276,401.50
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	112.52	619,872.68
METRO INC	9,920	67.90	673,568.00
WESTON (GEORGE) LTD	3,038	146.21	444,185.98
SAPUTO INC	9,620	27.18	261,471.60
BAUSCH HEALTH COS INC	11,634	9.59	111,570.06
BANK OF MONTREAL	24,391	128.40	3,131,804.40
BANK OF NOVA SCOTIA	46,399	80.66	3,742,543.34
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,590	64.98	2,312,638.20
NATIONAL BANK OF CANADA	12,680	89.10	1,129,788.00
ROYAL BANK OF CANADA	53,909	126.01	6,793,073.09
TORONTO-DOMINION BANK	69,410	89.35	6,201,783.50
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	53,939	58.22	3,140,328.58
IGM FINANCIAL INC	3,335	35.43	118,159.05
ONEX CORPORATION	2,765	68.71	189,983.15
TMX GROUP LTD	1,810	133.26	241,200.60
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	659.21	593,289.00

	GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	31.85	283,592.40	
	IA FINANCIAL CORP INC	3,895	62.17	242,152.15	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,745	175.61	1,184,489.45	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	73,821	21.91	1,617,418.11	
	POWER CORP OF CANADA	20,479	33.92	694,647.68	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	21,544	59.32	1,277,990.08	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	153.00	229,500.00	
	BLACKBERRY LTD	22,208	6.68	148,349.44	
	CGI INC	8,530	97.24	829,457.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	740	1,859.47	1,376,007.80	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	26.31	115,500.90	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	52.72	118,620.00	
	OPEN TEXT CORP	10,940	48.28	528,183.20	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	4,620	393.05	1,815,891.00	
	BCE INC	3,000	63.45	190,350.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	59.39	824,036.25	
	TELUS CORP	12,662	29.30	370,996.60	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	17.10	463,068.00	
	ALTAGAS LTD	9,000	27.69	249,210.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	44.93	244,643.85	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	38.44	175,286.40	
	EMERA INC	10,460	59.38	621,114.80	
	FORTIS INC	17,195	59.34	1,020,351.30	
	HYDRO ONE LTD	11,790	33.80	398,502.00	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	37.14	319,404.00	
加ドル小計		1,517,883		89,673,214.17	(9,343,948,916)
ユーロ	ENI SPA	94,656	13.17	1,246,619.52	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,705	12.62	236,057.10	
	NESTE OYJ	15,550	41.93	652,011.50	
	OMV AG	5,480	48.69	266,821.20	
	REPSOL SA	54,589	15.34	837,668.20	
	TENARIS SA	22,495	14.44	324,940.27	
	TOTALENERGIES SE	94,827	54.08	5,128,244.16	
	AIR LIQUIDE SA	19,899	134.98	2,685,967.02	

AKZO NOBEL	6,937	70.74	490,723.38
ARCELORMITTAL	22,612	25.93	586,442.22
ARKEMA	2,215	97.34	215,608.10
BASF SE	34,455	48.39	1,667,277.45
COVESTRO AG	7,410	39.60	293,436.00
CRH PLC	29,210	34.00	993,140.00
EVONIK INDUSTRIES AG	8,540	24.73	211,194.20
HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	49.68	283,921.20
KONINKLIJKE DSM NV	6,392	141.85	906,705.20
OCI NV	3,520	33.30	117,216.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,460	32.31	273,342.60
SOLVAY SA	2,811	86.74	243,826.14
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,835	15.58	340,298.47
SYMRISE AG	4,910	95.72	469,985.20
UMICORE	7,960	38.33	305,106.80
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	30.61	598,976.48
VOESTALPINE AG	4,249	25.56	108,604.44
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,386	24.02	201,431.72
AIRBUS GROUP SE	22,418	96.36	2,160,198.48
ALSTOM	11,635	25.01	290,991.35
BOUYGUES SA	9,460	30.28	286,448.80
BRENTAG SE	6,075	70.78	429,988.50
CNH INDUSTRIAL NV	37,680	12.46	469,681.20
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,146	48.24	923,603.04
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	15,636	27.36	427,800.96
DASSAULT AVIATION SA	900	155.10	139,590.00
EIFFAGE	3,250	87.76	285,220.00
FERROVIAL SA	18,485	23.27	430,145.95
GEA GROUP AG	6,020	34.74	209,134.80
IMCD NV	2,090	132.25	276,402.50
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	70.00	413,000.00
KION GROUP AG	2,874	39.31	112,976.94
KNORR-BREMSE AG	2,970	58.18	172,794.60
KONE OYJ-B	13,114	44.74	586,720.36
LEGRAND SA	10,178	72.20	734,851.60

MTU AERO ENGINES AG	2,020	168.75	340,875.00
PRYSMIAN SPA	9,565	27.68	264,759.20
RATIONAL AG	230	580.00	133,400.00
RHEINMETALL AG	1,570	206.70	324,519.00
SAFRAN SA	13,110	88.70	1,162,857.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,648	116.98	2,415,403.04
SIEMENS AG-REG	29,106	109.22	3,178,957.32
SIEMENS ENERGY AG	15,843	15.60	247,230.01
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	10,210	17.91	182,912.15
THALES SA	3,745	113.50	425,057.50
VINCI SA	20,900	83.69	1,749,121.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	7.22	131,332.32
BUREAU VERITAS SA	10,920	25.05	273,546.00
RANDSTAD NV	4,965	47.20	234,348.00
TELEPERFORMANCE	2,235	279.30	624,235.50
WOLTERS KLUWER	9,987	84.96	848,495.52
ADP	1,090	122.40	133,416.00
AENA SA	2,870	131.15	376,400.50
ATLANTIA SPA	18,740	22.23	416,590.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	5.71	136,402.56
DEUTSCHE POST AG-REG	37,463	34.58	1,295,470.54
GETLINK	14,730	16.92	249,231.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,385	77.61	961,199.85
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,740	71.90	197,006.00
CONTINENTAL AG	4,385	70.62	309,668.70
FERRARI NV	4,474	162.65	727,696.10
MERCEDES-BENZ GROUP AG	31,422	62.29	1,957,276.38
MICHELIN (CGDE)-B	6,139	108.60	666,695.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	68.46	388,168.20
RENAULT SA	6,837	24.25	165,797.25
STELLANTIS NV	75,346	12.47	940,167.38
VALEO SA	10,130	18.88	191,254.40
VOLKSWAGEN AG	1,261	191.45	241,418.45
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,123	144.16	1,026,851.68
ADIDAS AG	6,781	164.54	1,115,745.74

ESSILORLUXOTTICA	11,025	134.50	1,482,862.50
HERMES INTERNATIONAL	1,202	980.80	1,178,921.60
KERING	2,877	491.30	1,413,470.10
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,519	544.00	5,722,336.00
MONCLER SPA	8,080	38.38	310,110.40
PUMA SE	4,200	66.10	277,620.00
SEB SA	987	89.60	88,435.20
ACCOR SA	5,916	27.24	161,151.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,356	93.48	594,158.88
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	32.10	125,190.00
SODEXO	3,570	65.78	234,834.60
BOLLORE SE	33,530	4.75	159,267.50
PUBLICIS GROUPE	8,645	46.09	398,448.05
SCOUT24 SE	2,970	52.64	156,340.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	44.06	154,650.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	19.72	547,001.98
VIVENDI SE	26,070	10.91	284,423.70
D'IETEREN GROUP	830	140.40	116,532.00
DELIVERY HERO SE	6,600	31.83	210,078.00
INDITEX	40,125	22.51	903,213.75
JUST EAT TAKEAWAY	6,460	17.10	110,517.68
PROSUS	33,060	47.64	1,575,143.70
ZALANDO SE	8,260	27.67	228,554.20
CARREFOUR SA	24,723	18.76	463,927.09
HELLOFRESH SE	6,070	28.92	175,544.40
JERONIMO MARTINS	9,035	18.82	170,038.70
KESKO OYJ-B SHS	10,930	21.90	239,367.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,478	25.20	969,645.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,791	48.82	1,600,856.62
DANONE	24,684	51.74	1,277,150.16
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	9.02	179,166.10
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	69.90	281,347.50
HEINEKEN NV	9,673	89.00	860,897.00
JDE PEET'S NV	4,010	26.14	104,821.40
KERRY GROUP PLC-A	6,180	91.44	565,099.20

PERNOD-RICARD SA	7,926	169.30	1,341,871.80
REMY COINTREAU	810	152.70	123,687.00
BEIERSDORF AG	3,805	93.04	354,017.20
HENKEL AG & CO KGAA	4,030	58.45	235,553.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	58.78	376,956.14
L'OREAL	9,076	301.65	2,737,775.40
AMPLIFON SPA	4,830	26.37	127,367.10
BIOMERIEUX	1,690	85.58	144,630.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	112.75	181,527.50
DIASORIN SPA	930	111.50	103,695.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	50.46	384,151.98
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	29.63	465,042.85
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,620	20.91	723,904.20
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,020	314.90	321,198.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	49.76	529,446.40
ARGENX SE	1,755	313.90	550,894.50
BAYER AG-REG	37,694	63.61	2,397,715.34
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	77.84	393,092.00
GRIFOLS SA	9,910	17.61	174,564.65
IPSEN	1,350	84.50	114,075.00
MERCK KGAA	4,950	163.45	809,077.50
ORION OYJ-CLASS B	4,010	36.53	146,485.30
QIAGEN N.V.	8,944	40.83	365,183.52
RECORDATI SPA	3,920	37.58	147,313.60
SANOFI	43,326	94.15	4,079,142.90
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	296.30	320,004.00
UCB SA	4,928	79.02	389,410.56
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	10.18	154,430.60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,223	4.19	1,091,375.26
BANCO SANTANDER SA	654,049	2.62	1,715,570.52
BNP PARIBAS	42,532	47.33	2,013,252.22
CAIXABANK S.A	163,050	3.21	524,531.85
COMMERZBANK AG	38,844	7.52	292,184.56
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	8.83	359,874.08
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	26.43	302,834.94

FINECOBANK SPA	23,540	10.33	243,285.90
ING GROEP NV-CVA	147,865	9.62	1,423,052.76
INTESA SANPAOLO	630,593	1.77	1,116,149.61
KBC GROEP NV	9,719	54.02	525,020.38
MEDIOBANCA SPA	20,880	8.95	187,043.04
SOCIETE GENERALE	31,389	22.41	703,584.43
UNICREDIT SPA	79,596	9.71	773,275.14
AMUNDI SA	2,140	47.58	101,821.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	79,235	9.25	733,399.16
DEUTSCHE BOERSE AG	7,190	151.85	1,091,801.50
EURAZEO SE	1,487	64.35	95,688.45
EURONEXT NV	4,080	73.78	301,022.40
EXOR NV	4,164	60.40	251,505.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	79.74	323,903.88
SOFINA	655	198.50	130,017.50
WENDEL	1,000	86.00	86,000.00
AEGON NV	69,679	4.35	303,591.40
AGEAS	6,794	40.51	275,224.94
ALLIANZ SE-REG	15,588	182.06	2,837,951.28
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	15.51	655,477.72
AXA SA	74,692	22.39	1,672,353.88
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	139.25	316,793.75
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,176	219.40	1,135,614.40
NN GROUP NV	9,940	44.58	443,125.20
POSTE ITALIANE SPA	19,560	9.11	178,348.08
SAMPO OYJ-A SHS	18,999	40.60	771,359.40
AROUNDTOWN SA	35,980	3.60	129,815.84
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	83.16	205,405.20
VONOVIA SE	27,119	31.62	857,502.78
ADYEN NV	750	1,155.40	866,550.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	50.68	866,121.20
BECHTLE AG	3,070	36.56	112,239.20
CAP GEMINI SA	6,109	165.75	1,012,566.75
DASSAULT SYSTEMES SE	24,650	33.49	825,651.75
EDENRED	9,626	42.72	411,222.72

NEMETSCHKE SE	2,350	57.46	135,031.00
NEXI SPA	17,180	7.31	125,585.80
SAP SE	39,782	87.01	3,461,431.82
WORLDLINE SA	8,950	32.54	291,233.00
NOKIA OYJ	203,856	4.52	921,429.12
CELLNEX TELECOM SA	19,720	35.48	699,665.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	122,466	17.81	2,182,099.18
ELISA OYJ	5,465	52.52	287,021.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.24	140,201.14
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	3.31	436,405.49
ORANGE S.A.	76,994	10.86	836,308.82
PROXIMUS	5,600	15.14	84,812.00
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.24	99,367.27
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.78	90,266.60
TELEFONICA SA	195,629	4.40	862,528.26
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	28.59	114,360.00
ACCIONA SA	850	177.20	150,620.00
E.ON SE	82,679	9.09	751,552.11
EDF	19,505	8.16	159,160.80
EDP RENOVAVEIS SA	11,010	21.64	238,256.40
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	105,831	4.48	474,969.52
ELIA GROUP SA/NV	960	143.00	137,280.00
ENAGAS SA	8,240	20.92	172,380.80
ENDESA SA	12,050	19.08	229,974.25
ENEL SPA	314,737	5.33	1,678,492.42
ENGIE	70,164	11.95	839,021.11
FORTUM OYJ	16,755	16.57	277,714.12
IBERDROLA SA	223,492	9.87	2,206,313.02
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	27.07	169,241.64
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,000	17.96	305,405.00
RWE AG	24,345	38.17	929,248.65
SNAM SPA	72,420	5.08	368,183.28
TERNA SPA	53,627	7.22	387,615.95
UNIPER SE	3,530	20.62	72,788.60
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,600	23.50	578,100.00

	VERBUND AG	2,780	94.25	262,015.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,865	256.05	477,533.25	
	ASML HOLDING NV	15,467	471.20	7,288,050.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	50,255	24.27	1,219,688.85	
	STMICROELECTRONICS NV	26,093	32.50	848,022.50	
ユーロ小計		6,962,149		152,834,441.17	(21,519,089,316)
英債券	BP PLC	751,268	4.34	3,267,640.16	
	SHELL PLC-NEW	287,747	23.08	6,641,200.76	
	ANGLO AMERICAN PLC	48,914	34.55	1,689,978.70	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	13.93	199,616.90	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,031	59.66	300,149.46	
	GLENCORE PLC	374,873	4.83	1,811,761.20	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,559	19.88	170,195.71	
	MONDI PLC	18,370	14.23	261,496.95	
	RIO TINTO PLC	42,315	55.55	2,350,598.25	
	ASHTREAD GROUP PLC	17,940	36.51	654,989.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	7.74	937,624.22	
	BUNZL PLC	12,896	26.23	338,262.08	
	DCC PLC	3,820	52.02	198,716.40	
	FERGUSON PLC	8,202	91.86	753,435.72	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.51	246,169.20	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	0.87	282,250.45	
	SMITHS GROUP PLC	15,443	14.74	227,707.03	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	92.84	241,384.00	
	EXPERIAN PLC	34,178	23.23	793,954.94	
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	42.33	255,038.25	
	RELX PLC	73,985	20.81	1,539,627.85	
	RENTOKIL INITIAL PLC	73,630	4.52	333,102.12	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.87	198,387.84	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	40.25	181,728.75	
	BURBERRY GROUP PLC	17,184	15.93	273,741.12	
	PERSIMMON PLC	12,440	21.50	267,460.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.24	154,740.23	
	COMPASS GROUP PLC	68,988	16.70	1,152,099.60	

ENTAIN PLC	21,400	13.41	287,081.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,203	43.51	313,402.53
WHITBREAD PLC	8,260	25.66	211,951.60
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	5.13	187,288.32
INFORMA PLC	56,580	5.01	283,918.44
PEARSON PLC	30,609	7.38	226,016.85
WPP PLC	44,814	8.18	366,578.52
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.11	108,788.62
KINGFISHER PLC	78,137	2.34	183,465.67
NEXT PLC	5,097	59.38	302,659.86
OCADO GROUP PLC	17,490	7.84	137,226.54
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.03	143,531.83
TESCO PLC	293,318	2.46	723,615.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	15.68	205,865.62
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	82,247	35.04	2,882,346.11
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	16.74	128,730.60
DIAGEO PLC	87,472	34.48	3,016,034.56
IMPERIAL BRANDS PLC	34,492	18.01	621,200.92
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	27,415	59.88	1,641,610.20
UNILEVER PLC	96,672	36.09	3,489,375.84
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	31,596	11.64	367,777.44
ASTRAZENECA PLC	58,902	97.50	5,742,945.00
GSK PLC	191,781	17.12	3,283,674.28
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	15.09	116,080.55
BARCLAYS PLC	633,451	1.56	992,997.78
HSBC HOLDINGS PLC	775,091	5.20	4,033,573.56
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,799,136	0.43	1,213,985.28
NATWEST GROUP PLC	207,830	2.21	460,135.62
STANDARD CHARTERED PLC	99,570	5.99	597,021.72
3I GROUP PLC	36,819	11.04	406,665.85
ABRDN PLC	88,515	1.69	149,944.41
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	7.71	100,488.36
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,467	67.38	840,026.46
M&G PLC	99,522	2.01	200,835.39

	SCHRODERS PLC	4,131	26.26	108,480.06	
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	11.03	226,658.90	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	21.30	144,733.50	
	AVIVA PLC	109,854	4.04	443,920.01	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	204,501	2.41	493,869.91	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	6.07	150,596.70	
	PRUDENTIAL PLC	100,122	9.73	974,787.79	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	23.65	106,779.75	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	5.98	232,418.56	
	HALMA PLC	14,690	19.36	284,471.85	
	BT GROUP PLC	277,852	1.79	499,161.11	
	VODAFONE GROUP PLC	1,043,328	1.25	1,310,002.63	
	NATIONAL GRID PLC	137,568	10.50	1,445,151.84	
	SEVERN TRENT PLC	9,023	28.07	253,275.61	
	SSE PLC	39,837	16.41	653,924.35	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.28	268,359.40	
英ボンド小計		10,915,524		67,286,490.09	(10,914,541,557)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,570	18.62	140,953.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	717.00	193,590.00	
	GIVAUDAN-REG	353	3,124.00	1,102,772.00	
	HOLCIM LTD	19,239	45.63	877,875.57	
	SIKA AG-REG	5,505	227.20	1,250,736.00	
	ABB LTD-REG	62,865	27.47	1,726,901.55	
	GEBERIT AG-REG	1,380	472.00	651,360.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	800	171.00	136,800.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	175.50	259,740.00	
	VAT GROUP AG	990	241.00	238,590.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,477	33.50	183,479.50	
	SGS SA-REG	233	2,123.00	494,659.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	233.70	465,063.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,929	98.84	1,969,782.36	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,270	229.00	290,830.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	43.24	79,994.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	125	2,076.00	259,500.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,350.00	374,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	96,700.00	483,500.00	
	NESTLE SA-REG	106,490	108.62	11,566,943.80	
	ALCON INC	19,484	66.32	1,292,178.88	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	314.40	644,834.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,050	102.30	414,315.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,400	68.55	95,970.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,873	502.20	1,442,820.60	
	NOVARTIS AG-REG	82,883	80.72	6,690,315.76	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,040	350.00	364,000.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,683	305.75	8,158,327.25	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	99,708	5.90	588,676.03	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	46.06	387,825.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	852.00	749,760.00	
	UBS GROUP AG-REG	135,412	15.99	2,165,237.88	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,630	153.80	250,694.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,180	513.00	605,340.00	
	SWISS RE AG	11,379	76.00	864,804.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,751	419.10	2,410,244.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,551	88.55	225,891.05	
	TEMENOS AG	2,640	72.06	190,238.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	51.84	345,254.40	
	SWISSCOM AG-REG	1,029	530.20	545,575.80	
	スイスフラン小計	655,565		51,179,372.93 (6,909,727,139)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	7,430	480.40	3,569,372.00	
	BOLIDEN AB	10,090	357.10	3,603,139.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,220	450.40	1,450,288.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	161.40	3,660,552.00	
	ALFA LAVAL AB	10,550	244.00	2,574,200.00	
	ASSA ABLOY AB-B	38,560	220.60	8,506,336.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	102,900	100.36	10,327,044.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	63,700	87.70	5,586,490.00	
	EPIROC AB-A	24,905	177.20	4,413,166.00	
	EPIROC AB-B	15,450	151.45	2,339,902.50	

HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	77.68	1,165,200.00	
INDUTRADE AB	9,540	206.00	1,965,240.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	209.10	1,421,880.00	
LIFCO AB-B SHS	8,470	172.75	1,463,192.50	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,120	71.84	4,031,660.80	
SANDVIK AB	43,720	189.10	8,267,452.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,390	162.15	2,333,338.50	
SKF AB-B SHARES-B	14,079	166.75	2,347,673.25	
VOLVO AB-A SHS	7,120	171.20	1,218,944.00	
VOLVO AB-B SHS-B	55,270	164.54	9,094,125.80	
SECURITAS AB-B SHS	14,629	87.84	1,285,011.36	
VOLVO CAR AB-B	20,400	74.17	1,513,068.00	
ELECTROLUX AB-B	8,095	134.04	1,085,053.80	
EVOLUTION AB	6,580	905.50	5,958,190.00	
EMBRACER GROUP AB	23,940	80.75	1,933,155.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	133.24	3,710,467.52	
SWEDISH MATCH AB	60,180	101.00	6,078,180.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,755	251.90	6,739,584.50	
GETINGE AB-B SHS	9,750	250.00	2,437,500.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,560	217.00	1,206,520.00	
NORDEA BANK ABP	122,382	98.14	12,010,569.48	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	108.60	6,782,070.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	47,710	94.70	4,518,137.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	149.40	5,161,770.00	
EQT AB	10,680	218.50	2,333,580.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	236.80	1,180,211.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	234.80	1,404,104.00	
INVESTOR AB-A SHS	19,180	189.10	3,626,938.00	
INVESTOR AB-B SHS	69,350	170.88	11,850,528.00	
KINNEVIK AB - B	8,285	168.00	1,391,880.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	2,260	428.10	967,506.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	54.76	1,271,527.20	
SAGAX AB-B	5,630	204.60	1,151,898.00	
SINCH AB	18,850	37.52	707,346.25	
ERICSSON LM-B SHS	111,765	75.25	8,410,316.25	

	HEXAGON AB-B SHS	72,920	109.15	7,959,218.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,705	115.10	2,152,945.50	
	TELIA CO AB	94,230	39.05	3,679,681.50	
スウェーデンクローナ小計		1,466,862		187,846,152.91 (2,488,961,526)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,480	414.50	2,271,460.00	
	EQUINOR ASA	36,424	353.70	12,883,168.80	
	NORSK HYDRO A S	50,660	64.04	3,244,266.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	472.00	3,148,240.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	65.85	750,690.00	
	MOWI ASA	16,360	239.30	3,914,948.00	
	ORKLA ASA	27,860	73.14	2,037,680.40	
	SALMAR ASA	1,990	680.50	1,354,195.00	
	DNB BANK ASA	35,845	183.15	6,565,011.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,810	194.00	1,321,140.00	
	TELENOR ASA	23,915	127.60	3,051,554.00	
ノルウェークローネ小計		223,414		40,542,354.35 (546,916,360)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	475.90	1,827,456.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	400.80	3,172,332.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,800.00	567,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,290	160.28	6,137,121.20	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	110	18,340.00	2,017,400.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	208	18,555.00	3,859,440.00	
	DSV A/S	7,650	994.60	7,608,690.00	
	PANDORA A/S	3,290	482.50	1,587,425.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	847.60	3,348,020.00	
	COLOPLAST-B	4,485	749.60	3,361,956.00	
	DEMANT A/S	4,410	273.30	1,205,253.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	237.10	1,178,387.00	
	GENMAB A/S	2,485	1,968.50	4,891,722.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,065	755.40	48,394,701.00	
	DANSKE BANK A/S	26,635	109.60	2,919,196.00	
TRYG A/S	13,945	155.45	2,167,750.25		
ORSTED A/S	7,410	693.70	5,140,317.00		

デンマーククローネ小計		193,973		99,384,166.95 (1,881,342,280)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	34.44	302,211.00	
	SANTOS LTD	114,190	8.10	924,939.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	23.83	199,457.10	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,206	32.99	2,349,085.94	
	BHP GROUP LTD	192,657	44.26	8,526,998.82	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	16.47	301,565.70	
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	3.33	229,770.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,055	19.63	1,257,399.65	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	32.47	550,528.85	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,240	55.56	346,694.40	
	NEWCREST MINING LTD	30,209	23.22	701,452.98	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	8.06	340,051.40	
	ORICA LIMITED	17,675	15.67	276,967.25	
	RIO TINTO LTD	14,138	111.05	1,570,024.90	
	SOUTH32 LTD	187,547	4.49	842,086.03	
	REECE LTD	10,200	13.88	141,576.00	
	BRAMBLES LTD	54,798	10.50	575,379.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	4.02	295,751.40	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,000	4.84	212,960.00	
	TRANSURBAN GROUP	113,696	13.97	1,588,333.12	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,000	34.25	753,500.00	
	CROWN RESORTS LTD	15,925	13.05	207,821.25	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	63.68	135,638.40	
	IDP EDUCATION LTD	7,220	22.15	159,923.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	70,974	4.59	325,770.66	
	REA GROUP LTD	1,820	103.44	188,260.80	
	SEEK LTD	10,700	21.71	232,297.00	
WESFARMERS LTD	42,745	42.00	1,795,290.00		
COLES GROUP LTD	52,085	17.14	892,736.90		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	7.15	360,803.30		
WOOLWORTHS GROUP LTD	45,862	33.83	1,551,511.46		
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,396	10.85	373,196.60		
COCHLEAR LTD	2,527	205.64	519,652.28		

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,305	74.78	471,487.90	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	33.32	588,431.20	
	CSL LTD	18,072	264.05	4,771,911.60	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	106,839	22.00	2,350,458.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	65,007	91.20	5,928,638.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	125,023	26.84	3,355,617.32	
	WESTPAC BANKING CORP	136,331	20.07	2,736,163.17	
	ASX LTD	7,105	77.52	550,779.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	12,764	163.35	2,084,999.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.17	396,671.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	92,560	3.07	284,159.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	11.50	634,915.00	
	SUNCORP GROUP LTD	51,856	10.48	543,450.88	
	COMPUTERSHARE LTD	25,890	23.53	609,191.70	
	WISETECH GLOBAL LTD	6,970	36.64	255,380.80	
	XERO LTD	6,380	81.90	522,522.00	
	TELSTRA CORPORATION LTD	163,984	3.75	614,940.00	
	APA GROUP	45,818	11.50	526,907.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	5.92	404,454.40	
	豪ドル小計	2,623,846		56,660,713.01 (5,275,112,381)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.27	342,889.55	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	19.50	451,035.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.53	346,893.81	
	MERCURY NZ LTD	20,400	5.36	109,344.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	4.43	203,691.40	
	ニュージーランドドル小計	213,252		1,453,853.76 (122,051,023)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	102,208	53.00	5,417,024.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	93.20	4,893,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	17.52	1,243,920.00	
	MTR CORP	57,500	41.50	2,386,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	25.85	1,344,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	86,000	41.25	3,547,500.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	15.04	1,452,864.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	20.60	1,398,740.00	
	WH GROUP LTD	339,394	5.59	1,897,212.46	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	134,500	30.55	4,108,975.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	137.00	3,986,700.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,100	341.60	15,747,760.00	
	AIA GROUP LTD	460,790	78.60	36,218,094.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	51.95	4,002,124.10	
	ESR CAYMAN LTD	75,800	21.10	1,599,380.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	14.38	1,121,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	29.40	1,702,289.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	29.20	1,800,647.20	
	SINO LAND CO	143,050	11.20	1,602,160.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	49,480	93.30	4,616,484.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	47.80	837,312.60	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	19.08	793,728.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	34.60	2,207,480.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.72	1,608,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	51.35	1,283,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	75.50	4,492,250.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.64	725,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	384,237	8.53	3,277,541.61	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	51.15	2,813,250.00	
香港ドル小計		3,030,181		118,126,076.37 (2,031,768,513)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	6.69	356,978.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,900	3.98	206,562.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.13	276,507.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.75	158,325.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.06	300,277.60	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,695	29.82	2,137,944.90	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	131,740	11.43	1,505,788.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	27.09	1,132,362.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,700	9.64	286,308.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.65	383,250.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.92	137,016.00	

	UOL GROUP LTD	15,550	7.20	111,960.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	17.04	168,696.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	304,780	2.52	768,045.60	
シンガポールドル小計		1,171,685		7,930,020.70 (768,815,506)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	35.58	928,282.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	678.00	684,780.00	
	BANK HAPOALIM BM	41,135	30.09	1,237,752.15	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,005	31.10	1,772,855.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	18.03	871,389.90	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	110.50	541,450.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	231.50	412,070.00	
	NICE LTD	2,440	657.00	1,603,080.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	3,740	161.20	602,888.00	
イスラエルシュケル小計		186,430		8,654,547.75 (337,027,994)	
合 計		41,612,256		228,190,935,256 (228,190,935,256)	

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	709,338.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11,390	375,186.60	
		AMERICAN TOWER CORP	17,314	4,059,959.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,650	335,368.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	995,396.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	518,188.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	509,040.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	16,470	2,600,942.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,005	1,370,892.85	
		DUKE REALTY CORPORATION	14,585	746,752.00	
		EQUINIX INC	3,443	2,129,529.93	

		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	432,621.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,690	941,598.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	635,400.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	811,161.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	477,590.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	466,935.22	
		INVITATION HOMES INC	22,810	767,100.30	
		IRON MOUNTAIN INC	10,555	499,040.40	
		KIMCO REALTY CORP	22,800	437,760.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	300,294.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	680,127.50	
		PROLOGIS INC	28,078	3,107,111.48	
		PUBLIC STORAGE	6,039	1,798,655.76	
		REALTY INCOME CORP	22,221	1,395,256.59	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	339,883.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,210	1,250,622.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,504	1,206,761.04	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	661,555.20	
		UDR INC	12,100	512,072.00	
		VENTAS INC	14,825	717,974.75	
		VICI PROPERTIES INC	38,010	1,069,221.30	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	198,404.96	
		WELLTOWER INC	16,770	1,298,836.50	
		WEYERHAEUSER CO	27,758	955,430.36	
		WP CAREY INC	6,630	536,831.10	
米ドル小計			513,259	35,848,841.03	(4,839,952,027)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	123,704.00	
加ドル小計			2,800	123,704.00	(12,889,956)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	109,147.50	
		GECINA SA	1,950	186,615.00	
		KLEPIERRE	8,402	158,125.64	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,940	264,290.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	158,721.60	

ユーロ小計			22,377	876,899.74 (123,467,483)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	187,345.74
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	194,781.18
		SEGRO PLC	45,033	429,975.08
英ポンド小計			108,638	812,102.00 (131,731,065)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	35,587	322,774.09
		GOODMAN GROUP	63,582	1,138,753.62
		GPT GROUP	71,335	296,753.60
		LENDLEASE GROUP	28,927	278,856.28
		MIRVAC GROUP	135,075	276,903.75
		SCENTRE GROUP	198,271	505,591.05
		STOCKLAND	96,900	348,840.00
		VICINITY CENTRES	154,902	270,303.99
豪ドル小計			784,579	3,438,776.38 (320,150,080)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	81,700	5,588,280.00
香港ドル小計			81,700	5,588,280.00 (96,118,416)
シンガ ポール ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	319,668.25
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	444,258.72
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	127,072.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	234,180.72
シンガポールドル小計			542,555	1,125,179.69 (109,086,170)
合計				5,633,395,197 (5,633,395,197)

(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	603銘柄	97.2%		70.9%
	投資証券	36銘柄		2.8%	2.1%
加ドル	株式	85銘柄	99.9%		4.0%
	投資証券	1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式	223銘柄	99.4%		9.2%
	投資証券	5銘柄		0.6%	0.1%
英ポンド	株式	79銘柄	98.8%		4.7%
	投資証券	3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式	48銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式	52銘柄	94.3%		2.3%
	投資証券	8銘柄		5.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	29銘柄	95.5%		0.9%
	投資証券	1銘柄		4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.6%		0.3%
	投資証券	4銘柄		12.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9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2022年 6月30日現在です。

## 【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	36,752,128,246円
負債総額	33,117,302円
純資産総額( - )	36,719,010,944円
発行済口数	36,004,329,112口
1口当たり純資産額( / )	1.0198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	62,548,090,953円
負債総額	1,729,932,539円
純資産総額( - )	60,818,158,414円
発行済口数	23,773,223,236口
1口当たり純資産額( / )	2.5583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	56,361,280,312円
負債総額	94,858,668円
純資産総額( - )	56,266,421,644円
発行済口数	19,574,512,040口
1口当たり純資産額( / )	2.8745円

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	48,444,077,809円
負債総額	138,006,891円
純資産総額（ - ）	48,306,070,918円
発行済口数	35,150,867,358口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3742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	156,842,583,182円
負債総額	636,635,202円
純資産総額（ - ）	156,205,947,980円
発行済口数	59,399,059,276口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6298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	42,291,539,736円
負債総額	591,504,756円
純資産総額（ - ）	41,700,034,980円
発行済口数	22,604,065,279口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8448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	245,934,210,261円
負債総額	153,654,758円
純資産総額（ - ）	245,780,555,503円
発行済口数	60,057,227,117口
1口当たり純資産額（ / ）	4.0924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

2022年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の意思決定機関（2022年6月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

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

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

###### ・監査等委員会

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

##### (3) 運用の意思決定プロセス（2022年6月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）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、2022年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	875	235,926
株式投資信託	807	200,387
単位型	311	10,626
追加型	496	189,761
公社債投資信託	68	35,539
単位型	55	1,656
追加型	13	33,882

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第62期 (2021年3月31日)		第63期 (2022年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,698		42,427
有価証券		17		170
前払費用		785		932
未収入金		225		96
未収委託者報酬		24,738		25,193
未収収益	3	891	3	1,048
関係会社短期貸付金		2,403		5,005
立替金		930		1,056
その他	2	361	2	998
流動資産合計		55,053		76,928
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	245	1	244
器具備品	1	190	1	153
有形固定資産合計		436		397
無形固定資産				
ソフトウェア		241		335
無形固定資産合計		241		335
投資その他の資産				
投資有価証券		22,903		23,969
関係会社株式		25,987		22,366
長期差入保証金		678		652
繰延税金資産		1,845		3,678

投資その他の資産合計	51,414	50,667
固定資産合計	52,092	51,399
資産合計	107,145	128,328

(単位：百万円)

	第62期 (2021年3月31日)		第63期 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>			
<b>流動負債</b>			
預り金	844		651
未払金	9,834		9,693
未払収益分配金	8		7
未払償還金	71		71
未払手数料	8,956		8,783
その他未払金	798		831
未払費用	3	4,660	3
未払法人税等		1,090	
未払消費税等	4	775	4
賞与引当金		3,034	
役員賞与引当金		55	
訴訟損失引当金		-	
その他		643	
流動負債合計		20,938	
<b>固定負債</b>			
退職給付引当金		1,456	
賞与引当金		156	
その他		544	
固定負債合計		2,157	
負債合計		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		61,956	
利益剰余金合計		61,956	
自己株式		2,067	
株主資本合計		82,472	
<b>評価・換算差額等</b>			
その他有価証券評価差額金		1,461	
繰延ヘッジ損益		115	
評価・換算差額等合計		1,577	
純資産合計		84,049	
負債純資産合計		107,145	

## (2) 【損益計算書】

	第62期		第63期	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		78,975		94,938
その他営業収益		3,973		4,743
営業収益合計		82,948		99,682
営業費用				
支払手数料		34,050		42,026
広告宣伝費		953		987
公告費		1		1
調査費		17,813		23,000
調査費		966		1,042
委託調査費		16,825		21,932
図書費		22		25
委託計算費		545		598
営業雑経費		1,053		1,014
通信費		174		143
印刷費		331		308
協会費		51		52
諸会費		11		13
その他		483		494
営業費用計		54,419		67,628
一般管理費				
給料		10,383		11,759
役員報酬		243		156
役員賞与引当金繰入額		55		5
給料・手当		6,766		7,229
賞与		159		143
賞与引当金繰入額		3,158		4,225
交際費		14		22
寄付金		30		29
旅費交通費		57		66
租税公課		485		429
不動産賃借料		939		937
退職給付費用		388		394
退職金		10		169
固定資産減価償却費		138		172
福利費		1,084		1,171
諸経費		4,286		3,888
一般管理費計		17,817		19,042
営業利益		10,711		13,010

(単位:百万円)

	第62期		第63期	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業外収益				
受取利息		75		71
受取配当金	1	2,555	1	5,257
有価証券償還益		14		-
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		-		1,548
その他		62		58

営業外収益合計	2,710	6,936
営業外費用		
支払利息	122	177
デリバティブ費用	804	49
時効成立後支払分配金・償還金	25	9
為替差損	59	-
その他	42	39
営業外費用合計	1,054	275
経常利益	12,367	19,672
特別利益		
投資有価証券売却益	774	253
子会社有償減資払戻益	-	1,445
その他	0	-
特別利益合計	774	1,699
特別損失		
投資有価証券売却損	237	132
投資有価証券評価損	5	-
固定資産処分損	0	0
役員退職一時金	125	-
訴訟損失引当金繰入額	-	7,847
特別損失合計	369	7,980
税引前当期純利益	12,773	13,391
法人税、住民税及び事業税	3,722	3,435
法人税等還付税額	-	2 329
法人税等調整額	373	1,851
法人税等合計	3,348	1,255
当期純利益	9,424	12,136

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

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

第63期（自 2021年4月1日 至 2022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	61,956	61,956	2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,944	6,944	-	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417

	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	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	889	847	41	41
当期変動額合計	889	847	41	6,985
当期末残高	2,350	731	1,618	91,035

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	<p style="text-align: center;">第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)</p>
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翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 訴訟損失引当金  訴訟による損失に備えるため、損失見込額を計上しております。</p>
4 収益の計上基準	<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  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 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 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 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>
6 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 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

## (会計方針の変更)

<p>第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)</p>
<p>(収益認識に関する会計基準の適用) 「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。 収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の利益剰余金に加減し、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) 「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。)等を当事業年度の期首から適用し、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、当財務諸表に与える影響はありません。 また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては、記載していません。</p>

## (未適用の会計基準等)

- ・ 「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 2021年6月17日)

## (1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

- (2) 適用予定日  
2023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  
当該適用指針の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

## (重要な会計上の見積り)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

- 1 当事業年度の財務諸表に計上した金額  
訴訟損失引当金を7,847百万円計上しております。
- 2 会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報  
(1) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出方法  
訴訟について将来発生しうる損失の見込額を算出し、訴訟損失引当金として計上しています。
- (2) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出に用いた主要な仮定  
原告が主張する損害額に基づき、将来発生することが予想される損失の見積を行っています。
- (3) 翌事業年度の財務諸表に与える影響  
当社では、現在までに想定しうる最善の仮定に基づき訴訟損失引当金を計上しておりますが、今後の経過により、翌事業年度において訴訟損失引当金の追加計上または取り崩しを行う可能性があります。

## (貸借対照表関係)

第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,349百万円 器具備品 764百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,390百万円 器具備品 823百万円
2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 257百万円 (流動負債) 未払費用 1,247百万円	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 233百万円 (流動負債) 未払費用 2,314百万円
4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。	4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。
	5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「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。

## (損益計算書関係)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 2,498百万円	1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 5,194百万円

	2 法人税等還付税額 過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を計上しています。
--	--

## (株主資本等変動計算書関係)

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(1)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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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)	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	432,300	-	432,300	-	-
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	-	956,000	816,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,607,000	-	1,071,000	1,536,000	-
合計		5,827,300	-	3,387,300	2,440,000	-

(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 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)816,000株及び2017年度ストックオプション(1)847,000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、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
2022年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

#### (リース取引関係)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第63期 (自 2021年4月1日 至 2022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	911百万円	1年内	911百万円
1年超	5,236百万円	1年超	4,324百万円
合計	6,148百万円	合計	5,236百万円

#### (金融商品関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

##### 1 金融商品の状況に関する事項

###### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主

に自己で設定した投資信託へのシ - 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「5 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 デリバティブ取引計	(453) (642)	(453) (642)	- -

(1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

- (5) 有価証券及び投資有価証券  
投資信託は基準価額によっております。
- (6) 未払金及び(7) 未払費用  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
- (8) デリバティブ取引  
(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額23,094百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び

経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等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)

	貸借対照表計上額 (*4)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
デリバティブ取引 (*1)				
株式関連 (*2)	262	-	-	262
通貨関連 (*3)	-	1,066	-	1,066
デリバティブ取引計	262	1,066	-	1,329

- ( 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 262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- ( 3 ) 通貨関連のデリバティブ取引の 1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- ( 4 ) 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。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

### (2) 時価をもって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	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

## 3 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	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

(有価証券関係)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、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	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,188	3,369	180
	小計	3,188	3,369	180
合計		24,123	20,735	3,387

(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。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格の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。

## 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	3,079	253	132
合計	3,079	253	132

(デリバティブ取引関係)

第62期(2021年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

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

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		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。

第63期(2022年3月31日)

### 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,306	-	262	262
	買建	-	-	-	-
合計		2,306	-	262	262

(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	4,708	-	293	293
合計		4,708	-	293	293

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		5,445	-	367
	豪ドル		222	-	20
	香港ドル		1,097	-	59
	人民元		5,185	-	324
	ユーロ		35	-	0
	合計		11,986	-	772

## (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62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022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 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964

## (退職給付関係)

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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	211
退職給付債務の期末残高	1,352

- (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	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
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	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

- (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 0.3%

- 3 確定拠出制度  
 当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

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	752,300	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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況  
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	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	88,000
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	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694

付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0	0
-----------------------------	---	---

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。  
 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,222百万円  
 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62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の 内訳  (単位:百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の 内訳  (単位:百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 929	賞与引当金 1,341
投資有価証券評価損 97	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 52
退職給付引当金 446	退職給付引当金 427
固定資産減価償却費 90	固定資産減価償却費 87
その他 978	繰延ヘッジ損益 322
繰延税金資産小計 3,972	訴訟損失引当金 2,403
評価性引当金 1,430	その他 1,039
繰延税金資産合計 2,541	繰延税金資産小計 5,772
	評価性引当金(注) 52
繰延税金負債	繰延税金資産合計 5,719
繰延ヘッジ利益 51	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 645	その他有価証券評価差額金 1,092
繰延税金負債合計 696	その他 948
繰延税金資産の純額 1,845	繰延税金負債合計 2,041
	繰延税金資産の純額 3,678
	(注)関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した 評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円 減少しております。
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率 との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因と なった主要な項目別の内訳	2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率 との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因と なった主要な項目別の内訳
法定実効税率 30.6%	法定実効税率 30.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.3%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%
その他 1.0%	評価性引当金の減少 10.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 26.2%	その他 0.1%
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 9.4%

## (関連当事者情報)

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)
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	-	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	1,825 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付(円貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注2)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	1,783 (USD 17,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	増資の引受(注3)	217 (EUR 1,750千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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 Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(米国ドル貨建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	2,019 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貨建)(注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86千)
							資金の返済(円貨建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(円貨建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	2,788 (SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	2,985 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	23 (SGD 266千)	未収収益	23 (SGD 266千)
減資(注2)	9,149 (SGD 110,000千)	-	-							
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注3)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	3,788 (USD 34,000千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万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 Asset Management International Limitedの行った110,000千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
- 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2021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	34,450百万円
負債合計	6,257百万円
純資産合計	28,192百万円
営業収益	18,176百万円
税引前当期純利益	5,587百万円
当期純利益	3,956百万円

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度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。

(1株当たり情報)

項目	第62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	432円90銭	468円88銭
1株当たり当期純利益金額	48円45銭	62円50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いません。

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62期	第63期
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,424	12,136
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)	9,424	12,136
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,509	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) 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	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) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000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62期	第63期
	(2021年3月31日)	(2022年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	84,049	91,035
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)	84,049	91,035
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)	194,152	194,152

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。)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 (2022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 (2022年3月末現在)	事業の内容

auカブコム証券株式会社	7,196百万円	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。
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	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村證券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社 1	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	11,757百万円	
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	17,495百万円	
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	25,984百万豪ドル (2021年9月末現在)	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社三十三銀行 1	37,461百万円	
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	20,851百万円	
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
新潟かがやき農業協同組合	13,100百万円 (2022年4月1日現在)
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
富士伊豆農業協同組合	119,168百万円 (2022年4月1日現在)
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
とぴ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
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12月28日	臨時報告書
2022年 3月15日	有価証券届出書
2022年 3月15日	有価証券報告書
2022年 3月31日	臨時報告書

## 独立監査人の監査報告書

2022年6月13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 三 上 和 彦  
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2022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。

### その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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9月7日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w C 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 辻村 和之  
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12月16日から2022年6月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

### 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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記の監査報告書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。